

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)"

28/02/2022

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 _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente	2.000	750	1.000	500	1.500
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	177.500	212.250	61.500	5.400	286.700
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	2.575,1	703,2	0,0	6,7	0,0
C-factor = max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	1,435%	0,330%	0,160%	0,160%	0,160%
K _{CMi} si DF _i = 1.000	14,35	3,30	1,60	1,60	1,60