

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

29 de Enero de 2021

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	21	24	6
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3,811	3,817	175
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	187,070	187,330	9,140
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	169,254	171,719	6,093
DF = DFCCP + DF'CM	173,065	175,536	6,268
Σ (EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	51	24,928	5,088
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	1	399	81
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%	0.26%	0.43%
K'CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	270.81	442.46	26.49
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.7392	0.6023	0.8664
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.8170	1.6571	2.2996
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.263%	0.391%	0.666%
KCMi si DFi = 1.000	2.63	3.91	6.66