

**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)"**

31/05/2024

| Resumen de estadísticas clave / Key Summary Statistics                                                                                                          | Derivados Financieros /<br>Financial Derivatives | Energía /<br>Energy | Repo / Fixed<br>Income | IRS          | Renta Variable<br>/ 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                                                               | 2.650                                            | 400                 | 450                    | 50           | 1.500                             |
| SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources                                       | 1.600                                            | 250                 | 250                    | 50           | 900                               |
| DF <sub>CCP</sub> = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources                                    | 4.250                                            | 650                 | 700                    | 100          | 2.400                             |
| DF <sub>CM</sub> : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members | 438.700                                          | 64.150              | 67.900                 | 5.050        | 241.450                           |
| <b>K<sub>CCP</sub>: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement</b>                                                     | 4.780                                            | 297                 | 0                      | 4            | 0                                 |
| C-factor = $\max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM}))); 8\% * 2\% * DF_i$                                                                                    | <b>1,08%</b>                                     | <b>0,46%</b>        | <b>0,16%</b>           | <b>0,16%</b> | <b>0,16%</b>                      |
| KCMi if DF <sub>i</sub> = 1.000                                                                                                                                 | 10,79                                            | 4,59                | 1,60                   | 1,60         | 1,60                              |
| Información adicional / Additional information                                                                                                                  |                                                  |                     |                        |              |                                   |
| <b>Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)</b>                                                                                                            | <b>1.665.396</b>                                 | <b>212.729</b>      | <b>178.365</b>         | <b>7.155</b> | <b>903.892</b>                    |

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