

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	25	13	8
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3,512	3,870	204	456
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	174,230	190,870	10,130	22,630
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	159,711	175,600	8,572	16,973
DF = DFCCP + DFCM	163,222	179,471	8,776	17,429
$\bar{Y}$ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	3,273	0	0
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	52	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	255.54	280.96	13.71	27.16
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0.8511	0.8346	0.4644	0.8617
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	1.9285	1.9071	1.5488	2.1489
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0.283%	0.281%	0.210%	0.258%
KCMi si DFI = 1.000	2.83	2.81	2.10	2.58

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	25	13	8
DFCCP, CCP's recursos propios prefinanciados	3,512	3,870	204	456
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	174,230	190,870	10,130	22,630
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	73	277	0
C-factor = Max(KCCP*(DFI / (DFCCP+DFCM)); 8%*2%* DF I)	0.160%	0.160%	2.684%	0.160%
KCMi si DFI = 1.000	1.60	1.60	26.84	1.60