



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 marzo 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	32	6	24	9	22
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	167.400	26.700	70.650	5.150	182.100
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	156.938	17.800	64.763	4.006	165.545
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	158.938	18.300	65.763	4.506	167.045
∑(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	14.353	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	230	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%	0,66%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF'_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	251	28	104	26	265
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2623	0,6367	0,5657	0,5267	0,5454
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	1,2798	1,9551	1,6171	1,6772	1,6000
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,192%	0,209%	0,237%	0,855%	0,233%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,92	2,09	2,37	8,55	2,33

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 marzo 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	32	6	24	9	22
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	167.400	26.700	70.650	5.150	182.100
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	2.935	861	0	7	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DFi / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DFi)	1,73%	3,17%	0,16%	0,16%	0,16%
K _{CM} si DFi = 1.000	17,32	31,66	1,60	1,60	1,60