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)"

29/09/2023

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	1.700	500	450	50	1.700
SSIG: Recursos propios especificos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.100	350	300	50	1.100
DF_{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	2.800	850	750	100	2.800
DF_{CM}: Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	249.000	74.250	65.050	5.050	253.050
K_{CCP}: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	3.397,39	353,03	0,00	5,31	0,00
C-factor = max(K_{CCP} *(DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	**1,347%**	**0,470%**	**0,160%**	**0,160%**	**0,160%**
KCMi if DFi = 1.000	13,47	4,70	1,60	1,60	1,60

Información adicional / Additional information

Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.552.294	374.227	366.987	9.949	334.449

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

Sensitivity: C2 Internal