

Capital requirements for default fund exposures to CRCC CEM methodology

Key Summary Statistics	Derivatives	Fixed Income	Equity	Swaps	Fx Spot
	COP Mill				
Unidad					
N, Número de miembros compensadores	23	26	13	8	33
DF <sub>CCP</sub> , 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
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	195.520	192.040	10.130	22.000	22.510
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	178.518	177.268	8.572	16.500	21.146
DF* = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	182.335	181.016	8.769	16.929	21.585
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	6.593	0	0	0	0
K <sub>CCP</sub> , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	105	0	0	0	0
Fórmula seleccionada en el cálculo de K* <sub>CM</sub>	3	3	3	3	3
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0,17%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%
K* <sub>CM</sub> = c1*DF* <sub>CM</sub> , <b>Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>305,14</b>	<b>283,63</b>	<b>13,71</b>	<b>26,40</b>	<b>33,83</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,8168	0,7057	0,5906	1,0000	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF/DF <sub>CM</sub>				
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,8946	1,7645	1,6980	2,3333	2,0645
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K*<sub>CM</sub> / DF<sub>CM</sub>, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0,296%</b>	<b>0,261%</b>	<b>0,230%</b>	<b>0,280%</b>	<b>0,310%</b>
K <sub>CM</sub> si DFI = 1.000	2,96	2,61	2,30	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
	COP Mill				
Unidad					
N, Número de miembros compensadores	23	26	13	8	33
DF <sub>CCP</sub> , CCP'S recursos propios prefinanciados	3.817	3.749	198	429	439
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	195.520	192.040	10.130	22.000	22.510
K <sub>CCP</sub> , <b>Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>157</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>C-factor = Max(K<sub>CCP</sub>*(DF<sub>T</sub> / (DF<sub>CCP</sub>+DF<sub>CM</sub>)));8%*2%* DF i)</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CM</sub> si DFI = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60	1,60