



ESTADOS RESERVADOS DE INFORMACIÓN ESTADÍSTICA

Fondos de Activos Bancarios - Trimestral

SISTEMAS DE INFORMACIÓN / DPTO. ESTUDIOS, ESTADÍSTICAS Y

PUBLICACIONES

Noviembre de 2014

Índice

1. Objetivo.....	2
2. Estructura de la información.....	2
3. Definición de contenidos.....	2
3.1 Estado T01	2
3.2 Estado T02	3
3.3 Estado T03	3
3.4 Estado T04	5
4. Acceso a la SEDE electrónica de la CNMV y al trámite FAB.....	6
5. Ejemplo XML.....	7

1. Objetivo

La remisión por parte de las sociedades instrumentales, dedicadas a operaciones de titulización, de los estados reservados de información estadística de los Fondos de Activos Bancarios a la CNMV, mediante un fichero normalizado XML basado en la estructura y contenidos almacenados en la CNMV.

2. Estructura de la información

El esquema de los fondos de activos bancarios contiene un bloque de información, con los estados reservados de información estadística, para un periodo trimestral, junto con los datos identificativos del fondo.

3. Definición de contenidos

Datos identificativos del fondo:

Nombre Etiqueta	Descripción	Observaciones
<i><NumeroRegistroFondo></i>	Nº registro del fondo	Obligatorio
<i><NIFFondo></i>	Código NIF del fondo	Obligatorio
<i><NombreFondo></i>	Nombre del fondo	Obligatorio

Se establece los siguientes estados reservados:

3.1 Estado T01 - Información estadística relativa a los activos y pasivos del fondo

Se reportará el bloque de datos:

Nombre Etiqueta	Descripción	Observaciones
<i><T01_00300>, <T01_00380></i>	Claves estado T01	Obligatorias
<i>Resto de claves</i>	Para descripción de claves consultar: El modelo T01 del anexo de la Circular 07/2014 de la CNMV	Opcionales

3.2 Estado T02 - Información estadística relativa a operaciones financieras, saneamientos y recuperaciones

Se reportará el bloque de datos:

Nombre Etiqueta	Descripción	Observaciones
<T02_00300>, <T02_00380>	Claves estado T02	Obligatorias
Resto de claves	Para descripción de claves consultar: El modelo T02 del anexo de la Circular 07/2014 de la CNMV	Opcionales

3.3 Estado T03 - Información básica del fondo

Se reportará el bloque de datos:

- Datos generales del fondo

Nombre Etiqueta	Descripción	Observaciones
<TipoTitulizacion>	Tipo de titulización	Opcional Lista: "T": Tradicional "S": Sintética "O": Otra
<FondoPublico_Privado>	Fondo Público/Privado	Opcional Lista: "PUBLICO" "PRIVADO"
<ClaseFondo>	Clase de fondo	Opcional Lista: "A": Abierto "B": Cerrado

<Finalidad>	Finalidad de fondo	<p>Opcional</p> <p>Lista:</p> <p>"PHH": Préstamos hipotecarios: a hogares</p> <p>"PHS": Préstamos hipotecarios: a sociedades no financieras</p> <p>"PHO": Préstamos hipotecarios: otros</p> <p>"PHH": Participaciones hipotecarias: a hogares</p> <p>"PHS": Participaciones hipotecarias: a s.n.f.</p> <p>"PHO": Participaciones hipotecarias: otros</p> <p>"CTH": Certificados de transmisión hipotecaria: a hogares</p> <p>"CTS": Certificados de transmisión hipotecarias: a s.n.f.</p> <p>"CTO": Certificados de transmisión hipotecarias: otros</p> <p>"PP": Préstamos a Promotores</p> <p>"PPY": Préstamos a PYMES</p> <p>"PE": Préstamos a empresas</p> <p>"PC": Préstamos Corporativos (Sindicados)</p> <p>"CH": Cédulas Hipotecarias</p> <p>"CT": Cédulas territoriales</p> <p>"BTS": Bonos de Tesorería</p> <p>"DS": Deuda Subordinada</p> <p>"CA": Créditos AAPP</p> <p>"PCS": Préstamos Consumo</p> <p>"PA": Préstamos automoción</p> <p>"AF": Cuotas de Arrendamiento financiero (leasing)</p> <p>"CC": Cuentas a cobrar</p> <p>"DC": Derechos de crédito futuros</p> <p>"BT": Bonos de Titulización</p> <p>"OT": Otros</p>
<FechaConstitucion>	Fecha de constitución	Obligatorio Formato AAAAMMDD
<FechaVencimiento>	Fecha de vencimiento	Opcional Formato AAAAMMDD

