

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)"

31/03/2022

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 <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente	2.000	750	1.000	500	1.500
DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	179.650	212.250	61.850	5.450	272.600
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	<b>2.621,6</b>	<b>546,9</b>	<b>0,0</b>	<b>6,0</b>	<b>0,0</b>
<b>C-factor = max( K<sub>CCP</sub> * ( DF<sub>i</sub> / (DF<sub>CCP</sub> + DF<sub>CM</sub> )); 8% * 2% * DF<sub>i</sub>)</b>	<b>1,443%</b>	<b>0,257%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CMi</sub> si DF <sub>i</sub> = 1.000	14,43	2,57	1,60	1,60	1,60