

**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)”**

31/05/2023

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	24	8	21
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	1,700	800	500	50	1,350
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1,150	550	350	50	900
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	2,850	1,350	850	100	2,250
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	248,800	117,250	74,550	5,100	198,900
K_{CCP}: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	2,912.26	278	0.0	5.1	0.0
C-factor = max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM})); 8% * 2% * DF_i)	1.157%	0.234%	0.160%	0.160%	0.160%
KCMi if DFi = 1.000	11.57	2.34	1.60	1.60	1.60