

Año				Mes	Día	Código entidad				

INFORMACIÓN SOBRE TITULIZACIONES ¹

ENTIDAD: _____

Nombre de la titulación	
Artículo del Reglamento (UE) n.º 575/2013 aplicable a la titulación	< 243(2), 243(4), 244(2), 244(4) >
Opciones de compra a favor del originador incluidas en la transacción	< sí, no >
Tipo de activos subyacentes	(RMBS, CMBS, préstamos a estudiantes, préstamos corporativos, <i>trade finance</i> ...)
Divisa de referencia	
Nocional de la transacción	miles de millones (mm)
Exposiciones ponderadas por riesgo (RWA) antes de la titulación	mm
Deducciones de capital antes de la titulación	mm
Equivalente en exposiciones ponderadas por riesgo de las deducciones de capital antes de la titulación	Deducciones de capital antes de la titulación / 8% (mm)
Equivalente en exposiciones ponderadas por riesgo totales antes de la titulación	RWA equivalente de las deducciones de capital antes de la titulación + RWA antes de la titulación (mm)
Exposiciones ponderadas por riesgo tras la titulación en los tramos retenidos	mm
Deducciones de capital tras la titulación	mm
Equivalente en exposiciones ponderadas por riesgo de las deducciones de capital tras la titulación	Deducciones de capital tras la titulación / 8% (mm)
Equivalente en exposiciones ponderadas por riesgo totales tras la titulación	RWA equivalente de las deducciones de capital tras la titulación + RWA tras la titulación de los tramos retenidos (mm)
Reducción de exposiciones ponderadas por riesgo conseguida con la titulación	Total RWA equivalente antes de la titulación - total RWA equivalente tras la titulación (mm)
Reducción de exposiciones ponderadas por riesgo conseguida con la titulación (en %)	Reducción de RWA conseguida con la titulación / total RWA equivalente antes de la titulación (%)
Tramo de primera pérdida	mm
Tramo de primera pérdida (en %)	%
¿Tramo de primera pérdida retenido?	< sí, no >
% del tramo de primera pérdida retenido	%
Tramo de riesgo intermedio	mm
Tramo de riesgo intermedio (en %)	%
¿Tramo de riesgo intermedio retenido?	< sí, no >
% del tramo de riesgo intermedio retenido	%
Tramo preferente	mm
Tramo preferente (en %)	%
¿Tramo preferente retenido?	< sí, no >
% del tramo preferente retenido	%
Nivel de mejora crediticia del riesgo vendido (punto de <i>attachment</i>) (en %)	%
Nivel de mejora crediticia del riesgo vendido más grosor del tramo vendido (punto de <i>detachment</i>) (en %)	%
Tamaño de la cartera de referencia	mm
Pérdida esperada (EL)	mm
Pérdida esperada (en %)	EL / tamaño de la cartera de referencia (%)
Pérdida esperada + Pérdida inesperada (UL)	mm
Pérdida esperada + Pérdida inesperada (en %)	(EL+UL) / tamaño de la cartera de referencia (%)
% de riesgo transferido según la entidad originadora	%

¹ Se deberá notificar esta información de forma individual para cada una de las titulaciones mencionadas en la norma 66 y en la disposición transitoria cuarta de esta circular.