

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)	4.719	4.171	665	620	495
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	198.320	175.290	27.940	26.040	20.780
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	181.793	161.806	24.146	22.034	19.521
DF' = DF _{CCP} + DF _{CM}	186.513	165.978	24.811	22.654	20.015
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	290,87	258,89	38,63	35,25	31,23
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	1,0000	0,4023	0,6502	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	1,4358	1,7585	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%	0,241%	0,295%	0,310%
K _{CM} , si DFi = 1.000	3,07	2,12	2,41	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	4.719	4.171	665	620	495
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros liquidadores	198.320	175.290	27.940	26.040	20.780
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