

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 <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4,973	3,118	615	578	479
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	211,060	132,330	26,120	24,530	20,350
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	193,472	122,151	22,311	18,398	19,117
DF* = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	198,445	125,269	22,927	18,975	19,596
Σ (EBR <sub>Mi</sub> -IMI-DF <sub>i</sub> ), Exposición total ECC	0	0	0	0	0
K <sub>CCP</sub> , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0	0
Fórmula seleccionada en el cálculo de K* <sub>CM</sub>	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* <sub>CM</sub> = c1*DF* <sub>CM</sub> , <b>Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>309.55</b>	<b>195.44</b>	<b>35.70</b>	<b>29.44</b>	<b>30.59</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1.0000	0.4369	0.4909	1.0000	1.0000
Método de asignación del C-factor	DF/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	1.4733	1.5802	2.3333	2.0645
<b>C-factor = (1+Beta*N/(N-2)) * K*<sub>CM</sub> / DF<sub>CM</sub>, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador</b>	<b>0.307%</b>	<b>0.218%</b>	<b>0.214%</b>	<b>0.280%</b>	<b>0.310%</b>
K <sub>CM</sub> si DFI = 1.000	3.07	2.18	2.14	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 <sub>CCP</sub> , CCP'S recursos propios prefinanciados	4,973	3,118	615	578	479
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	211,060	132,330	26,120	24,530	20,350
K <sub>CCP</sub> , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	0	0
<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