

ANEXO I

PLANTILLAS COMUNICACION DE INFORMACION SOBRE LOS FONDOS PROPIOS Y LOS REQUISITOS DE FONDOS PROPIOS				
Número de la plantilla	Código de la plantilla	Nombre de la plantilla	Nombre abreviado	Frecuencia
FRECUENCIA TRIMESTRAL/SEMESTRAL ⁽¹⁾				
ADECUACIÓN DEL CAPITAL				
1	C 01.00	3201 ADECUACIÓN DEL CAPITAL - DEFINICIÓN DE FONDOS PROPIOS	CA	
2	C 02.00	3202 ADECUACIÓN DEL CAPITAL - IMPORTES DE LAS EXPOSICIONES AL RIESGO	CA1	Trimestral
3	C 03.00	3203 ADECUACIÓN DEL CAPITAL - RATIOS	CA2	Trimestral
4	C 04.00	3204 ADECUACIÓN DEL CAPITAL - PRO MEMORIA	CA3	Trimestral
			CA4	Trimestral
DISPOSICIONES TRANSITORIAS				
5.1	C 05.01	3251 ADECUACIÓN DEL CAPITAL - DISPOSICIONES TRANSITORIAS: RESUMEN	CA5	
5.2	C 05.02	3252 ADECUACIÓN DEL CAPITAL - DISPOSICIONES TRANSITORIAS: INSTRUMENTOS EN RÉGIMEN DE ANTERIORIDAD QUE CONSTITUYEN AYUDAS ESTATALES	CAS.1	Trimestral
			CAS.2	Trimestral
SOLVENCIA DEL GRUPO				
6.1	C 06.01	3208 SOLVENCIA DEL GRUPO : INFORMACIÓN SOBRE FILIALES - TOTAL	GS	
6.2	C 06.02	3209 SOLVENCIA DEL GRUPO : INFORMACIÓN SOBRE FILIALES	GS Total	Semestral
			GS	Semestral
RIESGO DE CRÉDITO				
7	C 07.00	3207 RIESGO DE CRÉDITO Y DE CONTRAPARTE Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO ESTÁNDAR PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL	CR	
			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
8.3	C 08.03	3283 RIESGO DE CRÉDITO Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL: DESGLOSE POR BANDAS DE PD	CR IRB 3	Semestral/Anual
8.4	C 08.04	3284 RIESGO DE CRÉDITO Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL: ESTADOS DE FLUJO DE LOS IMPORTES DE LA EXPOSICIÓN PONDERADA POR RIESGO	CR IRB 4	Trimestral/Anual
8.5	C 08.05	3285 RIESGO DE CRÉDITO Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL: PRUEBAS RETROSPECTIVAS DE LA PD	CR IRB 5	Trimestral/Anual
8.5.1	C 08.05.1	3285 RIESGO DE CRÉDITO Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL: PRUEBAS RETROSPECTIVAS DE LA PD CON ARREGLO AL ARTÍCULO 180, APARTADO 1, LETRA F) (CR IRB 5)		Trimestral/Anual
8.6	C 08.06	3286 RIESGO DE CRÉDITO Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL: MÉTODO DE ASIGNACIÓN PARA LA FINANCIACIÓN ESPECIALIZADA	CR IRB 6	Semestral/Anual
8.7	C 08.07	3287 RIESGO DE CRÉDITO Y OPERACIONES INCOMPLETAS: MÉTODO IRB PARA LOS REQUISITOS DE CAPITAL: ÁMBITO DE UTILIZACIÓN DE LOS MÉTODOS ESTÁNDAR E IRB	CR IRB 7	Trimestral/Anual
		DESGLOSE 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
13.01	C 13.01	3513 RIESGO DE CRÉDITO: TITULIZACIONES	CR SEC IRB	Trimestral
14	C 14.00	3214 INFORMACIÓN DETALLADA SOBRE TITULIZACIONES	CR SEC Details	Semestral
14.01	C 14.01	3514 INFORMACIÓN DETALLADA SOBRE TITULIZACIONES POR MÉTODOS	CR SEC Details 2	Semestral
RIESGO OPERATIVO				
16	C 16.00	3216 RIESGO OPERATIVO	OPR	
		RIESGO OPERATIVO: PÉRDIDAS Y RECUPERACIONES	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				
