

Capital requirements for default fund exposures to CRCC CEM methodology

| Key Summary Statistics | Derivatives | Fixed Income | Equity | Swaps | Fx Spot |
|--|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| | COP Mill | COP Mill | COP Mill | COP Mill | COP Mill |
| Unidad | | | | | |
| N, Número de miembros compensadores | 24 | 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) | 5.053 | 2.738 | 711 | 668 | 594 |
| DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores | 185.530 | 100.530 | 26.120 | 24.510 | 21.810 |
| DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes | 170.069 | 92.797 | 22.311 | 18.383 | 20.488 |
| DF* = DF _{CCP} + DF _{CM} | 175.122 | 95.535 | 23.023 | 19.050 | 21.082 |
| 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 | 272,11 | 148,48 | 35,70 | 29,41 | 32,78 |
| Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación | 1,0000 | 0,5588 | 0,5503 | 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 | 2,0909 | 1,6054 | 1,6504 | 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 | 0,307% | 0,237% | 0,223% | 0,280% | 0,310% |
| K _{CM} si DFI = 1.000 | 3,07 | 2,37 | 2,23 | 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 | COP Mill | COP Mill | COP Mill | COP Mill |
| Unidad | | | | | |
| N, Número de miembros compensadores | 24 | 26 | 13 | 8 | 33 |
| DF _{CCP} , CCP'S recursos propios prefinanciados | 5.053 | 2.738 | 711 | 668 | 594 |
| DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores | 185.530 | 100.530 | 26.120 | 24.510 | 21.810 |
| 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 |