

**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)"**

28/04/2023

Resumen de estadísticas clave / Key Summary Statistics	Derivados Financieros / Financial Derivatives	Energía / Energy	Repo / Fixed Income	IRS	Renta Variable / Equities
Unidad / Unit	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N: Número de miembros compensadores / Number of clearing members	31	7	24	8	21
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	1,550	800	450	50	1,550
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1,050	550	350	50	1,050
DF _{CCP} = SIG+SSIG, Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / SIG+SSIG, CCP's total prefunded own resources	1,950	1,450	700	100	2,800
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	248,950	130,150	74,350	5,050	248,100
K_{CCP}: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	2,673.8	356	0.0	5.7	0.0
C-factor = max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	1.063%	0.271%	0.160%	0.160%	0.160%
K _{CMi} si DF _i = 1.000 / K _{CMi} if DF _i = 1.000	10.63	2.71	1.60	1.60	1.60