

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)”

31/08/2023

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	30	7	25	8	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	1.700	500	450	50	1.700
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.100	350	300	50	1.100
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	2.800	850	750	100	2.800
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	248.550	74.050	64.800	5.150	252.700
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	3.362,79	312,11	0,00	5,97	0,00
C-factor = max(K _{CCP} * (DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	1,338%	0,417%	0,160%	0,160%	0,160%
KCMi if DFi = 1.000	13,38	4,17	1,60	1,60	1,60

Información adicional / Additional information

Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.427.059	379.452	331.394	9.913	561.400
---	-----------	---------	---------	-------	---------

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