

RIESGO DE LIQUIDEZ CONTINGENTE

Estas relaciones se cumplirán para cada Tipo de Identificador.

LQ.5.1. COMPROMISOS Y DISPONIBLES (Sección 8051)

1. Sumas horizontales:

No existen

2. Sumas verticales:

$$0001 = 0002 + 0003 + 0004 + 0005 + 0006$$

$$0006 = 0007 + 0008 + 0009 + 0010$$

$$0020 = 0001 + 0015$$

$$0056 = 0057 + 0058 + 0059 + 0060$$

...

...

$$0306 = 0307 + 0308 + 0309 + 0310$$

3. Otras relaciones internas:

$$0006 \geq 0056 + 0106 + 0156 + 0206 + 0256 + 0306$$

...

...

$$0010 \geq 0060 + 0110 + 0160 + 0210 + 0260 + 0310$$

4. Relaciones con otros estados:

No existen.

LQ.5.2. FINANCIACIONES RECIBIDAS Y OTRAS OPERACIONES CON PENALIZACIÓN EN FUNCIÓN DE LA CALIFICACIÓN CREDITICIA DE LA ENTIDAD (Sección 8052)

1. Sumas horizontales:

Para cada fila se cumplirá que:

$$\text{Columna 3} = \text{Columna 4} + \text{Columna 5} + \text{Columna 6} + \text{Columna 7}$$

RIESGO DE LIQUIDEZ CONTINGENTE

2. Sumas verticales:

No existen.

3. Otras relaciones internas:

Para cada fila debe existir obligatoriamente dato en las columnas 1 y 3 y al menos en una de las columnas 4, 5, 6 y 7.

4. Relaciones con otros estados:

No existen.

LQ.5.3. FINANCIACIONES RECIBIDAS Y OTRAS OPERACIONES CON PENALIZACIÓN EN FUNCIÓN DE OTROS FACTORES (Sección 8053)

1. Sumas horizontales:

Para cada fila se cumplirá que:

Columna 3 = Columna 5 + Columna 6

2. Sumas verticales:

No existen.

3. Otras relaciones internas:

Para cada fila debe existir obligatoriamente dato en las columnas 1, 2, 3, y 4 y al menos en una de las columnas 5, y 6.

4. Relaciones con otros estados:

No existen.

LQ.5.4. VALORACIÓN DE DERIVADOS CON EXIGENCIAS DE MÁRGENES O COLATERAL (Sección 8054)

1. Sumas horizontales:

No existen.

RIESGO DE LIQUIDEZ CONTINGENTE

2. Sumas verticales:

No existen.

3. Otras relaciones internas:

Las siguientes claves serán mayores o iguales que cero: 0350, 0400, 0450, 0550, 0355, 0405, 0455, 0555, 0510 y 0515.

Las siguientes claves serán menores o iguales que cero: 0500, 0505, 0360, 0410, 0460, 0560, 0365, 0415, 0465, y 0565.

4. Relaciones con otros estados:

No existen.

LQ.5.5. VALORACIÓN DE FINANCIACIONES RECIBIDAS Y ENTREGADAS CON EXIGENCIAS DE MÁRGENES O COLATERAL (Sección 8055)

1. Sumas horizontales:

No existen.

2. Sumas verticales:

No existen.

3. Otras relaciones internas:

Podrán presentar importe positivo, negativo o cero todas las claves del estado, salvo:

Las claves 0600 y 0605 que presentarán obligatoriamente signo negativo.

Las claves 0610 y 0615 que presentarán obligatoriamente signo positivo.

Debe existir importe en al menos una de las claves 0600 a 0615.

Si existe importe en la clave 0600 debe existir importe en las siguientes claves: 0650, 0700 o 0750.

Si existe importe en la clave 0605 debe existir importe en las siguientes claves: 0655, 0705 o 0755.

Si existe importe en la clave 0610 debe existir importe en las siguientes claves: 0660, 0710 o 0770.

Si existe importe en la clave 0615 debe existir importe en las siguientes claves: 0665, 0715 o 0765.

LQ5	Pág. 4 de 4
DICIEMBRE 2011	

RIESGO DE LIQUIDEZ CONTINGENTE

(presentación mensual)

4. Relaciones con otros estados:

No existen.