

RIESGO DE LIQUIDEZ CONTINGENTE
Correspondiente al ____ de ____ de ____

ENTIDAD _____

Año			Mes		P	Estado			Código entidad			Tipo identificador (*)
					M							

LQ5.1. COMPROMISOS Y DISPONIBLES

Importes en miles de euros

Sección 1 (8051)

	Saldo TOTAL	Hasta una semana	Más de una semana y hasta un mes	Más de un mes y hasta dos meses	Más de dos meses y hasta tres meses	Más de tres meses y hasta seis meses	Más de seis meses y hasta un año
1 Compromisos y disponibles irrevocables.....	0001						
1.1 Disponibles por fondos de titulización y otros vehículos.....	0002						
1.2 Aseguramiento de emisiones y líneas de apoyo a pagarés de empresa o similares.....	0003						
1.3 Disponibles por entidades de crédito y otras instituciones financieras.....	0004						
1.4 Disponibles por grandes empresas no financieras.....	0005						
1.5 Disponibles por otros clientes	0006	0056	0106	0156	0206	0256	0306
1.5.1 Por tarjetas de crédito.....	0007	0057	0107	0157	0207	0257	0307
1.5.2 Por cuentas de crédito.....	0008	0058	0108	0158	0208	0258	0308
1.5.3 Préstamos hipotecarios a promotor.....	0009	0059	0109	0159	0209	0259	0309
1.5.4 Otros	0010	0060	0110	0160	0210	0260	0310
2 Contingentes no contractuales.....	0015						
TOTAL.....	0020						

LQ5.2. FINANCIACIONES RECIBIDAS Y OTRAS OPERACIONES CON PENALIZACIÓN EN FUNCIÓN DE LA CALIFICACIÓN CREDITICIA DE LA ENTIDAD

Sección 2 (8052)

Naturaleza del contrato (1)	Denominación contraparte (2)	Saldo (3)	Impacto de la caída de la calificación crediticia			Operaciones con cláusula ya vencida (7)
			Un escalón (notch) (4)	Dos escalones (notches) (5)	Tres escalones (notches) (6)	

LQ5.3. FINANCIACIONES RECIBIDAS Y OTRAS OPERACIONES CON PENALIZACIÓN EN FUNCIÓN DE OTROS FACTORES

Sección 3 (8053)

Naturaleza del contrato (1)	Denominación contraparte (2)	Saldo (3)	Cláusula (4)	Impacto (5)	Operaciones con cláusula ya vencida (6)

LQ5.4. VALORACIÓN DE DERIVADOS CON EXIGENCIAS DE MÁRGENES O COLATERAL

Sección 4 (8054)

	Garantías aportadas/recibidas			Valor razonable del derivado		Colateral inicial aportado/recibido	
	Efectivo	Deuda pública	Resto de valores				
1 Derivados contratados en mercados no organizados con garantías aportadas.....	0350	0400	0450	0500	0550		
2 Derivados contratados en mercados organizados con garantías aportadas.....	0355	0405	0455	0505	0555		
3 Derivados contratados en mercados no organizados con garantías recibidas.....	0360	0410	0460	0510	0560		
4 Derivados contratados en mercados organizados con garantías recibidas.....	0365	0415	0465	0515	0565		

LQ5.5. VALORACIÓN DE FINANCIACIONES RECIBIDAS Y ENTREGADAS CON EXIGENCIAS DE MÁRGENES O COLATERAL

Sección 5 (8055)

	Efectivo entregado/recibido	Garantías aportadas/recibidas		
		Efectivo	Deuda pública	Resto de valores
1 Financiaciones recibidas con garantías, contratadas en mercados no organizados	0600	0650	0700	0750
2 Financiaciones recibidas con garantías, contratadas en mercados organizados	0605	0655	0705	0755
3 Financiaciones entregadas con garantías, contratadas en mercados no organizados	0610	0660	0710	0760
4 Financiaciones entregadas con garantías, contratadas en mercados organizados	0615	0665	0715	0765

(*) Se consignarán:

- 0 Estado correspondiente a grupo consolidado
- 1 Estado correspondiente a subgrupo consolidado
- 2 Estado individual correspondiente a entidad