

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

31 de Agosto 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	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)	2,548	4,905	324	266
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	92,770	178,560	11,780	10,820
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	84,336	163,680	9,968	7,729
DF = DFCCP + DF'CM	86,885	168,585	10,291	7,994
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	0	0	4,576
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	73
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%	0.39%
K'CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	134.94	261.89	15.95	30.25
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.8397	0.5568	0.5345	0.7880
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	1.9237	1.6075	1.6316	2.1031
C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.280%	0.236%	0.221%	0.588%
KCMI si DFi = 1.000	2.80	2.36	2.21	5.88