

**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 diciembre 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	31	7	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	182.800	146.400	61.000	5.450	291.200
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	171.006	104.571	55.917	4.088	263.467
DF* = DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub>	173.006	105.071	56.917	4.588	264.967
Σ (EBRMi-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	15.229	0
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>244</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%	0,66%	0,16%
<b>K*<sub>CM</sub> = c1*DF<sub>CM</sub>, Requerimiento de capital agregado sin ajustar</b>	<b>274</b>	<b>167</b>	<b>89</b>	<b>27</b>	<b>422</b>
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2866	0,6746	0,4598	0,5385	0,4391
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	1,3064	1,9445	1,5016	1,7180	1,4853
<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>0,196%</b>	<b>0,222%</b>	<b>0,220%</b>	<b>0,855%</b>	<b>0,215%</b>
K <sub>CM</sub> si DFi = 1.000	1,96	2,22	2,20	8,55	2,15

**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 diciembre 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	31	7	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	182.800	146.400	61.000	5.450	291.200
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>2.785</b>	<b>870</b>	<b>0</b>	<b>9</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>1,507%</b>	<b>0,592%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CM</sub> si DFi = 1.000	15,07	5,92	1,60	1,60	1,60