

ES

ANEXO I

PLANTILLAS COMUNICACIÓN DE INFORMACIÓN SOBRE LOS FONDOS PROPIOS Y LOS REQUISITOS DE FONDOS PROPIOS					
Número de la plantilla	Código de plantilla		Nombre de la plantilla	Nombre abreviado	Frecuencia
			FRECUENCIA TRIMESTRAL/SEMESTRAL ⁽¹⁾		
			ADECUACIÓN DEL CAPITAL	CA	
1	C 01.00	3201	FONDOS PROPIOS	CA1	Trimestral
2	C 02.00	3202	REQUISITOS DE FONDOS PROPIOS	CA2	Trimestral
3	C 03.00	3203	RATIOS DE CAPITAL	CA3	Trimestral
4	C 04.00	3204	PARTIDAS PRO MEMORIA	CA4	Trimestral
			DISPOSICIONES TRANSITORIAS	CA5	
5.1	C 05.01	3251	DISPOSICIONES TRANSITORIAS	CA5.1	Trimestral
5.2	C 05.02	3252	INSTRUMENTOS EN RÉGIMEN DE ANTERIORIDAD: INSTRUMENTOS QUE NO CONSTITUYEN AYUDAS ESTATALES	CA5.2	Trimestral
			SOLVENCIA DEL GRUPO	GS	
6.1	C 06.01	3208	SOLVENCIA DEL GRUPO: INFORMACIÓN SOBRE FILIALES - TOTAL	GS Total	Semestral
6.2	C 06.02	3209	SOLVENCIA DEL GRUPO: INFORMACIÓN SOBRE FILIALES	GS	Semestral
			RIESGO DE CRÉDITO	CR	
7	C 07.00	3207	RIESGO DE CRÉDITO Y DE CONTRAPARTE Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO ESTÁNDAR PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL	CR SA	Trimestral
				CR IRB	Trimestral
8.1	C 08.01	3281	RIESGO DE CRÉDITO Y DE CONTRAPARTE Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL	CR IRB 1	Trimestral
8.2	C 08.02	3282	RIESGO DE CRÉDITO Y DE CONTRAPARTE Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL (desglose por conjuntos o grados de deudores)	CR IRB 2	Trimestral
			DESGLASE GEOGRÁFICO	CR GB	
9.1	C 09.01	3291	Cuadro 9.1 - Desglose geográfico de las exposiciones por residencia del deudor (exposición según el método estándar)	CR GB 1	Trimestral
9.2	C 09.02	3292	Cuadro 9.2 - Desglose geográfico de las exposiciones por residencia del deudor (exposición según el método IRB)	CR GB 2	Trimestral
9.4	C 09.04	3294	Cuadro 9.4 - Desglose de las exposiciones crediticias pertinentes para el cálculo del colchón anticíclico por país y el porcentaje del colchón anticíclico específico de cada entidad	CCB	Trimestral
			RIESGO DE CRÉDITO: RENTA VARIABLE - MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL	CR EQU IRB	
10.1	C 10.01	3261	RIESGO DE CRÉDITO: RENTA VARIABLE - MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL	CR EQU IRB 1	Trimestral
10.2	C 10.02	3262	RIESGO DE CRÉDITO: RENTA VARIABLE - MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL. DESGLOSE DEL TOTAL DE EXPOSICIONES CON ARREGLO AL MÉTODO PD/LGD POR GRADOS DE DEUDORES	CR EQU IRB 2	Trimestral
11	C 11.00	3211	RIESGO DE LIQUIDACIÓN/ENTREGA	CR SETT	Trimestral
12	C 12.00	3212	RIESGO DE CRÉDITO: TITULIZACIONES - MÉTODO ESTÁNDAR PARA LOS REQUISITOS DE FONDOS PROPIOS	CR SEC SA	Trimestral
13	C 13.00	3213	RIESGO DE CRÉDITO: TITULIZACIONES - MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE FONDOS PROPIOS	CR SEC IRB	Trimestral
14	C 14.00	3214	INFORMACIÓN DETALLADA SOBRE TITULIZACIONES	CR SEC Details	Semestral
			RIESGO OPERATIVO	OPR	
16	C 16.00	3216	RIESGO OPERATIVO	OPR	Trimestral
17.01	C 17.01	3217	RIESGO OPERATIVO: PÉRDIDAS Y RECUPERACIONES POR LÍNEAS DE NEGOCIO Y TIPOS DE EVENTOS EN EL ÚLTIMO AÑO	OPR Details 1	Semestral
17.02	C 17.02	3217	RIESGO OPERATIVO: EVENTOS DE PÉRDIDA IMPORTANTE	OPR Details 2	Semestral
			RIESGO DE MERCADO	MKR	
18	C 18.00	3218	RIESGO DE MERCADO: MÉTODO ESTÁNDAR PARA LOS RIESGOS DE POSICIÓN EN INSTRUMENTOS DE DEUDA NEGOCIABLES	MKR SA TDI	Trimestral
19	C 19.00	3219	RIESGO DE MERCADO: MÉTODO ESTÁNDAR PARA EL RIESGO ESPECÍFICO EN TITULIZACIONES	MKR SA SEC	Trimestral
20	C 20.00	3220	RIESGO DE MERCADO: MÉTODO ESTÁNDAR PARA EL RIESGO ESPECÍFICO EN LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN DE CORRELACIÓN	MKR SA CTP	Trimestral
21	C 21.00	3221	RIESGO DE MERCADO: MÉTODO ESTÁNDAR PARA EL RIESGO DE POSICIÓN EN INSTRUMENTOS DE PATRIMONIO	MKR SA EQU	Trimestral
22	C 22.00	3222	RIESGO DE MERCADO: MÉTODOS ESTÁNDAR PARA EL RIESGO DE TIPO DE CAMBIO	MKR SA FX	Trimestral
23	C 23.00	3223	RIESGO DE MERCADO: MÉTODOS ESTÁNDAR PARA MATERIAS PRIMAS	MKR SA COM	Trimestral
24	C 24.00	3224	MODELOS INTERNOS DEL RIESGO DE MERCADO	MKR IM	Trimestral
25	C 25.00	3225	RIESGO DE AJUSTE DE VALORACIÓN DEL CRÉDITO	CVA	Trimestral
			VALORACIÓN PRUDENTE	PRUVAL	
32.1	C 32.1	3521	VALORACIÓN PRUDENTE: ACTIVOS Y PASIVOS A VALOR RAZONABLE	PRUVAL 1	Trimestral
32.2	C 32.2	3522	VALORACIÓN PRUDENTE: ENFOQUE PRINCIPAL	PRUVAL 2	Trimestral
32.3	C 32.3	3523	VALORACIÓN PRUDENTE: AVA POR RIESGO DE MODELO	PRUVAL 3	Trimestral
32.4	C 32.4	3524	VALORACIÓN PRUDENTE: AVA POR POSICIONES CONCENTRADAS	PRUVAL 4	Trimestral
			EXPOSICIONES FRENTE A ADMINISTRACIONES PÚBLICAS	GOV	
33	C 33.00	3233	EXPOSICIONES FRENTE A ADMINISTRACIONES PÚBLICAS POR PAÍS DE LA CONTRAPARTE	GOV	Semestral

(1) =Artículo 5, a) y b) del Reglamento de Ejecución (UE) nº 680/2014