



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 mayo 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	153.550	36.650	67.800	5.100	198.650
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	144.244	24.433	62.376	3.967	179.731
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	146.244	24.933	63.376	4.467	181.231
∑(EBRMI-IMI-DFi), Exposición total ECC	0	0	0	17.562	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	281	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	231	39	100	28	288
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2523	0,6581	0,3906	0,5428	0,5447
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	1,2686	1,9871	1,4246	1,6979	1,6020
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%	0,212%	0,210%	0,921%	0,232%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,91	2,12	2,10	9,21	2,32

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 mayo 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	153.550	36.650	67.800	5.100	198.650
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3.307	1.034	0	6	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DFi / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DFi)	2,126%	2,784%	0,160%	0,160%	0,160%
K _{CM} si DFi = 1.000	21,26	35,15	1,60	1,60	1,60