

Capital requirements for default fund exposures to CRCC CEM methodology

Key Summary Statistics	Derivatives	Fixed Income	Equity	Swaps	Fx Spot
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	23	26	13	8	33
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4.560	2.358	615	577	522
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	193.630	100.110	26.130	24.520	22.150
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	176.793	92.409	22.320	18.390	20.808
DF = DF _{CCP} + DF _{CM}	181.353	94.767	22.935	18.967	21.329
Σ (EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	0	0	0	0
K _{CCP} , 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	282,87	147,85	35,71	29,42	33,29
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,5674	0,6206	1,0000	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF/DF _{CM}	DF/DF _{CM}	DF/DF _{CM}	DF/DF _{CM}	DF/DF _{CM}
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	2,0952	1,6147	1,7335	2,3333	2,0645
C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K*_{CM} / DF_{CM}, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,306%	0,238%	0,235%	0,280%	0,310%
K _{CM} si DFI = 1.000	3,06	2,38	2,35	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	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	23	26	13	8	33
DF _{CCP} , CCP'S recursos propios prefinanciados	4.560	2.358	615	577	522
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	193.630	100.110	26.130	24.520	22.150
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0	0
C-factor = Max(K_{CCP}*(DF_T / (DF_{CCP}+DF_{CM})));8%*2%* DF i)	0,160%	0,160%	0,160%	0,160%	0,160%
K _{CM} si DFI = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60	1,60