

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)”

28/11/2025

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	250	300	50	1,050
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	2,400	150	200	50	650
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	6,350	400	500	100	1,700
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	834,550	49,250	57,150	5,150	221,350
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5,230	317	0	3	0
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	0.62%	0.64%	0.16%	0.16%	0.16%
KCMi if DFi = 1.000	6.22	6.39	1.60	1.60	1.60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas en millones de €/ Margins Required in million € (IM*)	2,978.70	105.33	158.01	4.53	391.37

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