

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva

31 de diciembre de 2019

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	38	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	346.900	26.200	31.900	5.100	138.900
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	328.642	17.467	29.348	3.967	127.325
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	331.142	17.967	30.348	4.467	128.325
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	1.014	0	24.331	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	16	0	389	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%	0,20%	0,16%	0,77%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	526	34	47	31	204
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,3111	0,7354	0,4410	0,5155	0,4311
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,3284	2,1031	1,4794	1,6627	1,4703
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,201%	0,274%	0,218%	0,995%	0,216%
K _{CMi} si DFi = 1.000	2,01	2,74	2,18	9,95	2,16

29 de noviembre de 2019

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	38	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	347.150	28.250	45.650	5.100	138.800
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	328.879	18.833	41.998	3.967	127.233
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	331.379	19.333	42.998	4.467	128.233
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	4.938	0	17.375	14.319	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	79	0	278	229	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%	0,35%	0,66%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	526	30	148	26	204
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2659	0,9306	0,2265	0,6182	0,4819
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,2806	2,3960	1,2462	1,7949	1,5257
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,194%	0,256%	0,404%	0,916%	0,224%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,94	2,56	4,04	9,16	2,24

31 de octubre de 2019

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	38	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	391.450	29.200	52.150	5.100	138.900
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	370.847	19.467	47.978	3.967	127.325
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	373.347	19.967	48.978	4.467	128.325
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	7.125	0	0	14.412	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	114	0	0	231	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%	0,66%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	593	31	77	26	204
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,3241	0,8083	0,2918	0,6158	0,5099
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,3421	2,2125	1,3172	1,7917	1,5562
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,203%	0,236%	0,194%	0,916%	0,228%
K _{CMi} si DFi = 1.000	2,03	2,36	1,94	9,16	2,28

30 de septiembre de 2019

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	37	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	391.150	29.250	51.950	5.100	126.100
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	370.007	19.500	47.794	3.967	115.592
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	372.507	20.000	48.794	4.467	116.592
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	9.250	0	0	14.125	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	148	0	0	226	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%	0,65%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	592	31	76	26	185
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,3111	0,8930	0,3835	0,6087	0,5077
Método de asignación del C-factor	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM	DFi/DFCM
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,3289	2,3396	1,4169	1,7826	1,5538
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,201%	0,250%	0,209%	0,906%	0,228%
K _{CMi} si DFi = 1.000	2,01	2,50	2,09	9,06	2,28