

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	24	24	13	8
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2,902	4,348	229	563
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	128,470	192,040	10,130	25,460
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	117,764	176,037	8,572	19,095
DF = DFCCP + DFCM	120,666	180,385	8,801	19,858
Y(EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	0	0	7,087
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	113
Formula 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%	0.34%
K*CM = c1*DF*CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	188.42	281.66	13.71	65.07
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.7472	0.7577	0.5477	0.8444
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	1.8151	1.8266	1.6473	2.1259
C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.266%	0.268%	0.223%	0.543%
KCMi si DFi = 1.000	2.66	2.68	2.23	5.43

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	24	24	13	8
DFCCP, CCP's recursos propios prefinanciados	2,902	4,348	229	563
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	128,470	192,040	10,130	25,460
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	410	311
C-factor = Max(KCCP*(DFi / (DFCCP+DFCM)); 8%*2%* DF i)	0.160%	0.160%	3.954%	1.194%
KCMi si DFi = 1.000	1.60	1.60	39.54	11.94