



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)"

31/01/2022

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	750	1.000	500	1.500
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	176.000	212.250	61.350	5.450	286.650
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>2.966,1</b>	<b>728,4</b>	<b>0,0</b>	<b>6,6</b>	<b>0,0</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>1,666%</b>	<b>0,342%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CMi</sub> si DF <sub>i</sub> = 1.000	16,66	3,42	1,60	1,60	1,60