

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

30 de Abril de 2021

| Resumen de estadísticas clave   | Derivados Financieros | Renta Fija    | Renta Variable | Swaps         |
|---|-----------------------|---------------|----------------|---------------|
| Unidad  | COP Mill              | COP Mill      | COP Mill       | COP Mill      |
| N, Número de miembros compensadores   | 21                    | 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) | 2,973                 | 4,666         | 248            | 155           |
| DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores   | 141,140               | 221,480       | 11,770         | 8,510         |
| DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes   | 127,698               | 203,023       | 9,959          | 6,079         |
| DF = DFCCP + DF'CM  | 130,671               | 207,689       | 10,207         | 6,234         |
| $\sum$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC  | 0                     | 13,672        | 0              | 6,962         |
| <b>KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>   | <b>0</b>              | <b>219</b>    | <b>0</b>       | <b>111</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%                 | 0.20%         | 0.16%          | 0.48%         |
| <b>K'CM = c1*DF'CM, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>   | <b>204.32</b>         | <b>415.36</b> | <b>15.93</b>   | <b>29.08</b>  |
| Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación  | 0.5985                | 0.4628        | 0.5396         | 0.8535        |
| 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  | 1.6615                | 1.5049        | 1.6377         | 2.1949        |
| <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>0.241%</b>         | <b>0.282%</b> | <b>0.222%</b>  | <b>0.750%</b> |
| KCMi si DFi = 1.000   | 2.41                  | 2.82          | 2.22           | 7.50          |