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)"

29/12/2023

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	2.200	500	400	50	1.250
SSIG: Recursos propios especificos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.350	300	250	50	750
DF_{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.550	800	650	100	2.000
$DF_{CM:}$ Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	369.950	78.200	67.950	5.050	212.050
$K_{CCP:}$ **Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement**	4.513	309	0	4	0
C-factor = max(K_{CCP} ***(DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)**	**1,208%**	**0,391%**	**0,160%**	**0,160%**	**0,160%**
KCMi if DFi = 1.000	12,08	3,91	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.588.484	266.247	327.092	9.474	257.969

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

Sensitivity: C2 Internal