March 31, 2026

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	11	11
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	135	31
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	431.968	13.158
DF' = DFCCP + DF'CM	353.564	10.597
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	600	35
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,54	0,56
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	**0,217%**	**0,221%**

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)	11	11
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente	135	31
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	431.968	13.158
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	44	1
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