- **Datos persona responsable de la información**

Nombre Etiqueta	Descripción	Observaciones
<Nombre>	Nombre	Obligatorio
<Cargo>	Cargo	Opcional
<Telefono>	Teléfono de contacto	Obligatorio
<E_mail>	E-mail	Obligatorio Formato de correo electrónico

3.4 Estado T04 - Información estadística relativa a las emisiones

Para cada una de las emisiones se define el siguiente bloque de datos:

Nombre Etiqueta	Descripción	Observaciones
<ISIN>	ISIN	Obligatorio
<Instrumento>	Tipo de instrumento	Obligatorio Lista: "1": Pagarés "2": Bonos y obligaciones "3": Otros valores
<FechaColocacion>	Fecha de colocación	Obligatorio Formato AAAAMMDD
<Importe>	Importe	Obligatorio Positivo
<Moneda>	Moneda	Obligatorio Según ISO 4217
<F_V>	Tipo de remuneración	Obligatorio Lista: "1": Interés fijo "2": Interés variable "3": Valores indicados "4": Cupón cero y valores emitidos a descuento "5": Valores sin interés
<Referencia>	Tipo de referencia	Opcional
<Margen>	Margen	Opcional Positivo
<PorcentajeAplicable>	Tipo de interés aplicable	Opcional Positivo
<PeriodicidadPagos>	Periodicidad de los pagos	Opcional Positivo
<FechaAmortizacion>	Fecha de amortización	Obligatorio Formato AAAAMMDD
<VidaMedia>	Vida media de la serie	Opcional Positivo
<Agencia1>	Agencia 1	Obligatorio si hay etiqueta <CalificacionRaiting>
<Raiting1>	Raiting 1	Obligatorio si hay etiqueta <CalificacionRaiting>
<Agencia2>	Agencia 2	Opcional
<Raiting2>	Raiting 2	Opcional
<Agencia3>	Agencia 3	Opcional
<Raiting3>	Raiting 3	Opcional
<NominalColocado>	Nominal colocado	Opcional
<NominalAmortizado>	Nominal amortizado	Opcional Positivo
<NominalCirculacion>	Nominal en circulación	Obligatorio Positivo

<SaldoContableMonedaOrigen>	Saldo contable en moneda original	Obligatorio Positivo
<SaldoContableEuros>	Saldo contable en euros	Obligatorio Positivo
<PrecioMedio>	Precio medio de colocación	Opcional Positivo
<PrecioReembolso>	Precio reembolso	Obligatorio Positivo
<PrimasReembolso>	Primas de reembolso	Opcional
<NaturalezaSuscriptores>	Naturaleza de los suscriptores	Obligatorio Lista: "1": Emisión abierta al público "2": Emisión dirigida a Inversores Institucionales "3": Otras emisiones
<Observaciones>	Observaciones	Opcional

4. Acceso a la SEDE electrónica de la CNMV y al trámite “FAB – Fondos de activos bancarios - Trimestral “

La comunicación electrónica de los fondos de activos bancarios se realizará exclusivamente a través de la SEDE electrónica de la CNMV mediante el trámite “FAB – Fondos de activos bancarios - Trimestral“

El procedimiento para la utilización trámite “FAB – Fondos de activos bancarios - Trimestral“ depende de la entidad según la suscripción actual al servicio CIFRADO/CNMV:

- **Entidades que no estén dadas de alta en el servicio CIFRADO/CNMV.**



Deberán solicitar el servicio CIFRADO/CNMV siguiendo las [instrucciones](#) que figuran en la página de [inicio de la Sede electrónica](#).

- **Entidades que dispongan del servicio CIFRADO/CNMV**

- Entidades con certificados emitidos con poder genérico.



Se incluirá de oficio en la SEDE electrónica de la CNMV el nuevo trámite “FAB – Fondos de activos bancarios - Trimestral“ para los accesos de usuario y clave activos.

- Entidades con certificados emitidos con poderes específicos.



Deberán remitir a la CNMV el poder correspondiente para la habilitación del nuevo trámite “FAB – Fondos de activos bancarios - Trimestral“.

