

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO PARA TITULIZACIONES.  
MÉTODO ESTÁNDAR

RP24

Página 1 de 3

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

ENTIDAD \_\_\_\_\_

TIPO DE TITULIZACIÓN **Dimensión 1: es-be-d-st / Tipo de titulación**

Año	Mes		P	Estado	Código entidad	Tipo identificador (*)
				E 3 0 2 4		

		TOTAL EXPOSICIONES DE TITULIZACIÓN ORIGINADAS	TITULIZACIONES SINTÉTICAS: PROTECCIÓN CREDITICIA SOBRE LAS EXPOSICIONES TITULIZADAS				POSICIONES DE TITULIZACIÓN		EXPOSICIÓN NETA DE CORRECCIONES DE VALOR POR DETERIORO DE ACTIVOS Y PROVISIONES	TÉCNICAS DE REDUCCIÓN DEL RIESGO DE CRÉDITO CON EFECTO EN LA REASIGNACIÓN DE EXPOSICIONES														
			(-) COBERTURA DEL RIESGO DE CRÉDITO MEDIANTE GARANTÍAS REALES O INSTRUMENTOS SIMILARES (CVA)	(-) TOTAL SALIDAS		IMPORTE NOCIONAL DE LA COBERTURA DEL RIESGO DE CRÉDITO RETENIDA O RECOMPRADA	EXPOSICIÓN ORIGINAL	COBERTURA DEL RIESGO DE CRÉDITO CON GARANTÍAS PERSONALES: VALORES AJUSTADOS (GA)		COBERTURA DEL RIESGO DE CRÉDITO MEDIANTE GARANTÍAS REALES O INSTRUMENTOS SIMILARES	EFECTO DE LAS TÉCNICAS DE REDUCCIÓN DEL RIESGO DE CRÉDITO EN LA REASIGNACIÓN DE EXPOSICIONES													
				COBERTURA DEL RIESGO DE CRÉDITO CON GARANTÍAS PERSONALES (G*)							(-) TOTAL SALIDAS		TOTAL ENTRADAS											
		1	2		3		4		5		6		7 = 5 + 6		8		9		10		11			
Dimensión 2: es-be-d-cr / Riesgo de crédito	TOTAL EXPOSICIONES	0001		0031		0061		0091		0121		0151		0181		0211		0241		0271		0301		
	1 ORIGINADOR: TOTAL EXPOSICIONES	0005		0035		0065		0095		0125		0155		0185		0215		0245		0275		0305		
	1.1 EXPOSICIONES DE BALANCE	0006		0036		0066		0096		0126		0156		0186		0216		0246		0276		0306		
	1.1.1 TRAMOS PREFERENTES	0007		0037		0067		0097		0127		0157		0187		0217		0247		0277		0307		
	1.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO	0008		0038		0068		0098		0128		0158		0188		0218		0248		0278		0308		
	1.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS	0009		0039		0069		0099		0129		0159		0189		0219		0249		0279		0309		
	1.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS	0010		0040		0070		0100		0130		0160		0190		0220		0250		0280		0310		
	1.2.1 TRAMOS PREFERENTES	0011		0041		0071		0101		0131		0161		0191		0221		0251		0281		0311		
	1.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO	0012		0042		0072		0102		0132		0162		0192		0222		0252		0282		0312		
	1.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS	0013		0043		0073		0103		0133		0163		0193		0223		0253		0283		0313		
	1.3 CLÁUSULAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	Hiper cubo exclusión ExposicionesOriginadorClausulasHypercube									0134		0164		0194		Hiper cubo exclusión ExcEarlyAmortizationHypercube							
	2. INVERSOR: TOTAL EXPOSICIONES	Hiper cubo exclusión ExcInvestorAndSponsorTotalExposuresHypercube									0135		0165		0195		0225		0255		0285		0315	
	Dimensión 3: es-be-d-et / Tipo de exposiciones	2.1 EXPOSICIONES DE BALANCE	No incluidas en hipercubo inclusión SectionExposureTypesForInvestorHypercube									0136		0166		0196		0226		0256		0286		0316
2.1.1 TRAMOS PREFERENTES		0137											0167		0197		0227		0257		0287		0317	
2.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO		0138											0168		0198		0228		0258		0288		0318	
2.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS		0139											0169		0199		0229		0259		0289		0319	
2.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS		0140											0170		0200		0230		0260		0290		0320	
2.2.1 TRAMOS PREFERENTES		0141											0171		0201		0231		0261		0291		0321	
2.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO		0142											0172		0202		0232		0262		0292		0322	
2.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS		0143											0173		0203		0233		0263		0293		0323	
3. PATROCINADOR: TOTAL EXPOSICIONES		Hiper cubo exclusión ExcInvestorAndSponsorTotalExposuresHypercube									0145		0175		0205		0235		0265		0295		0325	
3.1 EXPOSICIONES DE BALANCE		No incluidas en hipercubo inclusión SectionExposureTypesForSponsorHypercube									0146		0176		0206		0236		0266		0296		0326	
3.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS	0147											0177		0207		0237		0267		0297		0327		

