

**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)"**

29/09/2023

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	23
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	1.700	500	450	50	1.700
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.100	350	300	50	1.100
DF <sub>CCP</sub> = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	2.800	850	750	100	2.800
DF <sub>CM</sub> : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	249.000	74.250	64.050	5.050	253.050
<b>K<sub>CCP</sub>: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement</b>	3.397,39	353,03	0,00	5,31	0,00
<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>1,347%</b>	<b>0,470%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
KCMi if DF <sub>i</sub> = 1.000	13,47	4,70	1,60	1,60	1,60

**Información adicional / Additional information**

<b>Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)</b>	1.552.294	374.227	366.987	9.949	334.449
--	-----------	---------	---------	-------	---------

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