



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

29 de febrero de 2020

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	36	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	370.200	38.150	32.050	5.150	119.600
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	349.633	25.433	29.486	4.006	109.633
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	352.133	25.933	30.486	4.506	110.633
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	4.440	0	0	28.829	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	71	0	0	461	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%	0,81%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	559	41	47	32	175
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2509	0,9421	0,3413	0,4899	0,4205
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	1,2656	2,4132	1,3710	1,6299	1,4588
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,191%	0,257%	0,202%	1,024%	0,214%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,91	2,57	2,02	10,24	2,14

31 de enero de 2020

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	370.500	38.250	32.050	5.100	119.600
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	350.473	25.500	29.486	3.967	109.633
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	352.973	26.000	30.486	4.467	110.633
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	28.122	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	450	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%	0,80%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	561	41	47	32	175
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2716	0,9466	0,3180	0,4910	0,4205
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	1,2871	2,4199	1,3456	1,6312	1,4588
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,195%	0,258%	0,198%	1,020%	0,214%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,95	2,58	1,98	10,20	2,14

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