

Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología /
Capital requirements for default fund exposures to BME CLEARING
“Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)”

30/05/2025

Resumen de estadísticas clave / Key Summary Statistics	Derivados Financieros / Financial Derivatives	Energía / Energy	Repo / Fixed Income	IRS	Renta Variable / Cash Equities
Unidad / Unit	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N: Número de miembros compensadores / Number of clearing members	29	7	24	8	23
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	3.800	350	350	50	1.200
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	2.300	200	250	50	700
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	6.100	550	600	100	1.900
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	723.500	62.450	64.950	5.150	220.250
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5.858	302	0	4	0
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	0,81%	0,47%	0,16%	0,16%	0,16%
KCMi if DF _i = 1.000	8,07	4,72	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	2.300,50	132,56	170,24	5,42	827,11

*IM : Garantías por posición y garantías individuales / Initial Margin and Individual Funds