

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)	4,833	3,127	673	632	499
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	187,550	121,360	26,110	24,510	19,370
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	171,921	112,025	22,303	18,383	18,196
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	176,754	115,152	22,976	19,014	18,695
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>275.07</b>	<b>179.24</b>	<b>35.68</b>	<b>29.41</b>	<b>29.11</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1.0000	0.4282	0.5116	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	1.4639	1.6046	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>0.216%</b>	<b>0.217%</b>	<b>0.280%</b>	<b>0.310%</b>
K <sub>CM</sub> , si DFi = 1.000	3.07	2.16	2.17	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	4,833	3,127	673	632	499
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	187,550	121,360	26,110	24,510	19,370
<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