(\*) Se consignarán

- 0 Estado correspondiente a grupo consolidado  
1 Estado correspondiente a subgrupo consolidado  
2 Estado individual correspondiente a entidad  
3 Estado individual correspondiente a entidad que presenta sus Recursos Propios con instrumentales

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO PARA TITULIZACIONES.  
MÉTODO ESTÁNDAR

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

TIPO DE TITULIZACIÓN **Dimensión 1: es-be-d-st / Tipo de titulización**

Año	Mes		P	Estado	Código entidad	Tipo identificador (*)
				E 3 0 2 4		

<div><div></div><div>Monetario no negativo / Decimales = -3</div><div></div><div>Monetario / Decimales = -3</div><div></div><div>Monetario no positivo / Decimales = -3</div></div>		EXPOSICIÓN NETA REASIGNADA	(1) TÉCNICAS DE REDUCCIÓN DEL RIESGO DE CRÉDITO CON EFECTO EN EL IMPORTE DE LAS EXPOSICIONES: METODO AMPLIO PARA LAS GARANTÍAS REALES DE NATURALEZA FINANCIERA. VALORES AJUSTADOS (CVAM)	VALOR PLENAMENTE AJUSTADO DE LA EXPOSICIÓN (E*)	DISTRIBUCIÓN DEL VALOR PLENAMENTE AJUSTADO DE LA EXPOSICIÓN CORRESPONDIENTE A PARTIDAS INCLUIDAS EN CUENTAS DE ORDEN POR FACTORES DE CONVERSIÓN								VALOR DE LA EXPOSICIÓN									
					0%	> 0 y <= 20	> 20 y <= 50	> 50 y <= 100					DEL QUE:									
													(-) DEDUCIDO DE RECURSOS PROPIOS		SUJETO A PONDERACIONES DE RIESGO							
		12 = 7+10+11	13	14 = 12+13	15		16		17		18		19		20		21 = 19 + 20					
Dimensión 2: es-be-d-α / Riesgo de crédito	TOTAL EXPOSICIONES		0331		0361		0391		0421		0451		0481		0511		0541		0571		0601	
	1 ORIGINADOR: TOTAL EXPOSICIONES		0335		0365		0395		0425		0455		0485		0515		0545		0575		0605	
	Dimensión 3: es-be-d-et / Tipo de exposiciones	1.1 EXPOSICIONES DE BALANCE	0336		0366		0396		Hipercono exclusión ExcOnBalanceSheetItemsForOriginatorHypercone								0546		0576		0606	
		1.1.1 TRAMOS PREFERENTES	0337		0367		0397										0547		0577		0607	
		1.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO	0338		0368		0398										0548		0578		0608	
		1.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS	0339		0369		0399										0549		0579		0609	
		1.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS	0340		0370		0400		0430		0460		0490		0520		0550		0580		0610	
		1.2.1 TRAMOS PREFERENTES	0341		0371		0401		0431		0461		0491		0521		0551		0581		0611	
		1.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO	0342		0372		0402		0432		0462		0492		0522		0552		0582		0612	
		1.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS	0343		0373		0403		0433		0463		0493		0523		0553		0583		0613	
		1.3 CLÁUSULAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA	Hipercono exclusión ExcEarlyAmortizationHypercone			0404		0434		0464		0494		0524		0554		Hipercono exclusión ExcEarlyAmortizationHypercone				
	2. INVERSOR: TOTAL EXPOSICIONES		0345		0375		0405		0435		0465		0495		0525		0555		0585		0615	
	Dimensión 3: es-be-d-et / Tipo de exposiciones	2.1 EXPOSICIONES DE BALANCE	0346		0376		0406		Hipercono exclusión ExcOnBalanceSheetItemsForInvestorHypercone								0556		0586		0616	
		2.1.1 TRAMOS PREFERENTES	0347		0377		0407										0557		0587		0617	
		2.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO	0348		0378		0408										0558		0588		0618	
		2.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS	0349		0379		0409										0559		0589		0619	
		2.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS	0350		0380		0410		0440		0470		0500		0530		0560		0590		0620	
		2.2.1 TRAMOS PREFERENTES	0351		0381		0411		0441		0471		0501		0531		0561		0591		0621	
		2.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO	0352		0382		0412		0442		0472		0502		0532		0562		0592		0622	
		2.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS	0353		0383		0413		0443		0473		0503		0533		0563		0593		0623	
		3. PATROCINADOR: TOTAL EXPOSICIONES	0355		0385		0415		0445		0475		0505		0535		0565		0595		0625	
	Dimensión 3: es-be-d-et / exposiciones	3.1 EXPOSICIONES DE BALANCE	0356		0386		0416		Hipercono exclusión ExcOnBalanceSheetItemsForSponsorHypercone								0566		0596		0626	
		3.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS	0357		0387		0417		0447		0477		0507		0537		0567		0597		0627	

