

### ANEXO III

RESULTADOS DE LAS CARTERAS DE REFERENCIA A EFECTOS DE SUPERVISIÓN			
<u>Número de la plantilla</u>	<u>Código de plantilla</u>		<u>Nombre de la plantilla</u>
			<b>FRECUENCIA ANUAL</b> <sup>(1)</sup>
101	C 101.00	5401	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago, por contraparte
102	C 102.00	5402	Datos sobre las exposiciones en las carteras con bajo impago
103	C 103.00	5403	Datos sobre las exposiciones en las carteras con elevado impago
105.01	C 105.01	5451	Definición de modelos internos
105.02	C 105.02	5452	Asignación de modelos internos a las carteras
105.03	C 105.03	5453	Asignación de modelos internos a los países

### ANEXO VII

RESULTADOS DE LAS CARTERAS DE REFERENCIA A EFECTOS DE SUPERVISIÓN. RIESGO DE MERCADO				
<u>Número de la plantilla</u>	<u>Código de plantilla</u>		<u>Nombre de la plantilla/del grupo de plantillas</u>	<u>Nombre abreviado</u>
			<b>FRECUENCIA ANUAL</b> <sup>(1)</sup>	
			<b>VALOR DE MERCADO INICIAL</b>	
106	C 106.00	5406	Valor de mercado inicial y justificación de la exclusión	IMV
			<b>VaR Y sVaR NO CTP</b>	
107.1	C 107.01	5471	VaR Y sVaR NO CTP. Detalles	VaR&S VaR 1
107.2	C 107.02	5472	VaR Y sVaR NO CTP. Resultados en la moneda de base	VaR&S VaR 2
			<b>VaR A PARTIR DE LAS PÉRDIDAS Y GANANCIAS DE UN AÑO</b>	
108	C 108.00	5408	Var a partir de las pérdidas y ganancias de un año	1Y P&L
			<b>EXIGENCIA DE CAPITAL POR RIESGO INCREMENTAL</b>	
109.1	C 109.01	5491	IRC. Detalles del modelo	IRC 1
109.2	C 109.02	5492	IRC. Detalles por cartera	IRC 2
109.3	C 109.03	5493	IRC. Importe por cartera/fecha	IRC 3
			<b>NEGOCIACIÓN DE CORRELACIÓN</b>	
110.1	C 110.01	5411	Negociación de correlación. Detalles del modelo	CT 1
110.2	C 110.02	5412	Negociación de correlación. Detalles por cartera	CT 2
110.3	C 110.03	5413	Negociación de correlación. Todos los riesgos de precio por cartera/ fecha	CT 3

<sup>(1)</sup> art. 4 del Reglamento de Ejecución (UE) nº 2070/2016