

DETALLE DE DERIVADOS

Correspondiente al ___ de _____ de _____

ENTIDAD _____

Año	Mes		P	Estado	Código entidad
			T	6 0 0 4	

(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	Pro-memoria: Operaciones de cobertura
	Monedas	Oro														
NOCIONALES.....	0001	0101	0201	0301	0401	0501	0601	0701	0801	0901						
MERCADOS ORGANIZADOS.....	0005	0105	0205	0305	0405	0505	0605	0705	0805	0905						
Futuros financieros.....	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						
Opciones.....	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						
Otros productos.....	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>Pro-memoria:</i>																
<i>Operaciones de cobertura contable.....</i>	0023	0123	0223	0323	0423	0523	0623	0723	0823	0923						
MERCADOS NO ORGANIZADOS.....	0025	0125	0225	0325	0425	0525	0625	0725	0825	0925						
Clasificación por tipo de producto																
Operaciones a plazo.....	0030	0130	0230	0330	0430	0530	0630	0730	0830	0930						
Compradas.....	0031	0131	0231	0331	0431	0531	0631	0731	0831	0931						
Ventas.....	0032	0132	0232	0332	0432	0532	0632	0732	0832	0932						
Compras de divisas contra divisas.....	0033	0133							0833	0933						
Acuerdos sobre tipo de interés futuro (FRA).....			0235						0835	0935						
Permutas.....	0040	0140	0240	0340	0440	0540	0640	0740	0840	0940						
Opciones.....	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						
Otros productos.....	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>Pro-memoria:</i>																
<i>Operaciones de cobertura contable.....</i>	0053	0153	0253	0353	0453	0553	0653	0753	0853	0953						
Clasificación por contraparte																
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						
Clasificación por plazo remanente																
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
			T	6 0 0 4	

(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	Pro-memoria: Operaciones de cobertura						
	Monedas	Oro														
VALORES RAZONABLES.....																
Valores positivos.....	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>Pro-memoria:</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						
Valores negativos.....	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>Pro-memoria:</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						

DETALLE DE INSTRUMENTOS DE FINANCIEROS HÍBRIDOS

Correspondiente al de de

ENTIDAD

Año	Mes		P	Estado	Código entidad
			T	6 0 0 4	

(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										
ACTIVOS FINANCIEROS HÍBRIDOS												
Crédito.....	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			
Valores representativos de deuda.....	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			
PASIVOS FINANCIEROS HÍBRIDOS												
Depósitos.....	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			
Débitos representados por valores negociables.....	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
			T	6 0 0 4	

(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										
DERIVADOS IMPLÍCITOS SEGREGADOS												
VALORES RAZONABLES												
ACTIVOS.....	1700	1750	1800	1850	1900	1950	2000	2050	2100			
Crédito.....	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			
Valores representativos de deuda.....	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			
PASIVOS.....	1730	1780	1830	1880	1930	1980	2030	2080	2130			
Depósitos.....	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			
Débitos representados por valores negociables.....	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			