

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)"

31/05/2022

| 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             |
| DF <sub>CCP</sub> , Recursos propios de la ECC aportados previamente  | 2.000                 | 750           | 1.000         | 500           | 1.500          |
| DF <sub>CM</sub> , Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores                  | 179.800               | 339.050       | 62.250        | 5.150         | 259.700        |
| <b>K<sub>CCP</sub>, Requerimiento de capital hipotético a la ECC</b>  | <b>3.313,2</b>        | <b>467,3</b>  | <b>0,0</b>    | <b>7,8</b>    | <b>0,0</b>     |
| <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>1,822%</b>         | <b>0,160%</b> | <b>0,160%</b> | <b>0,160%</b> | <b>0,160%</b>  |
| K <sub>CMi</sub> si DF <sub>i</sub> = 1.000   | 18,22                 | 1,60          | 1,60          | 1,60          | 1,60           |