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 RENTA VARIABLE	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 RIESGO DE MERCADO: MODELOS INTERNOS	MKR IM	Trimestral
25	C 25.00	3225 RIESGO DE AJUSTE DE VALORACIÓN DEL CRÉDITO	CVA	Trimestral
VALORACIÓN PRUDENTE				
32.1	C 32.01	3521 VALORACIÓN PRUDENTE: ACTIVOS Y PASIVOS A VALOR RAZONABLE	PRUVAL	
32.2	C 32.02	3522 VALORACIÓN PRUDENTE: ENFOQUE PRINCIPAL	PRUVAL 1	Trimestral
32.3	C 32.03	3523 VALORACIÓN PRUDENTE: AVA POR RIESGO DE MODELO	PRUVAL 2	Trimestral
32.4	C 32.04	3524 VALORACIÓN PRUDENTE: AVA POR POSICIONES CONCENTRADAS	PRUVAL 3	Trimestral
			PRUVAL 4	Trimestral
EXPOSICIONES FRENTE A ADMINISTRACIONES PÚBLICAS				
33	C 33.00	3233 EXPOSICIONES FRENTE A ADMINISTRACIONES PÚBLICAS POR PAÍS DE LA CONTRAPARTE	GOV	
			GOV	Semestral
RIESGO DE CONTRAPARTE				
34.1	C 34.01	3401 RIESGO DE CONTRAPARTE: VOLUMEN DE OPERACIONES CON DERIVADOS	CCR 1	Trimestral
34.2	C 34.02	3402 RIESGO DE CONTRAPARTE: EXPOSICIONES AL RIESGO DE CONTRAPARTE SEGÚN EL MÉTODO	CCR 2	Trimestral
34.3	C 34.03	3403 RIESGO DE CONTRAPARTE: EXPOSICIONES AL RIESGO DE CONTRAPARTE TRATADAS CON MÉTODO ESTÁNDAR: SA-CCR O SA-CRR SIMPLIFICADO	CCR 3	Trimestral
34.4	C 34.04	3404 RIESGO DE CONTRAPARTE: EXPOSICIONES AL RIESGO DE CONTRAPARTE TRATADAS CON EL MÉTODO DE EXPOSICIÓN ORIGINAL (OEM)	CCR 4	Trimestral
34.5	C 34.05	3405 RIESGO DE CONTRAPARTE: EXPOSICIONES AL RIESGO DE CONTRAPARTE TRATADAS CON EL MÉTODO DE MODELOS INTERNOS (MMI)	CCR 5	Trimestral
34.6	C 34.06	3406 RIESGO DE CONTRAPARTE: VEINTE PRINCIPALES CONTRAPARTES	CCR 6	Trimestral/Semestral
34.7	C 34.07	3407 RIESGO DE CONTRAPARTE: MÉTODO IRB-EXPOSICIONES AL RIESGO DE CONTRAPARTE POR CATEGORÍA DE EXPOSICIÓN Y ESCALA DE PD	CCR 7	Semestral/Anual
34.8	C 34.08	3408 RIESGO DE CONTRAPARTE: COMPOSICIÓN DE LAS GARANTÍAS REALES D LAS EXPOSICIONES CON RIESGO DE CONTRAPARTE	CCR 8	Trimestral
34.9	C 34.09	3409 RIESGO DE CONTRAPARTE: EXPOSICIÓN DE DERIVADOS DE CRÉDITO	CCR 9	Trimestral
34.10	C 34.10	3410 RIESGO DE CONTRAPARTE: EXPOSICIONES FRENTE A ECC	CCR 10	Trimestral
34.11	C 34.11	3411 RIESGO DE CONTRAPARTE: ESTADOS DE FLUJO DE LOS IMPORTES DE LA EXPOSICIÓN PONDERADA POR RIESGO DE LAS EXPOSICIONES CON RIESGO DE CONTRAPARTE CON ARREGLO AL MMI	CCR 11	Trimestral/Anual
COBERTURA DE PÉRDIDAS DERIVADAS DE EXPOSICIONES DUDOSAS				
35.1	C 35.01	3501 COBERTURA DE PÉRDIDAS DERIVADAS DE EXPOSICIONES DUDOSAS: CÁLCULO DE DEDUCCIONES PARA EXPOSICIONES DUDOSAS	NPE LC1	Trimestral
35.2	C 35.02	3502 COBERTURA DE PÉRDIDAS DERIVADAS DE EXPOSICIONES DUDOSAS: REQUISITOS DE COBERTURA MÍNIMA Y VALORES DE EXPOSICIÓN DE EXPOSICIONES DUDOSAS EXCLUIDAS LAS EXPOSICIONES REESTRUCTURADAS O REFINANCIADAS COMPRENDIDAS EN EL ARTÍCULO 47.6 QUATER RRC	NPE LC2	Trimestral
35.3	C 35.03	3503 COBERTURA DE PÉRDIDAS DERIVADAS DE EXPOSICIONES DUDOSAS: REQUISITOS DE COBERTURA MÍNIMA Y VALORES DE EXPOSICIONES DUDOSAS REESTRUCTURADAS O REFINANCIADAS COMPRENDIDAS EN EL ARTÍCULO 47.6 QUATER RRC	NPE LC3	Trimestral

(1) = Artículos 5 a 8 del Reglamento de Ejecución (UE) 2021/451