

Capital requirements for default fund exposures to CRCC CEM methodology

Key Summary Statistics	Derivados Financieros	Renta Fija	Renta Variable	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	24	13	7
DF <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.786	4.438	245	573
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	120.530	192.020	10.620	24.790
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	109.573	176.018	8.986	17.707
DF <sup>*</sup> = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	112.358	180.456	9.232	18.280
Σ (EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	309	14.278	0	0
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>5</b>	<b>228</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K<sup>*</sup><sub>CM</sub></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%	0,22%	0,16%	0,16%
<b>K<sup>*</sup><sub>CM</sub> = c<sub>1</sub>*DF<sup>*</sup><sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>175,32</b>	<b>380,54</b>	<b>14,38</b>	<b>28,33</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,7846	0,3520	0,5571	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>			
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,8630	1,3840	1,6583	2,4000
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K<sup>*</sup><sub>CM</sub> / DF<sub>CM</sub>, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0,271%</b>	<b>0,274%</b>	<b>0,225%</b>	<b>0,274%</b>
K <sub>CMi</sub> si DF <sub>i</sub> = 1.000	2,71	2,74	2,25	2,74

Capital requirements for default fund exposures to CRCC "Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)

Key Summary Statistics	Derivados Financieros	Renta Fija	Renta Variable	Swaps
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	22	24	13	7
DF <sub>CCP</sub> , CCP's recursos propios prefinanciados	2.786	4.438	245	573
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	120.530	192.020	10.620	24.790
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>7</b>	<b>637</b>	<b>355</b>	<b>0</b>
<b>C-factor = Max(K<sub>CCP</sub>*(DF<sub>i</sub> / (DF<sub>CCP</sub>+DF<sub>CM</sub>));8%*2%* DF i)</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,324%</b>	<b>3,267%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CMi</sub> si DF <sub>i</sub> = 1.000	1,60	3,24	32,67	1,60