

Capital requirements for default fund exposures to CRCC CEM methodology

Key Summary Statistics	Derivatives	Fixed Income	Equity	Swaps	Fx Spot
Unidad	COP Mill				
N, Número de miembros compensadores	23	26	13	8	33
DFCCP, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	3.817	3.749	198	429	439
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	195.520	192.040	10.130	22.000	22.510
DF'CM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	178.518	177.268	8.572	16.500	21.146
DF ⁱ = DFCCP + DF'CM	182.335	181.016	8.769	16.929	21.585
Σ (EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	0	0
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0	0
Fórmula seleccionada en el cálculo de K*CM	3	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%	0,16%
K*CM = c1*DF'CM, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	285,63	283,63	13,71	26,40	33,83
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,7369	0,6919	0,5676	1,0000	1,0000
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,8070	1,7495	1,6709	2,3333	2,0645
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,264%	0,258%	0,226%	0,280%	0,310%
KCMi si DFi = 1.000	2,64	2,58	2,26	2,80	3,10

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

Key Summary Statistics	Derivatives	Fixed Income	Equity	Swaps	Fx Spot
Unidad	COP Mill				
N, Número de miembros compensadores	23	26	13	8	33
DFCCP, CCP's recursos propios prefinanciados	3.817	3.749	198	429	439
DFCM, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	195.520	192.040	10.130	22.000	22.510
KCCP, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0	0
C-factor = Max(KCCP*(DFi / (DFCCP+DFCM));8%*2%* DF i)	0,160%	0,160%	0,160%	0,160%	0,160%
KCMi si DFi = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60	1,60