

**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)"**

29/02/2024

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	30	7	25	8	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	2.250	450	500	50	1.300
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.350	300	300	50	800
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.600	750	800	100	2.100
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	370.100	74.400	74.700	5.150	211.950
K_{CCP}: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	3.900	246	0	5	0
C-factor = $\max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM}))); 8\% * 2\% * DF_i$	1,04%	0,33%	0,16%	0,16%	0,16%
KCMi if DF _i = 1.000	10,44	3,27	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.480.757	199.672	190.432	8.542	393.369

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