

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

30 de Julio de 2021

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Renta Fija	Renta Variable	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	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)	2,704	4,838	278	222
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	114,530	204,880	11,780	10,540
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	104,118	187,807	9,968	7,529
DF = DFCCP + DF'CM	106,823	192,644	10,246	7,751
Σ(EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	5,700	0	5,617
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	91	0	90
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%	0.16%	0.16%	0.42%
K'CM = c1*DF'CM, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	166.59	302.27	15.95	31.63
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.5915	0.5638	0.5317	0.8073
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	1.6507	1.6151	1.6283	2.1302
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.240%	0.238%	0.220%	0.639%
KCMi si DFi = 1.000	2.40	2.38	2.20	6.39