

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)”

30/06/2025

| Resumen de estadísticas clave / Key Summary Statistics                                                                                                          | Derivados Financieros /<br>Financial Derivatives | Energía /<br>Energy | Repo / Fixed<br>Income | IRS      | Renta Variable<br>/ 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                                                               | 3.900                                            | 350                 | 350                    | 50       | 1.200                             |
| SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources                                       | 2.350                                            | 200                 | 250                    | 50       | 750                               |
| DF <sub>CCP</sub> = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources                                    | 6.250                                            | 550                 | 600                    | 100      | 1.950                             |
| DF <sub>CM</sub> : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members | 723.950                                          | 59.500              | 61.950                 | 5.150    | 220.250                           |
| K <sub>CCP</sub> : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement                                                          | 4.953                                            | 307                 | 0                      | 3        | 0                                 |
| 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> )                                     | 0,68%                                            | 0,51%               | 0,16%                  | 0,16%    | 0,16%                             |
| KCMi if DF <sub>i</sub> = 1.000                                                                                                                                 | 6,78                                             | 5,12                | 1,60                   | 1,60     | 1,60                              |
| Información adicional / Additional information                                                                                                                  |                                                  |                     |                        |          |                                   |
| Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)                                                                                                                   | 2.248,99                                         | 144,86              | 188,47                 | 5,11     | 499,18                            |

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