

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)”

30/06/2024

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	2.550	350	350	50	1.800
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.550	200	250	50	1.100
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	4.100	550	600	100	2.900
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	480.600	61.100	65.750	5.200	338.300
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5.211	351	0	4	0
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	1,08%	0,57%	0,16%	0,16%	0,16%
KCMi if DFi = 1.000	10,75	5,69	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.770.950	207.806	180.303	6.909	622.399

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