

**Requerimientos de recursos propios por riesgo de crédito
para exposiciones de renta variable. Método basado en
calificaciones internas**

Este estado será semestral para las "Entidades" y anual para las entidades de crédito españolas integradas en una "Entidad" que estén sujetas a nivel individual o subconsolidado a los requerimientos de recursos propios establecidos en el Capítulo Segundo, tal y como indica la Norma Centésima Vigésima Segunda de la CBE 3/2008.

1. Sumas horizontales:

0095 = 0020 + 0065 + 0080
0100 = 0025 + 0070 + 0085
0101 = 0026 + 0071 + 0086
0102 = 0027 + 0072 + 0087
0103 = 0028 + 0073 + 0088

0125 = 0095 - 0110 + 0140

.....

.....

0133 = 0103 - 0118 + 0148

2. Sumas verticales:

0016 = 0020 + 0025 + 0030
0166 = 0170 + 0175 + 0180
0181 = 0185 + 0190 + 0195
0211 = 0215 + 0220 + 0225

0025 = 0026 + 0027 + 0028

.....

.....

0220 = 0221 + 0222 + 0223

3. Otras relaciones internas:

Las claves 0065 a 0073 y 0211 a 0225 deberán ser menores o iguales a cero.

0016 ≠ 0

Si la clave 0095 es igual a cero las claves 0005 y 0155 deben ser igual a cero.

0176 = 190% x 0131
0177 = 290% x 0132
0178 = 370% x 0133

0181 = 8% x 0166
0185 = 8% x 0170

**Requerimientos de recursos propios por riesgo de crédito
para exposiciones de renta variable. Método basado en
calificaciones internas**

ESTADO RP23	Pág. 2 de 2
DICIEMBRE 2012	

(presentación semestral)

$$0190 = 8\% \times 0175$$

$$0191 = 8\% \times 0176$$

$$0192 = 8\% \times 0177$$

$$0193 = 8\% \times 0178$$

$$0195 = 8\% \times 0180$$

$$|0065| \leq 0035 + 0050$$

$$|0070| \leq 0040 + 0055$$

$$|0071| \leq 0041 + 0056$$

$$|0072| \leq 0042 + 0057$$

$$|0073| \leq 0043 + 0058$$

$$0110 \leq 0095$$

$$0115 \leq 0100$$

$$0116 \leq 0101$$

$$0117 \leq 0102$$

$$0118 \leq 0103$$

$$0140 \leq 0125$$

$$0145 \leq 0130$$

$$0146 \leq 0131$$

$$0147 \leq 0132$$

$$0148 \leq 0133$$

Si la clave 0030 es distinta de cero la 0180 debe ser distinta de cero y viceversa.

Si la clave 0016 es distinta de cero la 0166 debe ser distinta de cero y viceversa.

Solo podrán tener importe en las claves 0005, 0020, 0035, 0050, 0065, 0080, 0095, 0110, 0125, 0140, 0155, 0170, 0185, 0200 y 0215 aquellas declaraciones de entidades autorizadas a la utilización del Método PD/LGD.

Solo podrán tener importe en las claves 0025, 0040, 0035, 0050, 0085, 0100, 0115, 0130, 0145, 0175, 0190, 0205 y 0220 aquellas declaraciones de entidades autorizadas a la utilización del Método Simple de Ponderación de Riesgo.

Solo podrán tener importe en las claves 0030, 0180, 0195 y 0225 aquellas declaraciones de entidades autorizadas a la utilización del Método de Modelos Internos.

Solo existirá estado 3023 para aquellas entidades estén autorizadas a la utilización de modelos por riesgo de crédito para la cartera de renta variable

4. Relaciones con otros estados

$$0181 = 0262 \text{ (RP10)}$$