

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)”

31/10/2023

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	23
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	1.950	500	450	50	1.450
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.250	350	300	50	950
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.200	850	750	100	2.400
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	304.750	74.400	65.400	5.100	227.750
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	2.710,25	320,99	0,00	4,80	0,00
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	0,879%	0,427%	0,160%	0,160%	0,160%
KCMi if DFi = 1.000	8,79	4,27	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.398.560	379.945	382.144	8.722	366.699

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