

**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)"**

28/03/2024

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	31	7	25	8	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	2.050	450	450	50	1.400
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.250	250	300	50	850
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.300	700	750	100	2.250
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	353.150	70.750	74.750	5.150	240.800
K_{CCP}: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5.094	274	0	4	0
C-factor = $\max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM}))); 8\% * 2\% * DF_i)$	1,43%	0,38%	0,16%	0,16%	0,16%
KCMi if DF _i = 1.000	14,29	3,83	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.614.117	199.776	207.493	7.940	490.268

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