

Enero 31, 2024

ComDer Contraparte Central provee del C-Factor calculado en base a la metodología de cálculo de exposición de derivados aplicando el "Current Exposure Methodology (CEM)", BCBS 227, para aquellas jurisdicciones que cuantifican las exposiciones de esta manera.

| Resumen de estadísticas clave | FX | IRS |
|---|---------------|---------------|
| Unidad | MM CLP | MM CLP |
| N, Número de miembros compensadores | 12 | 12 |
| DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes) | 122 | 37 |
| DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores | 299,579 | 9,173 |
| DF' = DFCCP + DF'CM | 249,771 | 7,576 |
| KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC | 0 | 0 |
| Fórmula seleccionada en el cálculo de K*CM | 3 | 3 |
| K*CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar | 418 | 34 |
| Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación | 0.56 | 0.63 |
| C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador | 0.223% | 0.235% |

Metodología:

<http://www.bis.org/publ/bcbs227.htm>

Para el cálculo denominado SA-CCR hemos utilizado la metodología definida el Framework de Basilea sección CRE52 (disponible https://www.bis.org/basel_framework/index.htm?m=2697). Para aquellos participantes en donde la implementación del SA-CCR está finalizada favor referirse a la siguiente sección.

| Resumen de estadísticas clave | FX | IRS |
|---|--------------|--------------|
| Unidad | MM CLP | MM CLP |
| N, Número de miembros compensadores (CM) | 12 | 12 |
| DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente | 122 | 37 |
| DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores | 299,579 | 9,173 |
| KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC | 55 | 5 |
| C-factor = max(KCCP * (DFi / (DFCCP + DF CM)); 8% * 2% * DFi) | 0.16% | 0.16% |

Metodología:

https://www.bis.org/basel_framework/chapter/CRE/52.htm y

https://www.bis.org/basel_framework/chapter/CRE/54.htm