

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)”

30/09/2025

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	751,900	51,550	59,950	5,200	244,550
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	4,949	318	0	6	0
C-factor = max(K _{CCP} * (DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	0.65%	0.61%	0.16%	0.16%	0.16%
KCMi if DFi = 1.000	6.53	6.11	1.60	1.60	1.60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas en millones de €/ Margins Required in million € (IM*)	3,023.73	122.40	171.37	4.78	320.25

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