

DETALLE DE DERIVADOS

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año			Mes				P	Estado			Código entidad			
							M	2	0	2	0			

(Miles de euros redondeados)

	DERIVADOS																			
	Riesgo de cambio				Riesgo de tipo de interés	Riesgo sobre acciones	Riesgo sobre metales preciosos	Riesgo sobre mercaderías	Riesgo de crédito	Otros riesgos	TOTAL	Pro-memoria: Operaciones de cobertura								
	Monedas		Oro																	
NOCIONALES	0001		0101		0201		0301		0401		0501		0601		0701		0801		0901	
MERCADOS ORGANIZADOS.....	0005		0105		0205		0305		0405		0505		0605		0705		0805		0905	
Futuros financieros	0010		0110		0210		0310		0410		0510		0610		0710		0810		0910	
Comprados.....	0011		0111		0211		0311		0411		0511		0611		0711		0811		0911	
Vendidos	0012		0112		0212		0312		0412		0512		0612		0712		0812		0912	
Opciones	0015		0115		0215		0315		0415		0515		0615		0715		0815		0915	
Compradas.....	0016		0116		0216		0316		0416		0516		0616		0716		0816		0916	
Vendidas.....	0017		0117		0217		0317		0417		0517		0617		0717		0817		0917	
Otros productos	0020		0120		0220		0320		0420		0520		0620		0720		0820		0920	
Comprados.....	0021		0121		0221		0321		0421		0521		0621		0721		0821		0921	
Vendidos	0022		0122		0222		0322		0422		0522		0622		0722		0822		0922	
<i>Pro-memoria:</i>																				
Operaciones de cobertura contable.....	0023		0123		0223		0323		0423		0523		0623		0723		0823			
MERCADOS NO ORGANIZADOS	0025		0125		0225		0325		0425		0525		0625		0725		0825		0925	
Clasificación por tipo de producto																				
Operaciones a plazo	0030		0130		0230		0330		0430		0530		0630		0730		0830		0930	
Compradas.....	0031		0131		0231		0331		0431		0531		0631		0731		0831		0931	
Ventas	0032		0132		0232		0332		0432		0532		0632		0732		0832		0932	
Compras de divisas contra divisas	0033		0133														0833		0933	
Acuerdos sobre tipos de interés futuro (FRA)					0235												0835		0935	
Permutas	0040		0140		0240		0340		0440		0540		0640		0740		0840		0940	
Opciones	0045		0145		0245		0345		0445		0545		0645		0745		0845		0945	
Compradas.....	0046		0146		0246		0346		0446		0546		0646		0746		0846		0946	
Vendidas.....	0047		0147		0247		0347		0447		0547		0647		0747		0847		0947	
Otros productos	0050		0150		0250		0350		0450		0550		0650		0750		0850		0950	
Comprados.....	0051		0151		0251		0351		0451		0551		0651		0751		0851		0951	
Vendidos	0052		0152		0252		0352		0452		0552		0652		0752		0852		0952	
<i>Pro-memoria:</i>																				
Operaciones de cobertura contable.....	0053		0153		0253		0353		0453		0553		0653		0753		0853			
Clasificación por contraparte																				
Entidades de crédito. Residentes.....	0055		0155		0255		0355		0455		0555		0655		0755		0855		0955	
Entidades de crédito. No residentes.....	0056		0156		0256		0356		0456		0556		0656		0756		0856		0956	
Otras entidades financieras. Residentes.....	0057		0157		0257		0357		0457		0557		0657		0757		0857		0957	
Otras entidades financieras. No residentes.....	0058		0158		0258		0358		0458		0558		0658		0758		0858		0958	
Resto de sectores. Residentes.....	0059		0159		0259		0359		0459		0559		0659		0759		0859		0959	
Resto de sectores. No residentes.....	0060		0160		0260		0360		0460		0560		0660		0760		0860		0960	
Clasificación por plazo remanente																				
Hasta 1 año.....	0065		0165		0265		0365		0465		0565		0665		0765		0865		0965	
Más de 1 año y hasta 5 años.....	0066		0166		0266		0366		0466		0566		0666		0766		0866		0966	
Más de 5 años	0067		0167		0267		0367		0467		0567		0667		0767		0867		0967	

