



**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**

31 de agosto 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	33	6	24	8	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	158.600	54.250	62.950	5.250	199.750
DF' <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	148.988	36.167	57.704	3.938	180.726
DF' = DF <sub>CCP</sub> + DF' <sub>CM</sub>	150.988	36.667	58.704	4.438	182.226
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	1.439	0	0	14.867	0
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>23</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>238</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%	0,67%	0,16%
<b>K*<sub>CM</sub> = c1*DF'<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>238</b>	<b>58</b>	<b>92</b>	<b>26</b>	<b>289</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2187	0,6341	0,4630	0,5492	0,4901
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	1,2328	1,9512	1,5050	1,7322	1,5417
<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>0,185%</b>	<b>0,208%</b>	<b>0,221%</b>	<b>0,864%</b>	<b>0,223%</b>
K <sub>CM</sub> si DFi = 1.000	1,85	2,08	2,21	8,64	2,23

**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)"**

31 de agosto 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	33	6	24	8	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	158.600	54.250	62.950	5.250	199.750
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>3.722</b>	<b>1.302</b>	<b>0</b>	<b>8</b>	<b>0</b>
<b>C-factor = max( K<sub>CCP</sub> * ( DF<sub>i</sub> / ( DF<sub>CCP</sub> + DF<sub>CM</sub> )); 8% * 2% * DF<sub>i</sub>)</b>	<b>2,318%</b>	<b>2,379%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CM</sub> si DFi = 1.000	23,18	23,79	1,60	1,60	1,60