



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

29 de enero 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	35	6	25	9	23
DF _{CCP} , 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 _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	185.300	26.550	69.950	5.100	198.400
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	174.711	17.700	64.354	3.967	181.148
DF ⁱ = DF _{CCP} + DF _{CM}	176.711	18.200	65.354	4.467	182.648
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	15.025	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	240	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%	0,67%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	280	28	103	26	290
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2661	0,6585	0,4527	0,4985	0,5096
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	1,2822	1,9877	1,4921	1,6409	1,5581
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,193%	0,212%	0,220%	0,850%	0,228%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,93	2,12	2,20	8,50	2,28

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)"

29 de enero 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	35	6	25	9	23
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente	2.000	500	1.000	500	1.500
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	185.300	26.550	69.950	5.100	198.400
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	2.194	1.008	0	6	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	1,172%	3,726%	0,160%	0,160%	0,160%
K _{CM} si DFi = 1.000	11,72	37,26	1,60	1,60	1,60