

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 <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	4.456	4.647	563	558	446
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	221.080	230.530	27.940	27.660	22.130
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	202.657	212.797	24.146	23.405	20.789
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	207.113	217.444	24.710	23.962	21.235
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>324,25</b>	<b>340,48</b>	<b>38,63</b>	<b>37,45</b>	<b>33,26</b>
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 <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	1,4325	1,6938	2,1818	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>0,232%</b>	<b>0,295%</b>	<b>0,310%</b>
K <sub>CM</sub> , 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 <sub>CCP</sub> , CCP's recursos propios prefinanciados	4.456	4.647	563	558	446
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	221.080	230.530	27.940	27.660	22.130
<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>0,16%</b>	<b>0,16%</b>	<b>0,16%</b>	<b>0,16%</b>	<b>0,16%</b>
K <sub>CM</sub> , si DFI = 1.000	1,60	1,60	1,60	1,60	1,60