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE CRÉDITO PARA TITULIZACIONES.  
MÉTODO ESTÁNDAR

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

TIPO DE TITULIZACIÓN

Año	Mes		P	Estado	Código entidad	Tipo identificador (*)
			E	3 0 2 4		

<div>Monetario no negativo / Decimales = -3</div> <div>Monetario / Decimales = -3</div> <div>Monetario no positivo / Decimales = -3</div>		DISTRIBUCIÓN DEL VALOR DE LA EXPOSICIÓN SUJETO A PONDERACIONES DE RIESGO POR PONDERACIONES DE RIESGO																		EXPOSICIONES PONDERADAS POR RIESGO	AJUSTE A LAS EXPOSICIONES PONDERADAS POR RIESGO POR DESFASE DE VENCIMIENTOS	TOTAL REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS ANTES DE LA APLICACIÓN DEL LÍMITE A LAS EXPOSICIONES PONDERADAS POR RIESGO	PRO MEMORIA: REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS CORRESPONDIENTES AL TOTAL SALIDAS HACIA OTROS ESTADOS		TOTAL REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS TRAS LA APLICACIÓN DEL LÍMITE A LAS EXPOSICIONES PONDERADAS POR RIESGO		
		CON CALIFICACIÓN CREDITICIA (NIVELES DE CALIDAD CREDITICIA 1 A 4 A LARGO PLAZO Y 1 A 3 A CORTO PLAZO)								1250%		MÉTODOS QUE UTILIZAN LA PONDERACIÓN DE RIESGO DE LAS EXPOSICIONES TITULIZADAS															
		20%		50%		100%		350%		CON CALIFICACIÓN CREDITICIA		SIN CALIFICACIÓN CREDITICIA		DEL QUE: POSICIONES DE SEGUNDA PÉRDIDA EN PROGRAMAS ABCP													
		22		23		24		25		26		27		28		29		30									3001
TOTAL EXPOSICIONES		0631		0661		0691		0721		0751		0781		0811		0841		0871		0901		0931		0961		0991	
		1.1 EXPOSICIONES DE BALANCE																									
		1.1.1 TRAMOS PREFERENTES																									
		1.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO																									
		1.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS																									
		1.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS																									
		1.2.1 TRAMOS PREFERENTES																									
		1.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO																									
		1.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS																									
		1.3 CLÁUSULAS DE AMORTIZACIÓN ANTICIPADA																									
1. ORIGINADOR: TOTAL EXPOSICIONES		Hiper cubo exclusión ExcEarlyAmortizationHypercube																0824		Hiper cubo exclusión ExcEarlyAmortizationHypercube		0884		0914		0944	
		2. INVERSOR: TOTAL EXPOSICIONES																									
		2.1 EXPOSICIONES DE BALANCE																									
		2.1.1 TRAMOS PREFERENTES																									
		2.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO																									
		2.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS																									
		2.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS																									
		2.2.1 TRAMOS PREFERENTES																									
		2.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO																									
		2.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS																									
2. INVERSOR: TOTAL EXPOSICIONES		0645		0675		0705		0735		0765		0795		0825		0855		0885		0915		0945		Hiper cubo exclusión ExcInvestorAndSponsorTotalExposuresHypercube			
		2.1 EXPOSICIONES DE BALANCE																									
		2.1.1 TRAMOS PREFERENTES																									
		2.1.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO																									
		2.1.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS																									
		2.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS																									
		2.2.1 TRAMOS PREFERENTES																									
		2.2.2 TRAMOS DE RIESGO INTERMEDIO																									
		2.2.3 TRAMOS DE PRIMERAS PÉRDIDAS																									
		3. PATROCINADOR: TOTAL EXPOSICIONES		0655		0685		0715		0745		0775		0805		0835		0865		0895		0925		0955		Hiper cubo exclusión ExcInvestorAndSponsorTotalExposuresHypercube	
3.1 EXPOSICIONES DE BALANCE																											
3.2 EXPOSICIONES EN CUENTAS DE ORDEN Y DERIVADOS																											