

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

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

ENTIDAD: \_\_\_\_\_

DIVISA: **Dimensión 1: es-be-d-cu / Divisas**

Monetario no negativo / Decimales = -3

Monetario no positivo / Decimales = -3

Dimensión 2: es-be-d-mr / Riesgo de Mercado

												POSICIONES				REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS												
POSICIONES BRUTAS						(-) EFECTO REDUCTOR EN LAS OPERACIONES DE ASEGURAMIENTO DE EMISIONES	POSICIONES NETAS		COMPENSACIÓN PARA POSICIONES DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN CUBIERTAS CON DERIVADOS DE CRÉDITO		POSICIONES PONDERADAS SUJETAS A REQUERIMIENTOS	PORCENTAJE APLICABLE (%)																
LARGAS		CORTAS		LARGAS			CORTAS		(-) A LAS POSICIONES NETAS LARGAS	(-) A LAS POSICIONES NETAS CORTAS																		
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)		(7)	(8)																				
POSICIONES EN RENTA FIJA DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN													0401															
1 RIESGO GENERAL. EN FUNCIÓN DEL VENCIMIENTO													0405															
1.1 ZONA 1												Hipercubo exclusión ExcZonesHypercube		Hipercubo exclusión ExcZonesHypercube														
1.2 ZONA 2																												
1.3 ZONA 3																												
1.a POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS EN CADA UNA DE LAS BANDAS DE VENCIMIENTO																												
1.b POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS EN LA ZONA 1												0360		10,00	0410													
1.c POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS EN LA ZONA 2												0361		40,00	0411													
1.d POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS EN LA ZONA 3												0362		30,00	0412													
1.e1 POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS ENTRE LAS ZONAS 1 Y 2												0363		30,00	0413													
1.e2 POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS ENTRE LAS ZONAS 2 Y 3												0364		40,00	0414													
1.f POSICIONES PONDERADAS COMPENSADAS ENTRE LAS ZONAS 1 Y 3												0365		40,00	0415													
1.g POSICIÓN PONDERADA NO COMPENSADA RESIDUAL												0366		150,00	0416													
												0367		100,00	0417													
2 RIESGO GENERAL. EN FUNCIÓN DE LA DURACIÓN													0420															
2.1 ZONA 1												Hipercubo exclusión ExcZonesHypercube		Hipercubo exclusión ExcZonesHypercube														
2.2 ZONA 2																												
2.3 ZONA 3																												
2.a POSICIÓN COMPENSADA PONDERADA SEGÚN LA DURACIÓN EN CADA ZONA																												
2.b1 POSICIÓN COMPENSADA PONDERADA SEGÚN LA DURACIÓN ENTRE LAS ZONAS 1 Y 2												0375		2,00	0425													
2.b2 POSICIÓN COMPENSADA PONDERADA SEGÚN LA DURACIÓN ENTRE LAS ZONAS 2 Y 3												0376		40,00	0426													
2.c POSICIÓN COMPENSADA PONDERADA SEGÚN LA DURACIÓN ENTRE LAS ZONAS 1 Y 3												0377		40,00	0427													
2.d POSICIONES RESIDUALES NO COMPENSADAS PONDERADAS SEGÚN LA DURACIÓN												0378		150,00	0428													
												0379		100,00	0429													
3 RIESGO ESPECÍFICO													0435															
3.1 INSTRUMENTOS QUE RECIBIRÍAN UNA PONDERACIÓN NULA POR RIESGO DE CRÉDITO												0035		0085		0135		0185		0235		0285		0335		0385		
3.2 INSTRUMENTOS QUE RECIBIRÍAN UNA PONDERACIÓN DEL 10%, 20% O 50% POR RIESGO DE CRÉDITO												0036		0086		0136		0186		0236		0286		0336		0386		
3.2.a CON VENCIMIENTO RESIDUAL ≤ 6 MESES												0037		0087		0137		0187		0237		0287		0337		0387		
3.2.b CON VENCIMIENTO RESIDUAL > 6 MESES Y ≤ 24 MESES												0038		0088		0138		0188		0238		0288		0338		0388		
3.2.c CON VENCIMIENTO RESIDUAL > 24 MESES												0039		0089		0139		0189		0239		0289		0339		0389		
3.3 RESTO DE INSTRUMENTOS												0040		0090		0140		0190		0240		0290		0340		0390		
3.4 INSTRUMENTOS QUE RECIBIRÍAN UNA PONDERACIÓN DEL 150% POR RIESGO DE CRÉDITO												0041		0091		0141		0191		0241		0291		0341		0391		
3.5 POSICIONES DE TITULIZACIÓN OBJETO DE DEDUCCIÓN O CON PONDERACIÓN DE RIESGO DEL 1250% Y FACILIDADES DE LIQUIDEZ NO COTIZADAS												0042		0092		0142		0192		0242		0292		0342		0392		
3.6 INSTRUMENTOS QUE RECIBIRÍAN UNA PONDERACIÓN DEL 350% POR RIESGO DE CRÉDITO												0043		0093		0143		0193		0243		0293		0343		0393		
4 MÉTODO ESPECÍFICO PARA PARTICIPACIONES EN INSTITUCIONES DE INVERSIÓN COLECTIVA												0044		0094		0144		0194		0244		0294		0344		0394		
5 MÉTODO BASADO EN LOS MÁRGENES DE GARANTÍA PARA LOS CONTRATOS DE FUTUROS Y OPCIONES NEGOCIABLES EN MERCADOS ORGANIZADOS (1)												0045		0095		0145		0195		0245		0295		0345		0395		
6 MÉTODO BASADO EN LOS MÁRGENES DE GARANTÍA PARA LOS CONTRATOS DE FUTUROS Y OPCIONES NO NEGOCIABLES EN MERCADOS ORGANIZADOS (1)												Hipercubo exclusión ExcMetodosMargenesGarantiasHypercube						Hipercubo exclusión ExcParticularAndMarginBasedApproachesHypercube		Hipercubo exclusión ExcMetodosMargenesGarantiasHypercube			Hipercubo exclusión ExcMetodosMargenesGarantiasHypercube					
7 OTROS RIESGOS INHERENTES A LAS OPCIONES APARTE DEL RIESGO DE DELTA												Hipercubo exclusión ExcMetodosMargenesGarantiasHypercube											0448					

(\*) ELEMENTOS NO APLICABLES A LAS ENTIDADES DE CRÉDITO SEGÚN LA NORMATIVA ESPAÑOLA

(\*) Se consignarán:

0 Estado correspondiente a grupo consolidado

1 Estado correspondiente a subgrupo consolidado

2 Estado individual correspondiente a ei

3 Estado individual correspondiente a entidad que presenta sus recursos propi