

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)”

30/01/2026

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	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	4,100	250	300	50	1,000
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	2,450	150	200	50	600
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	6,550	400	500	100	1,600
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	834,850	44,750	51,950	5,150	200,050
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5,563	311	0	2	0
C-factor = max(K _{CCP} * (DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM}))); 8% * 2% * DF _i)	0.66%	0.69%	0.16%	0.16%	0.16%
KCMi if DFi = 1.000	6.61	6.89	1.60	1.60	1.60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas en millones de €/ Margins Required in million € (IM*)	2,786.80	107.78	210.45	3.78	365.77

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