

BME CLEARING

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)”

29/08/2025

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	29	7	24	9	23
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	3,950	300	350	50	1,300
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	2,350	200	200	50	800
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	6,300	500	550	100	2,100
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	751,450	54,050	60,000	5,200	244,500
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5,803	337	0	6	0
C-factor = max(K _{CCP} * (DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM}))); 8% * 2% * DF _i)	0.77%	0.62%	0.16%	0.16%	0.16%
KCMi if DFi = 1.000	7.66	6.17	1.60	1.60	1.60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas en millones de €/ Margins Required in million € (IM*)	2,700.72	130.49	181.44	4.87	344.48

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