

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

30 de octubre 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)	2,410	4,941	307	384
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	92,710	190,060	11,790	14,780
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	84,282	174,222	9,976	10,557
DF = DFCCP + DF'CM	86,692	179,163	10,283	10,941
Y (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	7,168	0	673
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	115	0	11
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%	0.18%	0.16%	0.20%
K'CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	134.85	306.98	15.96	21.16
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.6055	0.4502	0.5341	0.8829
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	1.6660	1.4911	1.6313	2.2361
C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.242%	0.241%	0.221%	0.320%
KCMi si DFi = 1.000	2.42	2.41	2.21	3.20