

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)”

27/02/2026

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	250	50	950
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	2.500	150	150	50	600
DF _{CCP} = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	6.600	400	400	100	1.550
DF _{CM} : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	835.525	48.850	50.800	5.100	190.500
K _{CCP} : Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement	5.854	247	0	3	0
C-factor = max(K _{CCP} *(DF _i / (DF _{CCP} + DF _{CM})); 8% * 2% * DF _i)	0,70%	0,50%	0,16%	0,16%	0,16%
KCMi if DFi = 1.000	6,95	5,02	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas en millones de €/ Margins Required in million € (IM*)	2.625,80	97,73	179,47	3,72	924,88

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