



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

30 de junio 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	9	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	146.950	37.150	68.150	5.100	199.050
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	138.044	24.767	62.698	3.967	180.093
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	140.044	25.267	63.698	4.467	181.593
∑(EBRMI-IMI-DFI), Exposición total ECC	0	0	0	22.189	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	355	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%	0,75%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF'_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	221	40	100	30	288
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2304	0,6395	0,3392	0,5384	0,5246
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	1,2453	1,9593	1,3687	1,6922	1,5799
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,187%	0,209%	0,201%	0,985%	0,229%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,87	2,09	2,01	9,85	2,29

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)"

30 de junio 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	9	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	146.950	37.150	68.150	5.100	199.050
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3.714	1.189	0	11	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DFi / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DFi)	2,493%	3,157%	0,160%	0,196%	0,160%
K _{CM} si DFi = 1.000	24,93	31,57	1,60	1,96	1,60