

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)	4.633	4.488	579	546	423
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	223.420	216.450	27.940	26.350	20.400
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	204.802	199.800	24.146	22.296	19.164
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	209.434	204.288	24.726	22.843	19.587
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	327,68	319,68	38,63	35,67	30,66
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,4066	0,5869	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	1,4405	1,6847	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%	0,213%	0,231%	0,295%	0,310%
K _{CM} , si DFi = 1.000	3,07	2,13	2,31	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	4.633	4.488	579	546	423
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	223.420	216.450	27.940	26.350	20.400
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