



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

26 de febrero 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	177.250	26.650	70.250	5.150	198.850
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	167.121	17.767	64.630	4.006	181.559
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	169.121	18.267	65.630	4.506	183.059
∑(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	13.213	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	211	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%	0,64%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF'_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	267	28	103	26	290
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2608	0,5946	0,4968	0,5006	0,5083
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	1,2766	1,8918	1,5400	1,6436	1,5567
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%	0,202%	0,227%	0,817%	0,227%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,93	2,02	2,27	8,17	2,27

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)"

26 de febrero 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	177.250	26.650	70.250	5.150	198.850
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	2.392	904	0	6	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DFi / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DFi)	1,33%	3,33%	0,16%	0,16%	0,16%
K _{CM} si DFi = 1.000	13,34	33,31	1,60	1,60	1,60