5. Ejemplo XML

```
<?xml version="1.0" encoding="UTF-8"?>
<TramiteCNMV xsi:noNamespaceSchemaLocation="Esquema_FAB_Trimestral_v1.xsd"
xmlns:xsi="http://www.w3.org/2001/XMLSchema-instance">
  <DocumentoCNMV>
    <CodigoTramite>FABT</CodigoTramite>
  </DocumentoCNMV>
  <TramiteFABT>
    <EstadosReservados>
      <Periodo>
        <Mes>12</Mes>
        <Ejercicio>2014</Ejercicio>
      </Periodo>
      <Entidad>
        <DatosIdentificativosEntidad>
          <NumeroRegistroFondo>1</NumeroRegistroFondo>
          <NIFFondo>A123456789</NIFFondo>
          <NombreFondo>FONDO 1</NombreFondo>
        </DatosIdentificativosEntidad>
        <EstadosTrimestrales>
          <Estado_T01>
            <T01_00010>407296.00</T01_00010>
            <T01_00013>201748.00</T01_00013>
            <T01_00016>205548.00</T01_00016>
            <T01_00020>660592.00</T01_00020>
            <T01_00030>751357.00</T01_00030>
            <T01_00290>6304.00</T01_00290>
            <T01_00300>1164957.00</T01_00300>
            <T01_00310>61228.00</T01_00310>
            <T01_00320>1082080.00</T01_00320>
            <T01_00330>1082080.00</T01_00330>
            <T01_00370>21649.00</T01_00370>
            <T01_00380>1164957.00</T01_00380>
            <T01_09040>751357.00</T01_09040>
            <T01_02020>407296.00</T01_02020>
            <T01_14020>253296.00</T01_14020>
          </Estado_T01>
          <Estado_T02>
            <T02_00010>192887.00</T02_00010>
            <T02_00020>-156081.00</T02_00020>
            <T02_00030>-156081.00</T02_00030>
            <T02_00285>156081.00</T02_00285>
            <T02_00290>883.00</T02_00290>
            <T02_00300>37689.00</T02_00300>
            <T02_00310>-55363.00</T02_00310>
            <T02_00320>90327.00</T02_00320>
            <T02_00330>90327.00</T02_00330>
            <T02_00370>2725.00</T02_00370>
            <T02_00380>37689.00</T02_00380>
            <T02_09040>-156081.00</T02_09040>
            <T02_02010>192887.00</T02_02010>
            <T02_02020>192887.00</T02_02020>
          </Estado_T02>
          <Estado_T03>
            <DatosGeneralesFondo>
              <TipoTitulizacion>O</TipoTitulizacion>
              <FondoPublico_Privado>PUBLICO</FondoPublico_Privado>
              <ClaseFondo>A</ClaseFondo>
              <Finalidad>OT</Finalidad>
              <FechaConstitucion>20081127</FechaConstitucion>
              <FechaVencimiento>20281127</FechaVencimiento>
            </DatosGeneralesFondo>
            <PersonaResponsable>
              <Nombre>Nombre 1</Nombre>
              <Cargo>Cargo 1</Cargo>
              <Telefono>999999999</Telefono>
              <E_mail>nombre1@cnmv.es</E_mail>
            </PersonaResponsable>
          </Estado_T03>
        </EstadosTrimestrales>
      </Entidad>
    </EstadosReservados>
  </TramiteFABT>
</TramiteCNMV>
```

```

</Estado_T03>
<Estado_T04>
  <Registro>
    <ISIN>ES0123456701</ISIN>
    <Instrumento>1</Instrumento>
    <Emision>
      <FechaColocacion>20130619</FechaColocacion>
      <Importe>20000</Importe>
      <Moneda>0978</Moneda>
      <Interes>
        <F_V>4</F_V>
        <Referencia>EUR</Referencia>
        <PorcentajeAplicable>0.545</PorcentajeAplicable>
      </Interes>
      <PeriodicidadPagos>1</PeriodicidadPagos>
      <FechaAmortizacion>20140116</FechaAmortizacion>
      <VidaMedia>0.04</VidaMedia>
      <CalificacionRaiting>
        <Agencial>S&P</Agencial>
        <Raiting1>A-2</Raiting1>
        <Agencia2>Fitch</Agencia2>
        <Raiting2>F2</Raiting2>
      </CalificacionRaiting>
    </Emision>
    <MovimientosSalDOS>
      <NominalColocado>0</NominalColocado>
      <NominalAmortizado>0</NominalAmortizado>
      <NominalCirculacion>20000</NominalCirculacion>
      <SaldoContableMonedaOrigen>20069</SaldoContableMonedaOrigen>
      <SaldoContableEuros>270520</SaldoContableEuros>
    </MovimientosSalDOS>
    <PrecioMedio>0</PrecioMedio>
    <PrecioReembolso>100</PrecioReembolso>
    <NaturalezaSuscriptores>2</NaturalezaSuscriptores>
    <Observaciones>Observaciones 1</Observaciones>
  </Registro>
  <Registro>
    <ISIN>ES0123456719</ISIN>
    <Instrumento>1</Instrumento>
    <Emision>
      <FechaColocacion>20130619</FechaColocacion>
      <Importe>20000</Importe>
      <Moneda>0978</Moneda>
      <Interes>
        <F_V>4</F_V>
        <Referencia>EUR</Referencia>
        <PorcentajeAplicable>0.551</PorcentajeAplicable>
      </Interes>
      <PeriodicidadPagos>1</PeriodicidadPagos>
      <FechaAmortizacion>20140121</FechaAmortizacion>
      <VidaMedia>0.06</VidaMedia>
      <CalificacionRaiting>
        <Agencial>S&P</Agencial>
        <Raiting1>A-2</Raiting1>
        <Agencia2>Fitch</Agencia2>
        <Raiting2>F2</Raiting2>
      </CalificacionRaiting>
    </Emision>
    <MovimientosSalDOS>
      <NominalColocado>0</NominalColocado>
      <NominalAmortizado>0</NominalAmortizado>
      <NominalCirculacion>20000</NominalCirculacion>
      <SaldoContableMonedaOrigen>20070</SaldoContableMonedaOrigen>
      <SaldoContableEuros>270520</SaldoContableEuros>
    </MovimientosSalDOS>
    <PrecioMedio>0</PrecioMedio>
    <PrecioReembolso>100</PrecioReembolso>
    <NaturalezaSuscriptores>2</NaturalezaSuscriptores>
    <Observaciones>Observaciones 2</Observaciones>
  </Registro>
  <Registro>
    <ISIN>ES0123456727</ISIN>

