

Circular C-IRS-01/2024

Tarifas Segmento Derivados OTC de Tipos de Interés

BME CLEARING

20 de diciembre de 2023

Segmento: IRS

Fecha de entrada en vigor: 1 de enero de 2024

Sustituye a: C-IRS-01/2023

Establece las tarifas para el Segmento de Derivados OTC de Tipos de Interés. Se modifican los apartados 1, 3, 4 y 5. Se crea un nuevo apartado 6 "Programa de Colaboración Estratégica".

1. TARIFA DE COMPENSACIÓN DE TRANSACCIONES

Las Tarifas de Compensación de Transacciones se desarrollan en dos apartados. Un primer apartado 1.1), que será de aplicación para todos los Miembros desde el momento de apertura de la primera cuenta de clientes en BME CLEARING. Un segundo apartado 1.2), en el que se mantienen las Tarifas actuales basadas en Categorías. Una vez pase a aplicarse el apartado 1.1), el apartado 1.2) dejará de estar vigente una vez transcurridos 6 meses.

1.1. Tarifa de compensación de Transacciones del Segmento de Derivados OTC de Tipos de Interés con *Client Clearing*:

A) Miembros:

Una comisión de 4.500 euros al mes por la compensación de todas las transacciones que el Miembro registre, incluyendo nuevas transacciones y pagos de Cupones o Pagos Adicionales.

B) Clientes:

No se aplicará una tarifa fija por cuenta de cliente. Se establece una tarifa variable, en función del número de transacciones, de acuerdo al siguiente baremo:

Nº Transacciones Vivas (media del mes)		Tarifa de Compensación Variable
DE	HASTA	
1	5	200 euros/mes
6	20	700 euros/mes
21	30	1.000 euros/mes
31	50	1.500 euros/mes
51	100	2.500 euros/mes
101	200	4.500 euros/mes
201	500	9.000 euros/mes
501	1.000	12.000 euros/mes

Nº Transacciones Vivas (media del mes)		Tarifa de Compensación Variable
DE	HASTA	
1.001	2.000	15.000 euros/mes
2.001	5.000	18.000 euros/mes
A partir de 5.001		20.000 euros/mes

Para toda la compensación de clientes, se aplicará un descuento del 80% sobre las tarifas de la tabla de arriba durante un período de 3 años desde la apertura de la primera cuenta de cliente.

Esta tarifa se liquidará al final de cada mes natural.

1.2. Tarifa de compensación de Transacciones del Segmento de Derivados OTC de Tipos de Interés sin Client Clearing:

A) Miembros de las Categorías 1 y 2:

Una comisión de 4.500 euros al mes por la compensación de todas las transacciones que el Miembro registre, incluyendo nuevas transacciones y pagos de Cupones o Pagos Adicionales.

B) Miembros de las Categorías 3 y 4:

Se establece una tarifa fija y una tarifa variable:

- *Tarifa Fija en función del volumen de activo de su balance de situación a fecha 31 diciembre del año anterior a la entrada en vigor de esta Circular.*

Tarifa de Compensación Fija	
Activo > 30.000 millones de euros	1.000 euros/mes
Activo < 30.000 millones de euros	0 euros/mes

- *Tarifa variable en función del volumen de transacciones vivas registradas en BME CLEARING, facturándose de acuerdo al siguiente baremo:*

Nº Transacciones Vivas (media del mes)		Tarifa de Compensación Variable
DE	HASTA	
0	5	300 euros/mes
6	20	800 euros/mes
21	30	1.500 euros/mes

Nº Transacciones Vivas (media del mes)		Tarifa de Compensación Variable
DE	HASTA	
31	50	2.500 euros/mes
51	100	3.500 euros/mes
A partir de 101		4.500 euros/mes

La asignación de cada miembro a una Categoría se realizará de acuerdo a lo que dispone el Reglamento Delegado (UE) 2015/2205 de la Comisión, de 6 de agosto de 2015, por el que se completa el Reglamento (UE) nº 648/2012 del Parlamento Europeo y del Consejo en lo que respecta a las normas técnicas de regulación relativas a la obligación de compensación.

Esta tarifa se liquidará al final de cada mes natural.

2. TARIFA POR PERTENENCIA AL SEGMENTO DE DERIVADOS OTC DE TIPOS DE INTERÉS

La tarifa por pertenecer al Segmento de Derivados OTC de Tipos de Interés es de 500 euros al mes y se liquidará al final de cada mes natural. Este importe incluye la Tarifa General de Miembro descrita en el punto 1 de la Circular General C-GEN-01/2024 o aquella que la sustituya en cada momento.

3. TARIFA DE INCORPORACIÓN DE MIEMBROS COMPENSADORES

Los Miembros Compensadores que se incorporen a BME CLEARING para operar sólo en el Segmento de Derivados OTC de Tipos de Interés, estarán exentos durante un periodo de dos años, hasta el 31 de diciembre de 2025, de la tarifa de adhesión que establece la Circular C-GEN-01/2024, o aquella que la sustituya en cada momento, sin perjuicio de su obligación de pago del resto de tarifas que les sean aplicables.

4. TARIFAS SOBRE VALORES APORTADOS COMO GARANTÍAS

Debido a las características especiales del Segmento Derivados OTC de Tipos de Interés, en este segmento las tarifas sobre valores aportados como garantías detalladas en la Circular C-GEN-01/2024, o aquella que la sustituya, serán 0,10% por año para las cuentas propias de Miembro y 0,05% para *clearing* de clientes, en ambos casos aplicando esta tarifa sobre las garantías depositadas al final de la sesión.

5. TARIFAS ASOCIADAS A PROGRAMAS DE PROVEEDORES DE LIQUIDEZ

Las tarifas de los apartados 1 y 2 podrán verse modificadas de manera extraordinaria durante 2024 si el miembro cumple con las condiciones para Proveedores de Liquidez del segmento de derivados OTC de Tipos de interés establecidas en el apartado 1) y 2) de la Instrucción “Programa de proveedores de liquidez”.

6. PROGRAMA DE COLABORACIÓN ESTRATÉGICA

Se establece un Programa de Colaboración Estratégica según las condiciones estipuladas en la Instrucción “Programa de colaboración estratégica”.

7. IMPUESTO SOBRE EL VALOR AÑADIDO (IVA)

Las tarifas aquí recogidas no incluyen el impuesto sobre el valor añadido que, en su caso, resulte de aplicación.

2023 Bolsas y Mercados Españoles, Sociedad Holding de Mercados y Sistemas Financieros S. A. Todos los derechos reservados.

BME

Plaza de la Lealtad,1

Palacio de la Bolsa

28014 Madrid

www.bolsasymercados.es

