

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	25	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)	4.691	3.479	589	560	445
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	208.050	154.280	26.120	24.840	19.730
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	191.406	142.412	22.311	19.320	18.534
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	196.097	145.891	22.900	19.880	18.979
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	306,25	227,86	35,70	30,91	29,65
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,3414	0,5980	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	2,0870	1,3698	1,7068	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%	0,202%	0,231%	0,284%	0,310%
K _{CM} , si DFi = 1.000	3,07	2,02	2,31	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	25	26	13	9	33
DF _{CCP} , CCP's recursos propios prefinanciados	4.691	3.479	589	560	445
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	208.050	154.280	26.120	24.840	19.730
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