```



```

<Instrumento>1</Instrumento>
<Emission>
  <FechaColocacion>20130619</FechaColocacion>
  <Importe>20000</Importe>
  <Moneda>0978</Moneda>
  <Interes>
    <F_V>4</F_V>
    <Referencia>EUR</Referencia>
    <PorcentajeAplicable>0.553</PorcentajeAplicable>
  </Interes>
  <PeriodicidadPagos>1</PeriodicidadPagos>
  <FechaAmortizacion>20140123</FechaAmortizacion>
  <VidaMedia>0.06</VidaMedia>
  <CalificacionRaiting>
    <Agencial>S&P</Agencial>
    <Raiting1>A-2</Raiting1>
    <Agencia2>Fitch</Agencia2>
    <Raiting2>F2</Raiting2>
  </CalificacionRaiting>
</Emission>
<MovimientosSaldos>
  <NominalColocado>0</NominalColocado>
  <NominalAmortizado>0</NominalAmortizado>
  <NominalCirculacion>20000</NominalCirculacion>
  <SaldoContableMonedaOrigen>20070</SaldoContableMonedaOrigen>
  <SaldoContableEuros>270520</SaldoContableEuros>
</MovimientosSaldos>
<PrecioMedio>0</PrecioMedio>
<PrecioReembolso>100</PrecioReembolso>
<NaturalezaSuscriptores>2</NaturalezaSuscriptores>
<Observaciones>Observaciones 3</Observaciones>
</Registro>
<Registro>
  <ISIN>ES0123456735</ISIN>
  <Instrumento>1</Instrumento>
  <Emission>
    <FechaColocacion>20130619</FechaColocacion>
    <Importe>20000</Importe>
    <Moneda>0978</Moneda>
    <Interes>
      <F_V>4</F_V>
      <Referencia>EUR</Referencia>
      <PorcentajeAplicable>0.575</PorcentajeAplicable>
    </Interes>
    <PeriodicidadPagos>1</PeriodicidadPagos>
    <FechaAmortizacion>20140213</FechaAmortizacion>
    <VidaMedia>0.12</VidaMedia>
    <CalificacionRaiting>
      <Agencial>S&P</Agencial>
      <Raiting1>A-2</Raiting1>
      <Agencia2>Fitch</Agencia2>
      <Raiting2>F2</Raiting2>
    </CalificacionRaiting>
  </Emission>
  <MovimientosSaldos>
    <NominalColocado>0</NominalColocado>
    <NominalAmortizado>0</NominalAmortizado>
    <NominalCirculacion>20000</NominalCirculacion>
    <SaldoContableMonedaOrigen>20073</SaldoContableMonedaOrigen>
    <SaldoContableEuros>270520</SaldoContableEuros>
  </MovimientosSaldos>
  <PrecioMedio>0</PrecioMedio>
  <PrecioReembolso>100</PrecioReembolso>
  <NaturalezaSuscriptores>2</NaturalezaSuscriptores>
  <Observaciones>Observaciones 4</Observaciones>
</Registro>
</Estado_T04>
</EstadosTrimestrales>
</Entidad>
</EstadosReservados>
</TramiteFABT>
</TramiteCNMV>

```