

DETALLE DE DERIVADOS

Correspondiente al \_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

ENTIDAD \_\_\_\_\_

Año	Mes			P	Estado	Código entidad
				M	2 0 2 0	

(Miles de euros redondeados)

	DERIVADOS														TOTAL	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						
	Monedas		Oro													
	0001	0101	0201	0301	0401	0501	0601	0701	0801	0901						
<b>NOCIONALES.....</b>	0001	0101	0201	0301	0401	0501	0601	0701	0801	0901						
<b>MERCADOS ORGANIZADOS.....</b>	0005	0105	0205	0305	0405	0505	0605	0705	0805	0905						
<b>Futuros financieros.....</b>	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						
<b>Opciones.....</b>	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						
<b>Otros productos.....</b>	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>Promemoria:</i>																
Operaciones de cobertura contable.....	0023	0123	0223	0323	0423	0523	0623	0723	0823	0923						
<b>MERCADOS NO ORGANIZADOS.....</b>	0025	0125	0225	0325	0425	0525	0625	0725	0825	0925						
<b>Clasificación por tipo de producto</b>																
<b>Operaciones a plazo.....</b>	0030	0130	0230	0330	0430	0530	0630	0730	0830	0930						
Comprados.....	0031	0131	0231	0331	0431	0531	0631	0731	0831	0931						
Vendidos.....	0032	0132	0232	0332	0432	0532	0632	0732	0832	0932						
Compras de divisas contra divisas.....	0033	0133							0833	0933						
<b>Acuerdos sobre tipo de interés futuro (FRA).....</b>			0235						0835	0935						
<b>Permutas.....</b>	0040	0140	0240	0340	0440	0540	0640	0740	0840	0940						
<b>Opciones.....</b>	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						
<b>Otros productos.....</b>	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>Promemoria:</i>																
Operaciones de cobertura contable.....	0053	0153	0253	0353	0453	0553	0653	0753	0853	0953						
<b>Clasificación por contraparte</b>																
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						
<b>Clasificación por plazo remanente</b>																
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																	
<b>VALORES RAZONABLES.....</b>																				
<b>Valores positivos.....</b>	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>Promemoria:</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	
<b>Valores negativos.....</b>	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>Promemoria:</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	

DICIEMBRE-2008

En la confección de los estados sobre operativa con derivados, se entiende por "mercados organizados", aquellos en los que teniendo establecido un sistema de depósitos en garantía actualizables diariamente en función de cotizaciones registradas, exista un centro de compensación que organice la cotización y negociación del mercado, registre sus operaciones y se interponga entre las partes actuando como comprador ante el vendedor y como vendedor ante el comprador.

DETALLE DE INSTRUMENTOS DE FINANCIEROS HÍBRIDOS

Correspondiente al \_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

ENTIDAD \_\_\_\_\_

Año		Mes		P		Estado		Código entidad		
						M	2	0	2	0

(Miles de euros redondeados)

	DERIVADOS													TOTAL		
	Riesgo de cambio				Riesgo de tipo de interés	Riesgo sobre acciones	Riesgo sobre metales preciosos		Riesgo sobre mercaderías		Riesgo de crédito	Otros riesgos				
	Monedas		Oro													
<b>ACTIVOS FINANCIEROS HÍBRIDOS</b>																
<b>Crédito</b>	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 segregados	1012		1087		1162		1237		1312		1387		1462		1537	1612
<b>Valores representativos de deuda</b>	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 segregados	1033		1108		1183		1258		1333		1408		1483		1558	1633
<b>PASIVOS FINANCIEROS HÍBRIDOS</b>																
<b>Depósitos</b>	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 segregados	1050		1125		1200		1275		1350		1425		1500		1575	1650
<b>Débitos representados por valores negociables</b>	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 segregados	1056		1131		1206		1281		1356		1431		1506		1581	1656

DETALLE DE INSTRUMENTOS DE 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												
<b>DERIVADOS IMPLÍCITOS SEGREGADOS</b>															
<b>VALORES RAZONABLES</b>															
<b>ACTIVOS.....</b>	1700		1750		1800		1850		1900		1950		2000	2050	2100
<b>Crédito.....</b>	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
<b>Valores representativos de deuda.....</b>	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
<b>PASIVOS.....</b>	1730		1780		1830		1880		1930		1980		2030	2080	2130
<b>Depósitos.....</b>	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
<b>Débitos representados por valores negociables.....</b>	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			Comprado	Vendido						
	Entidades de crédito	Resto		Entidades de crédito	Resto		Entidades de crédito	Resto		Entidades de crédito	Resto									
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	
<b>CONTRAVALOR TOTAL.....</b>	2210		2220		2230		2240		2250		2260		2270		2280		2290		2300	

JUNIO-2005

(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		

	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	

JUNIO-2005

(a) Contravalor en miles de euros