

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)	4.532	3.706	567	532	426
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	208.820	170.760	26.120	24.530	19.650
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	191.418	157.625	22.311	19.079	18.459
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	195.950	161.331	22.878	19.611	18.886
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	306,27	252,20	35,70	30,53	29,53
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,3318	0,5748	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	1,3595	1,6793	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%	0,201%	0,227%	0,284%	0,310%
K _{CM} , si DFi = 1.000	3,07	2,01	2,27	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	4.532	3.706	567	532	426
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	208.820	170.760	26.120	24.530	19.650
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 _{CM} , si DFi = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60	1,60