

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO Y CONTRAPARTE

Correspondiente al \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

S.G.R. \_\_\_\_\_

Año			Mes			P	Estado				Código Entidad		
					-	-	T	6	2	3	8		

(Miles de euros redondeados)

ACTIVO	Saldos de balance		Fondos especiales		Deducciones de recursos propios		Otros ajustes (a)		Saldo ajustado	
1. Caja.....	0001		0021		0041		0061		0081	
2. Entidades de crédito.....	0002		0022		0042		0062		0082	
3. Deudores.....	0003		0023		0043		0063		0083	
4. Cartera de renta fija.....	0004		0024		0044		0064		0084	
5. Activos dudosos.....	0005		0025		0045		0065		0085	
6. Cartera de renta variable.....	0006		0026		0046		0066		0086	
7. Inmovilizado.....	0007		0027		0047		0067		0087	
8. Activos inmateriales.....	0008		0028		0048		0068		0088	
9. Socios por desembolsos pendientes.....	0009		0029		0049		0069		0089	
10. Cuentas de periodificación.....	0010		0030		0050		0070		0090	
11. Pérdidas pendientes de regularizar.....	0011		0031		0051		0071		0091	
TOTAL.....	0015		0035		0055		0075		0095	
PRO MEMORIA. Activos frente a:										
Comunidades Autónomas.....	0016		0036		0056		0076		0096	
Corporaciones Locales.....	0017		0037		0057		0077		0097	

(a) Saldos compensatorios recogidos en el apartado 2 de la norma decimotercera de la Circular 5/1993, y la corrección de valoración recogida en el apartado 4 de dicha norma.

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO Y CONTRAPARTE  
(Sin considerar los acuerdos de compensación contractual)

Correspondiente al \_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

S.G.R. \_\_\_\_\_

Año		Mes		P	Estado				Código Entidad	
			-	T	6	2	3	8		

(Miles de euros redondeados)

ACTIVO	Ponderaciones (%)										Total ponderado	
	0		10		20		50		100			
1. Caja.....	0101		0521		0121		0141		0161		0181	
2. Entidades de crédito.....	0102		0522		0122		0142		0162		0182	
3. Deudores.....	0103		0523		0123		0143		0163		0183	
4. Cartera de renta fija.....	0104		0524		0124		0144		0164		0184	
5. Activos dudosos.....	0105		0525		0125		0145		0165		0185	
6. Cartera de renta variable.....	0106		0526		0126		0146		0166		0186	
7. Inmovilizado.....	0107		0527		0127		0147		0167		0187	
8. Activos inmateriales.....	0108		0528		0128		0148		0168		0188	
9. Socios por desembolsos pendientes.....	0109		0529		0129		0149		0169		0189	
10. Cuentas de periodificación.....	0110		0530		0130		0150		0170		0190	
11. Pérdidas pendientes de regularizar.....	0111		0531		0131		0151		0171		0191	
TOTAL.....	0115		0535		0135		0155		0175		0195	
PRO MEMORIA. Activos frente a:												
Comunidades Autónomas.....	0116		0536		0136		0156		0176		0196	
Corporaciones Locales.....	0117		0537		0137		0157		0177		0197	

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO Y CONTRAPARTE  
(Sin considerar los acuerdos de compensación contractual)

Correspondiente al \_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

S.G.R. \_\_\_\_\_

Año		Mes			P	Estado				Código Entidad		
				-	-	T	6	2	3	8		

(Miles de euros redondeados)

COMPROMISOS Y CUENTAS DE ORDEN NO RELACIONADAS CON TIPOS DE CAMBIO O INTERÉS	Saldos de balance		Fondos especiales		Otros ajustes (a)		Factor de corrección (%)							
							0		20		50		100	
1. Riesgo en vigor por avales y garantías .....	0201		0211		0221		0231		0241		0251		0261	
Del que: Reavalado por Administraciones .....	0202		0212		0222		0232		0242		0252		0262	
Avales técnicos (b) .....	0203		0213		0223		0233		0243		0253		0263	
2. Otras cuentas (c) .....	0204		0214		0224		0234		0244		0254		0264	
TOTAL .....	0205		0215		0225		0235		0245		0255		0265	

(a) En el caso de riesgos deducidos, se incluirán en esta columna.

