

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

30 de noviembre 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)	2,471	4,700	314	557
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	92,730	176,350	11,780	20,900
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	84,300	161,654	9,968	14,929
DF = DFCCP + DF'CM	86,771	166,354	10,282	15,486
$\Sigma$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	7,000	0	0
<b>KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>0</b>	<b>112</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K'CM</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0.16%	0.18%	0.16%	0.16%
<b>K'CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>134.88</b>	<b>289.18</b>	<b>15.95</b>	<b>23.89</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.7126	0.4589	0.5499	0.9032
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	1.7839	1.5006	1.6499	2.2645
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K'CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0.259%</b>	<b>0.246%</b>	<b>0.223%</b>	<b>0.259%</b>
KCMI si DFi = 1.000	2.59	2.46	2.23	2.59