

Compendio de Normas que regulan a las Cajas de Compensación de Asignación Familiar

/ 6 LIBRO VI. GESTIÓN DE RIESGOS / 6.2 TÍTULO II. RIESGO DE MERCADO / 6.2.7 REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE MERCADO

6.2.7 REQUERIMIENTO DE CAPITAL POR RIESGO DE MERCADO

La exposición al riesgo del Libro de Negociación generará un requerimiento de capital igual a:

$$\beta \cdot ERT_{\text{ln}}$$

(Ecuación 7)

ERT_{ln} : exposición al riesgo de tasa del libro de negociación.

Con $\beta=12\%$.

El libro de caja genera un requerimiento de capital con un $\beta=0\%$.

Estos requerimientos de capital deben agregarse a los requerimientos de riesgos de crédito que se consideren en las normativas respectivas.
