

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)"

29/11/2024

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	28	7	25	8	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	2,950	350	300	50	1,500
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1,800	250	200	50	900
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	4,750	600	500	100	2,400
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	590,300	68,350	52,100	5,100	296,950
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	6,550	361	0	6	0
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	1.10%	0.52%	0.16%	0.16%	0.16%
KCMI if DF _i = 1.000	11.01	5.24	1.60	1.60	1.60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	2,253,010	191,485	145,432	6,273	398,661

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