

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

30 de diciembre de 2019

<b>Resumen de estadísticas clave</b>	<b>Derivados Financieros</b>	<b>Renta Fija</b>	<b>Swaps</b>
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	25	4
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3.325	3.794	67
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	80.570	91.950	2.160
DF <sup>CM</sup> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	73.245	84.594	1.080
DF <sup>F</sup> = DFCCP + DF <sup>CM</sup>	76.570	88.388	1.147
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	128	86.687	0
<b>KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>2</b>	<b>1.387</b>	<b>0</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K<sup>CM</sup></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%	0,46%	0,16%
<b>K<sup>CM</sup> = c1*DF<sup>CM</sup>, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>117,19</b>	<b>389,19</b>	<b>1,73</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,5386	0,4957	1,0000
Método de asignación del C-factor	DFI/DFCM	DFI/DFCM	DFI/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,5925	1,5388	3,0000
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K<sup>CM</sup> / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0,232%</b>	<b>0,651%</b>	<b>0,240%</b>
KCMI si DFI = 1.000	2,32	6,51	2,40