

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 _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4.991	2.964	656	615	538
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	198.810	118.060	26.110	24.510	21.410
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	182.243	108.978	22.303	18.383	20.112
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	187.234	111.943	22.959	18.998	20.650
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	291,59	174,37	35,68	29,41	32,18
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,3910	0,5860	1,0000	1,0000
Método de asignación del C-factor	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	2,0909	1,4235	1,6926	2,3333	2,0645
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,307%	0,210%	0,229%	0,280%	0,310%
K _{CM} si DFi = 1.000	3,07	2,10	2,29	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 _{CCP} , CCP'S recursos propios prefinanciados	4.991	2.964	656	615	538
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	198.810	118.060	26.110	24.510	21.410
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0	0
C-factor = Max(K_{CCP}*(DF_i / (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