

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	14	7
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2,781	4,420	233	609
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	120,810	192,030	10,120	26,460
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	109,827	176,028	8,674	18,900
DF = DFCCP + DFCM	112,608	180,447	8,907	19,509
$\bar{Y}$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	0	0	0
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0
Fórmula seleccionada en el cálculo de K*CM	3	3	3	3
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0.16%	0.16%	0.16%	0.16%
K*CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	175.72	281.64	13.88	30.24
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.7922	0.7967	0.5300	0.8265
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	1.8714	1.8691	1.6183	2.1571
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.272%	0.274%	0.222%	0.247%
KCMi si DFI = 1.000	2.72	2.74	2.22	2.47

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	14	7
DFCCP, CCP's recursos propios prefinanciados	2,781	4,420	233	609
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	120,810	192,030	10,120	26,460
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	165	83
C-factor = Max(KCCP*(DFI / (DFCCP+DFCM));8%*2%* DF I)	0.160%	0.160%	1.595%	0.306%
KCMi si DFI = 1.000	1.60	1.60	15.95	3.06