

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 octubre 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	8	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	168.900	112.450	60.400	5.450	291.000
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	158.344	74.967	55.367	4.088	263.286
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	160.344	75.467	56.367	4.588	264.786
∑(EBR _{Mi} -IMI-DF _i), Exposición total ECC	0	0	0	19.457	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	0	0	0	311	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%	0,71%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF'_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	253	120	89	29	421
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2221	0,6256	0,3797	0,5360	0,5250
Método de asignación del C-factor	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}	DF _i /DF _{CM}
(1+Beta*N/(N-2)), Factor de ajuste para granularidad y concentración	1,2369	1,9384	1,4142	1,7147	1,5803
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DF_{CM}, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,186%	0,207%	0,207%	0,918%	0,229%
K _{CMi} si DF _i = 1.000	1,86	2,07	2,07	9,18	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)"

31 de octubre 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	8	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	168.900	112.450	60.400	5.450	291.000
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3.731	1.025	0	33	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	2,183%	0,907%	0,160%	0,563%	0,160%
K _{CMi} si DF _i = 1.000	21,83	9,07	1,60	5,63	1,60