

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGO DE PRECIO DE LAS POSICIONES EN  
MATERIAS PRIMAS. MÉTODO ESTÁNDAR

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

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

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

|                                                                                                                                             | POSICIONES BRUTAS |        |                                                                     |  |        |  |        |        | POSICIONES NETAS |  |      |      | POSICIONES SUJETAS A REQUERIMIENTOS | PORCENTAJE APLICABLE (%) | REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS |      |  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------|--------|---------------------------------------------------------------------|--|--------|--|--------|--------|------------------|--|------|------|-------------------------------------|--------------------------|------------------------------------|------|--|
|                                                                                                                                             | LARGAS            | CORTAS | PRO-MEMORIA:<br>POSICIONES MERAMENTE DE FINANCIACIÓN DE EXISTENCIAS |  |        |  |        |        |                  |  |      |      |                                     |                          |                                    |      |  |
|                                                                                                                                             |                   |        | LARGAS                                                              |  | CORTAS |  | LARGAS | CORTAS |                  |  |      |      |                                     |                          |                                    |      |  |
|                                                                                                                                             | 1                 | 2      | 3                                                                   |  | 4      |  |        |        | 5                |  | 6    |      | 7                                   |                          | 8                                  |      |  |
| TOTAL POSICIONES EN MATERIAS PRIMAS                                                                                                         | 0001              |        | 0031                                                                |  | 0061   |  | 0091   |        | 0121             |  | 0151 |      | 0181                                |                          |                                    | 0211 |  |
| 1. SISTEMA DE ESCALA DE VENCIMIENTOS                                                                                                        | 0002              |        | 0032                                                                |  | 0062   |  | 0092   |        | 0122             |  | 0152 |      | 0182                                |                          |                                    | 0212 |  |
| 1.1 BANDA DE VENCIMIENTOS ≤ 1 AÑO                                                                                                           | 0003              |        | 0033                                                                |  | 0063   |  | 0093   |        | 0123             |  | 0153 |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 1.2 BANDA DE VENCIMIENTOS > 1 AÑO Y ≤ 3 AÑOS                                                                                                | 0004              |        | 0034                                                                |  | 0064   |  | 0094   |        | 0124             |  | 0154 |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 1.3 BANDA DE VENCIMIENTOS > 3 AÑOS                                                                                                          | 0005              |        | 0035                                                                |  | 0065   |  | 0095   |        | 0125             |  | 0155 |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 1.a POSICIONES COMPENSADAS DE CADA BANDA DE VENCIMIENTOS                                                                                    |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0186 |                                     | 1,50                     | 0216                               |      |  |
| 1.b POSICIONES COMPENSADAS ENTRE DOS BANDAS DE VENCIMIENTOS                                                                                 |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0187 |                                     | 0,60                     | 0217                               |      |  |
| 1.c POSICIONES RESIDUALES NO COMPENSADAS                                                                                                    |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0188 |                                     | 15,00                    | 0218                               |      |  |
| 2. SISTEMA DE ESCALA DE VENCIMIENTOS AMPLIADO                                                                                               | 0010              |        | 0040                                                                |  | 0070   |  | 0100   |        | 0130             |  | 0160 |      | 0190                                |                          |                                    | 0220 |  |
| 2.1 BANDA DE VENCIMIENTOS ≤ 1 AÑO                                                                                                           | 0011              |        | 0041                                                                |  | 0071   |  | 0101   |        | 0131             |  | 0161 |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 2.2 BANDA DE VENCIMIENTOS > 1 AÑO Y ≤ 3 AÑOS                                                                                                | 0012              |        | 0042                                                                |  | 0072   |  | 0102   |        | 0132             |  | 0162 |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 2.3 BANDA DE VENCIMIENTOS > 3 AÑOS                                                                                                          | 0013              |        | 0043                                                                |  | 0073   |  | 0103   |        | 0133             |  | 0163 |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 2.a POSICIONES COMPENSADAS DE CADA BANDA DE VENCIMIENTOS                                                                                    |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0194 |                                     |                          | 0224                               |      |  |
| 2.b POSICIONES COMPENSADAS ENTRE DOS BANDAS DE VENCIMIENTOS                                                                                 |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0195 |                                     |                          | 0225                               |      |  |
| 2.c POSICIONES RESIDUALES NO COMPENSADAS                                                                                                    |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0196 |                                     |                          | 0226                               |      |  |
| 3. MÉTODO SIMPLIFICADO: TOTAL POSICIONES                                                                                                    | 0020              |        | 0050                                                                |  | 0080   |  | 0110   |        | 0140             |  | 0170 |      | 0200                                |                          |                                    | 0230 |  |
| 3.a POSICIONES NETAS                                                                                                                        |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0201 |                                     | 15,00                    | 0231                               |      |  |
| 3.b POSICIONES BRUTAS                                                                                                                       |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0202 |                                     | 3,00                     | 0232                               |      |  |
| 4. MÉTODO BASADO EN LOS MÁRGENES DE GARANTÍA PARA LOS CONTRATOS DE FUTUROS Y OPCIONES NEGOCIABLES EN MERCADOS ORGANIZADOS <sup>(1)</sup>    |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 5. MÉTODO BASADO EN LOS MÁRGENES DE GARANTÍA PARA LOS CONTRATOS DE FUTUROS Y OPCIONES NO NEGOCIABLES EN MERCADOS ORGANIZADOS <sup>(1)</sup> |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      |      |                                     |                          |                                    |      |  |
| 6. OTROS RIESGOS INHERENTES A LAS OPCIONES SOBRE MATERIAS PRIMAS APARTE DEL RIESGO DE DELTA                                                 |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0207 |                                     |                          | 0237                               |      |  |
| 7. RIESGO DE ILIQUIDEZ                                                                                                                      |                   |        |                                                                     |  |        |  |        |        |                  |  |      | 0208 |                                     |                          | 0238                               |      |  |

<sup>(1)</sup> 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 entidad

3 Estado individual correspondiente a entidad que presenta sus recursos propios con instrumentales