

Capital requirements for default fund exposures to CRCC CEM methodology

Key Summary Statistics	Derivados Financieros	Renta Fija	Renta Variable	Swaps	Divisas
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	24	26	13	9	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)	4,855	3,152	664	624	468
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	190,900	123,950	26,120	24,520	18,420
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	174,992	114,415	22,311	19,071	17,304
DF <sup>*</sup> = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	179,847	117,568	22,976	19,695	17,772
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>279.99</b>	<b>183.06</b>	<b>35.70</b>	<b>30.51</b>	<b>27.69</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1.0000	0.4024	0.5553	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	1.4359	1.6562	2.2857	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>0.212%</b>	<b>0.224%</b>	<b>0.284%</b>	<b>0.310%</b>
K <sub>CM</sub> , si DFi = 1.000	3.07	2.12	2.24	2.84	3.10

Capital requirements for default fund exposures to CRCC "Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)

Key Summary Statistics	Derivados Financieros	Renta Fija	Renta Variable	Swaps	Divisas
Unidad	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill	COP Mill
N, Número de miembros compensadores	24	26	13	9	33
DF <sub>CCP</sub> , CCP's recursos propios prefinanciados	4,855	3,152	664	624	468
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	190,900	123,950	26,120	24,520	18,420
<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