

**Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología  
"Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)"**

31/03/2023

Resumen de estadísticas clave	Derivados Financieros	Power	Repo	IRS	Renta Variable
Unidad	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N, Número de miembros compensadores	31	7	24	8	21
SIG, Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente	1.150	850	400	50	1.650
SSIG, Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente	800	600	300	50	1.150
DF <sub>CCP</sub> = SIG+SSIG, Recursos propios totales de la ECC aportados previamente	1.950	1.450	700	100	2.800
DF <sub>CMi</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores	209.050	152.850	74.050	5.050	309.700
<b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>	2.620,2	287	0,0	5,7	0,0
<b>C-factor = max( K<sub>CCP</sub> * ( DF<sub>i</sub> / ( DF<sub>CCP</sub> + DF<sub>CM</sub> )); 8% * 2% * DF<sub>i</sub>)</b>	<b>1,242%</b>	<b>0,186%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
K <sub>CMi</sub> si DF <sub>i</sub> = 1.000	12,42	1,86	1,60	1,60	1,60