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	23	26	13	8
DF_{CCP}, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3.901	4.018	227	486
DF_{CM}, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	186.490	192.060	10.860	23.210
DF'_{CM}, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	170.273	177.286	9.189	17.408
$DF' = DF_{CCP} + DF'_{CM}$	174.175	181.304	9.416	17.893
∑(EBRMi-IMi-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	0
K_{CCP}, 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%
$K^*_{CM} = c_1 * DF'_{CM}$, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	**272,44**	**283,66**	**14,70**	**27,85**
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,7140	0,5785	0,5426	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF_i/DF_{CM}	DF_i/DF_{CM}	DF_i/DF_{CM}	DF_i/DF_{CM}
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,7820	1,6267	1,6413	2,3333
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	**0,260%**	**0,240%**	**0,222%**	**0,280%**
K_{CMi} si DFi = 1.000	2,60	2,40	2,22	2,80

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	23	26	13	8
DF_{CCP}, CCP'S recursos propios prefinanciados	3.901	4.018	227	486
DF_{CM}, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	186.490	192.060	10.860	23.210
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	**0**	**0**	**0**	**0**
C-factor = Max(K_{CCP}*(DF_i / (DF_{CCP}+DF_{CM}));8%*2%* DF i)	**0,160%**	**0,160%**	**0,160%**	**0,160%**
K_{CMi} si DFi = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60