

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	14	13	33
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4.536	4.375	612	622	525
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	207.260	199.880	27.940	28.400	24.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	189.988	184.505	24.146	24.031	22.545
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	194.525	188.880	24.758	24.652	23.071
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	303,98	295,21	38,63	38,45	36,07
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,3993	0,5947	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	1,4325	1,6938	2,1818	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%	0,212%	0,232%	0,295%	0,310%
K _{CM} , si DFi = 1.000	3,07	2,12	2,32	2,95	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	14	13	33
DF _{CCP} , CCP's recursos propios prefinanciados	4.536	4.375	612	622	525
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	207.260	199.880	27.940	28.400	24.000
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