



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

31 de julio 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	33	6	25	8	21
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	140.950	53.500	68.500	4.600	199.400
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	132.408	35.667	63.020	3.450	180.410
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	134.408	36.167	64.020	3.950	181.910
∑(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	1.608	0	0	15.561	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	26	0	0	249	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%	0,70%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF'_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	212	57	101	24	289
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2353	0,6222	0,3875	0,5531	0,5214
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	1,2505	1,9332	1,4212	1,7374	1,5763
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,188%	0,206%	0,209%	0,910%	0,228%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,88	2,06	2,09	9,10	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)"

31 de julio 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	33	6	25	8	21
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	140.950	53.500	68.500	4.600	199.400
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3.496	1.353	0	8	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	2,446%	2,505%	0,160%	0,160%	0,160%
K _{CM} si DFi = 1.000	24,46	25,05	1,60	1,60	1,60