



**Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología CEM**

**30 de abril de 2021**

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	32	6	25	9	21
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)	2.000	500	1.000	500	1.500
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	160.200	27.600	70.950	5.100	198.100
DF' <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	150.188	18.400	65.274	3.967	179.233
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF' <sub>CM</sub>	152.188	18.900	66.274	4.467	180.733
∑(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	20.617	0
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>330</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%	0,73%	0,16%
<b>K*<sub>CM</sub> = c1*DF'<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>240</b>	<b>29</b>	<b>104</b>	<b>29</b>	<b>287</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2659	0,6546	0,3635	0,5309	0,5504
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	1,2836	1,9818	1,3951	1,6826	1,6083
<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>0,193%</b>	<b>0,211%</b>	<b>0,205%</b>	<b>0,958%</b>	<b>0,233%</b>
K <sub>CM</sub> si DFi = 1.000	1,93	2,11	2,05	9,58	2,33

**Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología "Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)"**

**30 de abril de 2021**

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	32	6	25	9	21
DF <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente	2.000	500	1.000	500	1.500
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	160.200	27.600	70.950	5.100	198.100
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>3.050</b>	<b>988</b>	<b>0</b>	<b>7</b>	<b>0</b>
<b>C-factor = max( K<sub>CCP</sub> * ( DFi / (DF<sub>CCP</sub> + DF<sub>CM</sub> )); 8% * 2% * DFi)</b>	<b>1,881%</b>	<b>3,515%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CM</sub> si DFi = 1.000	18,81	35,15	1,60	1,60	1,60