

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

## 30 de Diciembre de 2020

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	21	25	5
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3.081	4.468	211
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	121.350	175.410	8.310
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	109.793	161.377	4.986
DF' = DFCCP + DF'CM	112.874	165.845	5.197
Σ(EBRMi-IMi-DFi), Exposición total ECC	52	20.906	1.421
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	1	335	23
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%	0,25%	0,31%
K*CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	175,67	401,21	15,64
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,5805	0,6072	0,5663
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,6416	1,6600	1,9438
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,238%	0,380%	0,366%
KCMi si DFi = 1.000	2,38	3,80	3,66