

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)”

31/08/2024

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	2.400	300	350	50	2.050
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.450	200	200	50	1.250
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.850	500	550	100	3.300
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	480.450	67.700	59.900	5.150	438.350
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	4.860	637	0	4	0
C-factor = max(K _{CCP} * (DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	1,00%	0,93%	0,16%	0,16%	0,16%
KCMi if DF _i = 1.000	10,03	9,34	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.639.250	234.523	155.551	6.571	339.662

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