DETALLE DE DERIVADOS

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año			Mes			P	Estado				Código entidad		
						M	2	0	2	0			

(Miles de euros redondeados)

	DERIVADOS													Pro-memoria: Operaciones de cobertura						
	Riesgo de cambio				Riesgo de tipo de interés	Riesgo sobre acciones	Riesgo sobre metales preciosos	Riesgo sobre mercaderías	Riesgo de crédito	Otros riesgos	TOTAL									
	Monedas		Oro																	
VALORES RAZONABLES																				
Valores positivos	0070		0170		0270		0370		0470		0570		0670		0770		0870		0970	
Mercados organizados	0071		0171		0271		0371		0471		0571		0671		0771		0871		0971	
Mercados no organizados	0072		0172		0272		0372		0472		0572		0672		0772		0872		0972	
Entidades de crédito	0073		0173		0273		0373		0473		0573		0673		0773		0873		0973	
Otras entidades financieras	0074		0174		0274		0374		0474		0574		0674		0774		0874		0974	
Resto de sectores	0075		0175		0275		0375		0475		0575		0675		0775		0875		0975	
<i>Pro-memoria:</i>																				
<i>Derivados de cobertura</i>	0076		0176		0276		0376		0476		0576		0676		0776		0876			
<i>Derivados de difícil valoración</i>	0077		0177		0277		0377		0477		0577		0677		0777		0877		0977	
Valores negativos	0085		0185		0285		0385		0485		0585		0685		0785		0885		0985	
Mercados organizados	0086		0186		0286		0386		0486		0586		0686		0786		0886		0986	
Mercados no organizados	0087		0187		0287		0387		0487		0587		0687		0787		0887		0987	
Entidades de crédito	0088		0188		0288		0388		0488		0588		0688		0788		0888		0988	
Otras entidades financieras	0089		0189		0289		0389		0489		0589		0689		0789		0889		0989	
Resto de sectores	0090		0190		0290		0390		0490		0590		0690		0790		0890		0990	
<i>Pro-memoria:</i>																				
<i>Derivados de cobertura</i>	0091		0191		0291		0391		0491		0591		0691		0791		0891			
<i>Derivados de difícil valoración</i>	0092		0192		0292		0392		0492		0592		0692		0792		0892		0992	

DETALLE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS HÍBRIDOS

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año			Mes			P	Estado			Código entidad			
						M	2	0	2	0			

(Miles de euros redondeados)

