

ANEXO III

RESULTADOS DE LAS CARTERAS DE REFERENCIA A EFECTOS DE SUPERVISIÓN			
<u>Número de la plantilla</u>	<u>Código de plantilla</u>		<u>Nombre de la plantilla</u>
			FRECUENCIA ANUAL ⁽¹⁾
101	C 101.00	5401	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago, por contraparte
102	C 102.00	5402	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago
103	C 103.00	5403	Datos sobre las exposiciones en las carteras con elevado impago
105.01	C 105.01	5451	Definición de modelos internos
105.02	C 105.02	5452	Asignación de modelos internos a las carteras
105.03	C 105.03	5453	Asignación de modelos internos a los países
111	C 111.00	5454	Definición de contrapartes de carteras con bajo impago

ANEXO VII

RESULTADOS DE LAS CARTERAS DE REFERENCIA A EFECTOS DE SUPERVISIÓN. RIESGO DE MERCADO				
<u>Número de la plantilla</u>	<u>Código de plantilla</u>		<u>Nombre de la plantilla/del grupo de plantillas</u>	<u>Nombre abreviado</u>
			FRECUENCIA ANUAL ⁽¹⁾	
			VALOR DE MERCADO INICIAL	
106	C 106.00	5406	Valor de mercado inicial y justificación de la exclusión	IMV
106.01	C 106.01	5407	Sensibilidades al riesgo por instrumento	SENSIBILIDADES
			VaR Y sVaR NO CTP	
107.1	C 107.01	5471	VaR Y sVaR NO CTP. Detalles	VaR&SVaR 1
107.2	C 107.02	5472	VaR Y sVaR NO CTP. Resultados en la moneda de base	VaR&SVaR 2
			VaR A PARTIR DE LAS PÉRDIDAS Y GANANCIAS DE UN AÑO	
108	C 108.00	5408	Var a partir de las pérdidas y ganancias de un año	1Y P&L
			EXIGENCIA DE CAPITAL POR RIESGO INCREMENTAL	
109.1	C 109.01	5491	IRC. Detalles del modelo	IRC 1
109.2	C 109.02	5492	IRC. Detalles por cartera	IRC 2
109.3	C 109.03	5493	IRC. Importe por cartera/fecha	IRC 3
			NEGOCIACIÓN DE CORRELACIÓN	
110.1	C 110.01	5411	Negociación de correlación. Detalles del modelo	CT 1
110.2	C 110.02	5412	Negociación de correlación. Detalles por cartera	CT 2
110.3	C 110.03	5413	Negociación de correlación. Todos los riesgos de precio por cartera/ fecha	CT 3
			MÉTODO BASADO EN SENSIBILIDADES	
120.01	C 120.01	5421	Sensibilidades al riesgo por instrumento/cartera	SBM 1
120.02	C 120.02	5422	Requisitos de fondos propios por cartera	SBM 2
120.03	C 120.03	5423	Requisitos de fondos propios	SBM 3

ANEXO VIII

RESULTADOS DE LAS CARTERAS DE REFERENCIA A EFECTOS DE SUPERVISIÓN			
<u>Número de la plantilla</u>	<u>Código de plantilla</u>		<u>Nombre de la plantilla/del grupo de plantillas</u>
			<u>FRECUENCIA ANUAL</u> ⁽¹⁾
111.00	C 111.00	5454	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago, por contraparte
112.00	C 112.00	5455	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago, por contraparte y por escenario económico
113.00	C 113.00	5456	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago, por contraparte y por línea
114.00	C 114.00	5457	Detalles de los escenarios macroeconómicos por código de zona del PIB

⁽¹⁾ art. 4 del Reglamento de Ejecución (UE) nº 2070/2016