

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	24	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)	4.784	3.080	681	640	579
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	183.360	118.080	26.120	24.520	22.190
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	168.080	108.997	22.311	18.390	20.845
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	172.864	112.077	22.993	19.030	21.424
Σ(EBRMi-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	0	0
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Fórmula seleccionada en el cálculo de K*<sub>CM</sub></b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>	<b>3</b>
c1, Factor de capital decreciente que se aplica al excedente de garantía colectiva	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%	0,16%
<b>K*<sub>CM</sub> = c1*DF<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>268,93</b>	<b>174,40</b>	<b>35,70</b>	<b>29,42</b>	<b>33,35</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,4879	0,6202	1,0000	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>	DF <sub>i</sub> /DF <sub>CM</sub>
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	2,0909	1,5286	1,7330	2,3333	2,0645
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*<sub>CM</sub> / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0,307%</b>	<b>0,226%</b>	<b>0,235%</b>	<b>0,280%</b>	<b>0,310%</b>
K <sub>CM</sub> , si DFi = 1.000	3,07	2,26	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	24	26	13	8	33
DF <sub>CCP</sub> , CCP'S recursos propios prefinanciados	4.784	3.080	681	640	579
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	183.360	118.080	26.120	24.520	22.190
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>C-factor = Max(K<sub>CCP</sub>*(DF<sub>i</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