

**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)"**

30/11/2023

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	30	7	25	8	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	2.050	500	450	50	1.400
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.400	350	300	50	950
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.450	850	750	100	2.350
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	343.200	78.300	67.050	5.050	226.950
K_{CCP}: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	4.232,90	298,51	0,00	4,21	0,00
C-factor = $\max(K_{CCP} * (DF_i / (DF_{CCP} + DF_{CM}))); 8\% * 2\% * DF_i$	1,221%	0,377%	0,160%	0,160%	0,160%
KCMi if DF _i = 1.000	12,21	3,77	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.615.983	309.956	269.305	8.666	440.583

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