	DERIVADOS											
	Riesgo de cambio			Riesgo de tipo de interés	Riesgo sobre acciones	Riesgo sobre metales preciosos	Riesgo sobre mercaderías	Riesgo de crédito	Otros riesgos	TOTAL		
	Monedas	Oro										
ACTIVOS FINANCIEROS HÍBRIDOS												
Crédito	1000	1075	1150	1225	1300	1375	1450	1525	1600			
Entidades de crédito.....	1001	1076	1151	1226	1301	1376	1451	1526	1601			
Con capital garantizado.....	1002	1077	1152	1227	1302	1377	1452	1527	1602			
Resto.....	1003	1078	1153	1228	1303	1378	1453	1528	1603			
Otras entidades financieras.....	1004	1079	1154	1229	1304	1379	1454	1529	1604			
Con capital garantizado.....	1005	1080	1155	1230	1305	1380	1455	1530	1605			
Resto.....	1006	1081	1156	1231	1306	1381	1456	1531	1606			
Resto de sectores.....	1007	1082	1157	1232	1307	1382	1457	1532	1607			
Con capital garantizado.....	1008	1083	1158	1233	1308	1383	1458	1533	1608			
Resto.....	1009	1084	1159	1234	1309	1384	1459	1534	1609			
<i>Pro-memoria:</i>												
Con cobertura contable.....	1010	1085	1160	1235	1310	1385	1460	1535	1610			
Con derivados implícitos segregables.....	1011	1086	1161	1236	1311	1386	1461	1536	1611			
Valores representativos de deuda	1020	1095	1170	1245	1320	1395	1470	1545	1620			
Entidades de crédito.....	1021	1096	1171	1246	1321	1396	1471	1546	1621			
Con capital garantizado.....	1022	1097	1172	1247	1322	1397	1472	1547	1622			
Resto.....	1023	1098	1173	1248	1323	1398	1473	1548	1623			
Otras entidades financieras.....	1024	1099	1174	1249	1324	1399	1474	1549	1624			
Con capital garantizado.....	1025	1100	1175	1250	1325	1400	1475	1550	1625			
Resto.....	1026	1101	1176	1251	1326	1401	1476	1551	1626			
Resto de sectores.....	1027	1102	1177	1252	1327	1402	1477	1552	1627			
Con capital garantizado.....	1028	1103	1178	1253	1328	1403	1478	1553	1628			
Resto.....	1029	1104	1179	1254	1329	1404	1479	1554	1629			
<i>Pro-memoria:</i>												
Con cobertura contable.....	1031	1106	1181	1256	1331	1406	1481	1556	1631			
Con derivados implícitos segregables.....	1032	1107	1182	1257	1332	1407	1482	1557	1632			
PASIVOS FINANCIEROS HÍBRIDOS												
Depósitos	1040	1115	1190	1265	1340	1415	1490	1565	1640			
Entidades de crédito.....	1041	1116	1191	1266	1341	1416	1491	1566	1641			
Con capital garantizado.....	1042	1117	1192	1267	1342	1417	1492	1567	1642			
Resto.....	1043	1118	1193	1268	1343	1418	1493	1568	1643			
Otras entidades financieras.....	1044	1119	1194	1269	1344	1419	1494	1569	1644			
Con capital garantizado.....	1045	1120	1195	1270	1345	1420	1495	1570	1645			
Resto.....	1046	1121	1196	1271	1346	1421	1496	1571	1646			
Resto de sectores.....	1047	1122	1197	1272	1347	1422	1497	1572	1647			
Con capital garantizado.....	1048	1123	1198	1273	1348	1423	1498	1573	1648			
Resto.....	1049	1124	1199	1274	1349	1424	1499	1574	1649			
<i>Pro-memoria:</i>												
Con cobertura contable.....	1051	1126	1201	1276	1351	1426	1501	1576	1651			
Con derivados implícitos segregables.....	1052	1127	1202	1277	1352	1427	1502	1577	1652			
Débitos representados por valores negociables	1053	1128	1203	1278	1353	1428	1503	1578	1653			
<i>Pro-memoria:</i>												
Con cobertura contable.....	1054	1129	1204	1279	1354	1429	1504	1579	1654			
Con derivados implícitos segregables.....	1055	1130	1205	1280	1355	1430	1505	1580	1655			

DETALLE DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS HÍBRIDOS

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año			Mes			P	Estado				Código entidad		
						M	2	0	2	0			

(Miles de euros redondeados)

