



Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva

29 de mayo de 2020

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	36	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	386.250	31.350	98.400	5.100	151.000
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	364.792	20.900	90.528	3.967	138.417
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	367.292	21.400	91.528	4.467	139.417
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	2.173	0	0	16.375	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	35	0	0	262	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%	0,68%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	584	33	145	27	221
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2874	0,9044	0,4490	0,5069	0,5066
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	1,3043	2,3566	1,4880	1,6517	1,5527
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,197%	0,251%	0,219%	0,878%	0,228%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,97	2,51	2,19	8,78	2,28

30 de abril de 2020

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	36	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	386.050	31.250	79.800	5.100	151.000
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	364.603	20.833	73.416	3.967	138.417
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	367.103	21.333	74.416	4.467	139.417
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	4.112	0	0	29.068	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	66	0	0	465	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%	0,81%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	583	33	117	32	221
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2817	0,9063	0,4678	0,5064	0,4735
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	1,2983	2,3594	1,5085	1,6511	1,5165
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,196%	0,252%	0,222%	1,042%	0,222%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,96	2,52	2,22	10,42	2,22

31 de marzo de 2020

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	36	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	385.950	38.200	63.650	5.100	144.250
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	364.508	25.467	58.558	3.967	132.229
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	367.008	25.967	59.558	4.467	133.229
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	1.854	0	0	26.376	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	30	0	0	422	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%	0,79%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	583	41	94	31	212
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2946	0,9256	0,4860	0,5027	0,4483
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	1,3119	2,3884	1,5282	1,6463	1,4891
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,198%	0,255%	0,225%	1,009%	0,218%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,98	2,55	2,25	10,09	2,18

29 de febrero de 2020

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	36	6	25	9	24
DF _{CCP} , Recursos propios de la ECC aportados previamente (antes de utilizar las aportaciones a la garantía colectiva de los miembros compensadores supervivientes)	2.500	500	1.000	500	1.000
DF _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	370.200	38.150	32.050	5.150	119.600
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	349.633	25.433	29.486	4.006	109.633
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	352.133	25.933	30.486	4.506	110.633
Σ(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	4.440	0	0	28.829	0
K _{CCP} , Requerimiento de capital hipotético a la ECC	71	0	0	461	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%	0,81%	0,16%
K* _{CM} = c ₁ *DF' _{CM} , Requerimiento de capital agregado sin ajustar	559	41	47	32	175
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2509	0,9421	0,3413	0,4899	0,4205
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	1,2656	2,4132	1,3710	1,6299	1,4588
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*CM / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,191%	0,257%	0,202%	1,024%	0,214%
K _{CMi} si DFi = 1.000	1,91	2,57	2,02	10,24	2,14