

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)	5.073	2.930	638	599	524
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	207.520	119.840	26.110	24.510	21.420
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	190.227	110.622	22.303	18.383	20.122
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	195.300	113.551	22.941	18.982	20.645
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>304,36</b>	<b>176,99</b>	<b>35,68</b>	<b>29,41</b>	<b>32,19</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,4532	0,5705	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	1,4910	1,6743	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>0,220%</b>	<b>0,227%</b>	<b>0,280%</b>	<b>0,310%</b>
K <sub>CM</sub> , si DFi = 1.000	3,07	2,20	2,27	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	5.073	2.930	638	599	524
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	207.520	119.840	26.110	24.510	21.420
<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