



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

30 de septiembre 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	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	159.100	59.350	63.250	5.250	190.050
DF' _{CM} , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores supervivientes	149.458	39.567	57.979	3.938	171.950
DF' = DF _{CCP} + DF' _{CM}	151.458	40.067	58.979	4.438	173.450
Σ(EBRMi-IMI-DFi), Exposición total ECC	1.753	1.238	0	19.480	0
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	28	20	0	312	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%	0,72%	0,16%
K*_{CM} = c1*DF'_{CM}, Requerimiento de capital agregado sin ajustar	239	65	93	28	275
Beta (factor de concentración) en la fórmula de asignación	0,2172	0,6635	0,5282	0,5460	0,5227
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	1,2312	1,9952	1,5762	1,7279	1,5777
C-factor = (1+Beta*N/(N-2))* K*_{CM} / DFCM, Ponderación por riesgo utilizada para calcular el requerimiento de capital de cada miembro compensador	0,185%	0,217%	0,231%	0,935%	0,228%
K _{CM} si DFi = 1.000	1,85	2,17	2,31	9,35	2,28

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)"

30 de septiembre 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	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	159.100	59.350	63.250	5.250	190.050
K_{CCP}, Requerimiento de capital hipotético a la ECC	3.270	1.742	0	8	0
C-factor = max(K_{CCP} * (DFi / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DFi)	2,030%	2,911%	0,160%	0,160%	0,160%
K _{CM} si DFi = 1.000	20,30	29,11	1,60	1,60	1,60