

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a CRCC a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva

30 de Octubre de 2020

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	21	24	5
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2,768	4,734	245
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	104,330	178,440	9,240
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	94,394	163,570	5,544
DF = DFCCP + DF'CM	97,162	168,304	5,789
\sum (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	48	7,224	1,126
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	1	116	18
Fórmula seleccionada en el cálculo de K'CM	3	3	3
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0.16%	0.18%	0.28%
K'CM = c1*DF'CM, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	151.03	294.34	15.70
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5172	0.4918	0.8436
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.5716	1.5365	2.4060
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.228%	0.253%	0.409%
KCMi si DFi = 1.000	2.28	2.53	4.09