(b) Avales incluidos en la norma 14.2.III.f) de la Circular 5/1993.

(c) Otras cuentas de orden que representen pasivos, y compromisos y riesgos contingentes.

CUENTAS DE ORDEN RELACIONADAS CON TIPOS DE CAMBIO O DE INTERÉS	Saldos afectos		Saldos afectos según plazos			Saldo ajustado (1)						
	Saldos de balance	Menos Ajustes	< = 1 año	> 1 año = < 2 años	> 2 años							
OPERACIONES SOBRE TIPOS DE INTERÉS (a)			Sistema de valoración a precios de Sistema del riesgo original		0 0,5	0,5 1	0,5 (b)					
A) Total .....	0331		0336		0341		0346		0351		0356	
OPERACIONES SOBRE TIPOS DE CAMBIO (c)	Sistema de valoración a precios de Sistema del riesgo original		1 2	5 5	5 (b)							
B) Total .....	0332		0337		0342		0347		0352		0357	
C) TOTAL = A + B .....	0333		0338		0343		0348		0353		0358	

(a) Incluirá los futuros financieros sobre tipos de interés, las permutas financieras en una sola divisa, los convenios de tipo de interés futuro, las opciones compradas y otras operaciones de análoga naturaleza, de acuerdo con el apartado 2 de la norma decimoquinta de la Circular 5/1993.

(b) Porcentajes a aplicar en función del vencimiento original (apartado 5 de la norma decimoquinta de la Circular 5/1993).

(c) Incluirá las compraventas de divisas no vencidas, las opciones compradas sobre divisas, las permutas financieras sobre tipos de interés en divisas distintas y otras operaciones de análoga naturaleza, de acuerdo con el apartado 2 de la norma decimoquinta de la Circular 5/1993.

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO Y CONTRAPARTE  
(Sin considerar los acuerdos de compensación contractual)

Correspondiente al \_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

S.G.R. \_\_\_\_\_

Año	Mes			P	Estado	Código Entidad
		-	-	T	6 2 3 8	

(Miles de euros redondeados)

COMPROMISOS Y CUENTAS DE ORDEN NO RELACIONADAS CON TIPOS DE CAMBIO O INTERÉS	Saldos ajustados		Ponderaciones (%)								Total ponderado	
			0		20		50		100			
1. Riesgo en vigor por avales y garantías .....	0271		0281		0291		0301		0311		0321	
Del que: Reavalado por Administraciones Públicas .....	0272		0282		0292		0302		0312		0322	
Avales técnicos (b) .....	0273		0283		0293		0303		0313		0323	
2. Otras cuentas (c) .....	0274		0284		0294		0304		0314		0324	
TOTAL .....	0275		0285		0295		0305		0315		0325	

(b) Avales incluidos en la norma 14.2.III.f) de la Circular 5/1993.

(c) Otras cuentas de orden que representen pasivos, y compromisos y riesgos contingentes.

CUENTAS DE ORDEN RELACIONADAS CON TIPOS DE CAMBIO O DE INTERÉS	Sistema de valoración a precio de mercado: costes de		Fondos específicos (3)	Distribución de (1 + 2 - 3) según ponderaciones (%)			Total ponderado							
	Positivo (2)	Negativo		0	20	50								
OPERACIONES SOBRE TIPOS DE INTERÉS (a)														
A) Total .....	0361		0366		0371		0376		0381		0386		0391	
OPERACIONES SOBRE TIPOS DE CAMBIO (c)														
B) Total .....	0362		0367		0372		0377		0382		0387		0392	
C) TOTAL = A + B .....	0363		0368		0373		0378		0383		0388		0393	

RIESGOS TOTALES PONDERADOS.....	0400	
RECURSOS PROPIOS MÍNIMOS NECESARIOS POR RIESGO DE CRÉDITO Y CONTRAPARTE:		
Porcentaje aplicable.....	0405	8,00
Importe (A).....	0410	
Reducción de los requerimientos por los acuerdos de compensación (Nº 15 aptdos. 6 a 9, de la Circ. 5/1993) (B) .....	0415	
TOTAL (A - B) .....	0420	

\_\_\_\_\_, a \_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_  
(Sello de la entidad)

Firmado (por poder): \_\_\_\_\_  
(Nombre y cargo)