

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

31 de Marzo de 2021

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Renta Variable	Swaps
	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
Unidad				
N, Número de miembros compensadores	21	24	13	7
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3,420	4,181	269	171
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	149,440	182,690	11,770	8,620
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	135,208	167,466	9,959	6,157
DF = DFCCP + DF'CM	138,628	171,647	10,229	6,328
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	14,931	0	6,304
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	239	0	101
Fórmula seleccionada en el cálculo de K'CM	3	3	3	3
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0.16%	0.22%	0.16%	0.46%
K'CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	216.33	372.49	15.93	28.46
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.7869	0.5580	0.5750	0.8999
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1.8698	1.6087	1.6796	2.2598
C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.271%	0.328%	0.227%	0.746%
KCMI si DFi = 1.000	2.71	3.28	2.27	7.46