	DERIVADOS																	
	Riesgo de cambio				Riesgo de tipo de interés	Riesgo sobre acciones	Riesgo sobre metales preciosos	Riesgo sobre mercaderías	Riesgo de crédito	Otros riesgos	TOTAL							
	Monedas		Oro															
DERIVADOS IMPLÍCITOS SEGREGABLES																		
VALORES RAZONABLES																		
ACTIVOS.....	1700		1750		1800		1850		1900		1950		2000		2050		2100	
Crédito.....	1701		1751		1801		1851		1901		1951		2001		2051		2101	
Entidades de crédito.....	1702		1752		1802		1852		1902		1952		2002		2052		2102	
▪ Valores positivos.....	1703		1753		1803		1853		1903		1953		2003		2053		2103	
▪ Valores negativos.....	1704		1754		1804		1854		1904		1954		2004		2054		2104	
Otras entidades financieras.....	1705		1755		1805		1855		1905		1955		2005		2055		2105	
▪ Valores positivos.....	1706		1756		1806		1856		1906		1956		2006		2056		2106	
▪ Valores negativos.....	1707		1757		1807		1857		1907		1957		2007		2057		2107	
Resto de sectores.....	1708		1758		1808		1858		1908		1958		2008		2058		2108	
▪ Valores positivos.....	1709		1759		1809		1859		1909		1959		2009		2059		2109	
▪ Valores negativos.....	1710		1760		1810		1860		1910		1960		2010		2060		2110	
Valores representativos de deuda.....	1715		1765		1815		1865		1915		1965		2015		2065		2115	
Entidades de crédito.....	1716		1766		1816		1866		1916		1966		2016		2066		2116	
▪ Valores positivos.....	1717		1767		1817		1867		1917		1967		2017		2067		2117	
▪ Valores negativos.....	1718		1768		1818		1868		1918		1968		2018		2068		2118	
Otras entidades financieras.....	1719		1769		1819		1869		1919		1969		2019		2069		2119	
▪ Valores positivos.....	1720		1770		1820		1870		1920		1970		2020		2070		2120	
▪ Valores negativos.....	1721		1771		1821		1871		1921		1971		2021		2071		2121	
Resto de sectores.....	1722		1772		1822		1872		1922		1972		2022		2072		2122	
▪ Valores positivos.....	1723		1773		1823		1873		1923		1973		2023		2073		2123	
▪ Valores negativos.....	1724		1774		1824		1874		1924		1974		2024		2074		2124	
PASIVOS.....	1730		1780		1830		1880		1930		1980		2030		2080		2130	
Depósitos.....	1731		1781		1831		1881		1931		1981		2031		2081		2131	
Entidades de crédito.....	1732		1782		1832		1882		1932		1982		2032		2082		2132	
▪ Valores positivos.....	1733		1783		1833		1883		1933		1983		2033		2083		2133	
▪ Valores negativos.....	1734		1784		1834		1884		1934		1984		2034		2084		2134	
Otras entidades financieras.....	1735		1785		1835		1885		1935		1985		2035		2085		2135	
▪ Valores positivos.....	1736		1786		1836		1886		1936		1986		2036		2086		2136	
▪ Valores negativos.....	1737		1787		1837		1887		1937		1987		2037		2087		2137	
Resto de sectores.....	1738		1788		1838		1888		1938		1988		2038		2088		2138	
▪ Valores positivos.....	1739		1789		1839		1889		1939		1989		2039		2089		2139	
▪ Valores negativos.....	1740		1790		1840		1890		1940		1990		2040		2090		2140	
Débitos representados por valores negociables.....	1745		1795		1845		1895		1945		1995		2045		2095		2145	
▪ Valores positivos.....	1746		1796		1846		1896		1946		1996		2046		2096		2146	
▪ Valores negativos.....	1747		1797		1847		1897		1947		1997		2047		2097		2147	

OPERACIONES A PLAZO. DETALLE POR SUJETOS Y MONEDAS (a)

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año				Mes			P	Estado				Código entidad		
							M	2	0	2	0			

(Miles de euros redondeados)

Moneda	COMPRADO								VENDIDO								TOTAL			
	Residentes				No residentes				Residentes				No residentes							
	Entidades de crédito		Resto		Entidades de crédito		Resto		Entidades de crédito		Resto		Entidades de crédito		Resto		Comprado	Vendido		
Euros	2201		2211		2221		2231		2241		2251		2261		2271		2281		2291	
Dólares USA	2202		2212		2222		2232		2242		2252		2262		2272		2282		2292	
Francos suizos	2203		2213		2223		2233		2243		2253		2263		2273		2283		2293	
Libras esterlinas	2204		2214		2224		2234		2244		2254		2264		2274		2284		2294	
Yenes	2205		2215		2225		2235		2245		2255		2265		2275		2285		2295	
Resto	2206		2216		2226		2236		2246		2256		2266		2276		2286		2296	
CONTRAVALOR TOTAL.....	2210		2220		2230		2240		2250		2260		2270		2280		2290		2300	

(a) Importes brutos, no compensados, expresados por su contravalor en miles de euros.

OPCIONES SOBRE DIVISAS
Valor de los elementos subyacentes

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año				Mes			P	Estado				Código entidad			
							M	2	0	2	0				

(Miles de euros redondeados)

	Opciones emitidas				Opciones compradas			
	De venta		De compra		De compra		De venta	
Contravalor total (a).....	2301		2311		2321		2331	
Del que:								
Dólar USA.....	2302		2312		2322		2332	
Yen japonés	2303		2313		2323		2333	
Libra esterlina	2304		2314		2324		2334	

(a) Contravalor en miles de euros