

REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS POR RIESGOS DE PRECIO Y DE TIPO DE CAMBIO. MODELOS INTERNOS

Correspondiente al ____ de _____ de _____

ENTIDAD: _____

| | | | | | |
|-----|-----|---|--------|----------------|------------------------|
| Año | Mes | P | Estado | Código entidad | Tipo identificador (*) |
| | | | E | 3035 | |

| | VaR | | SvAR | | EXIGENCIA POR RIESGOS DE IMPAGO Y DE MIGRACIÓN INCREMENTALES | | EXIGENCIA DE TODOS LOS RIESGOS DE PRECIO (CARTERA DE NEG. DE CORRELACIÓN) | | | | REQUERIMIENTOS DE RECURSOS PROPIOS | PRO MEMORIA: | | |
|---|--|--|--|--|--|-------------------------|---|-------------------------------------|-------------------------|---|------------------------------------|--|---|--|
| | FACTOR INCREMENTADO (m _t) x MEDIA DEL VaR DE LOS 60 DÍAS HÁBILES PRECEDENTES (VaR _{60d}) | VaR DEL DÍA ANTERIOR (VaR _{t-1}) | FACTOR INCREMENTADO (m _t) x MEDIA DEL SvAR DE LOS 60 DÍAS HÁBILES PRECEDENTES (SvAR _{60d}) | SvAR DEL DÍA ANTERIOR (SvAR _{t-1}) | VALORACIÓN MEDIA DURANTE 12 SEMANAS | VALORACIÓN MÁS RECIENTE | SUELO | VALORACIÓN MEDIA DURANTE 12 SEMANAS | VALORACIÓN MÁS RECIENTE | EXIGENCIA DE CAPITAL SUPLEMENTARIA (STRESS TESTING) | | NÚMERO DE EXCESOS DURANTE LOS ÚLTIMOS 250 DÍAS HÁBILES | VaR FACTOR INCREMENTADO (m _t) | SvAR FACTOR INCREMENTADO (m _t) |
| | 1 | 2 | 8 | 9 | 10 | 11 | 12 | 13 | 14 | 15 | | 5 | 6 | 7 |
| TOTAL POSICIONES | 0001 | 0021 | 0141 | 0161 | 0181 | 0201 | 0221 | 0241 | 0261 | 0281 | 0081 | 0101 | 0121 | 0301 |
| PRO MEMORIA: DESGLOSE DEL RIESGO DE MERCADO | | | | | | | | | | | | | | |
| 1 RIESGO DE TIPO DE INTERÉS | 0006 | 0025 | 0146 | 0166 | | | | | | | | | | |
| 1.1 RIESGO GENERAL | 0006 | 0026 | 0146 | 0166 | | | | | | | | | | |
| 1.2 RIESGO ESPECÍFICO | 0007 | 0027 | 0147 | 0167 | | | | | | | | | | |
| 2 RIESGO SOBRE ACCIONES | 0010 | 0030 | 0150 | 0170 | | | | | | | | | | |
| 2.1 RIESGO GENERAL | 0011 | 0031 | 0151 | 0171 | | | | | | | | | | |
| 2.2 RIESGO ESPECÍFICO | 0012 | 0032 | 0152 | 0172 | | | | | | | | | | |
| 3 RIESGO DE TIPO DE CAMBIO | 0015 | 0035 | 0155 | 0175 | | | | | | | | | | |
| 4 RIESGO DE MATERIAS PRIMAS | 0016 | 0036 | 0156 | 0176 | | | | | | | | | | |
| 5 OTROS RIESGOS | 0017 | 0037 | 0157 | 0177 | | | | | | | | | | |
| 6 VOLATILIDAD (a) | 0018 | 0038 | 0158 | 0178 | | | | | | | | | | |
| 7 AJUSTE POR CORRELACIÓN ENTRE FACTORES | 0019 | 0039 | 0159 | 0179 | | | | | | | | | | |

(a) No se rellenará si se ha incorporado en los otros factores de riesgo.

(*) 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 una entidad que presenta sus recursos propios con instrumentales