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_{CCP}, Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4.583	3.364	667	626	523
DF_{CM}, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	179.470	131.740	26.120	24.520	20.480
DF'_{CM}, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	164.514	121.606	22.311	19.071	19.239
$DF' = DF_{CCP} + DF'_{CM}$	169.097	124.971	22.978	19.697	19.762
∑(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%
$K^*_{CM} = c_1 * DF'_{CM}$, , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	**263,22**	**194,57**	**35,70**	**30,51**	**30,78**
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,3137	0,5368	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	1,3399	1,6344	2,2857	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%**	**0,198%**	**0,221%**	**0,284%**	**0,310%**
K_{CMi} si DFi = 1.000	3,07	1,98	2,21	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_{CCP}, CCP's recursos propios prefinanciados	4.583	3.364	667	626	523
DF_{CM}, Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	179.470	131.740	26.120	24.520	20.480
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)	**0,16%**	**0,16%**	**0,16%**	**0,16%**	**0,16%**
K_{CMi} si DFi = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60	1,60