

INFORMACIÓN SOBRE POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN

Correspondiente al \_\_\_\_ de \_\_\_\_ de \_\_\_\_

ENTIDAD: \_\_\_\_\_

DIVISA: \_\_\_\_\_

Año	Mes	p	Estado	Código entidad	Tipo identificador (*)
			E 3 0 5 2		

	SALDO	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	DISTRIBUCIÓN DE LAS POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS, EN ACTIVIDADES FUERA DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN, POR BANDAS DE REPRECIACIÓN													
			HASTA 1 MES			MÁS DE 1 MES Y HASTA 3 MESES			MÁS DE 3 MESES Y HASTA 6 MESES			MÁS DE 6 MESES Y HASTA 1 AÑO				
			FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)		
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14			
<b>ACTIVO</b>																
<b>1. MERCADO MONETARIO (DEPÓSITOS EN BANCOS CENTRALES, DEPÓSITOS EN ENT. DE CRÉDITO Y ADO. TEMPORALES DE ACT.)</b>	0001	0101	0201	0301	0401	0501	0601	0701	0801	0901	1001	1101	1201	1301		
<b>2. CRÉDITO A LA CLIENTELA</b>	0006		0206	0306		0506	0606		0806	0906		1106	1206			
2.1. A TIPO DE INTERÉS VARIABLE	0006		0206	0306		0506	0606		0806	0906		1106	1206			
2.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	0012	0112	0212	0312	0412	0512	0612	0712	0812	0912	1012	1112	1212	1312		
2.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	0013	0113	0213	0313	0413	0513	0613	0713	0813	0913	1013	1113	1213	1313		
2.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	0014	0114	0214	0314	0414	0514	0614	0714	0814	0914	1014	1114	1214	1314		
2.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN	0015	0115	0215	0315	0415	0515	0615	0715	0815	0915	1015	1115	1215	1315		
2.2. A TIPO DE INTERÉS FIJO	0016	0116	0216	0316	0416	0516	0616	0716	0816	0916	1016	1116	1216	1316		
<b>3. VALORES REPRESENTATIVOS DE DEUDA</b>	0025		0225	0325		0525	0625		0825	0925		1125	1225			
3.1. VALORES DE TIPO DE INTERÉS VARIABLE Y A CORTO PLAZO (MENOS 18 MESES)	0026		0226	0326		0526	0626		0826	0926		1126	1226			
3.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	0027	0127	0227	0327	0427	0527	0627	0727	0827	0927	1027	1127	1227	1327		
3.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	0028	0128	0228	0328	0428	0528	0628	0728	0828	0928	1028	1128	1228	1328		
3.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	0029	0129	0229	0329	0429	0529	0629	0729	0829	0929	1029	1129	1229	1329		
3.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN	0030	0130	0230	0330	0430	0530	0630	0730	0830	0930	1030	1130	1230	1330		
3.2. VALORES DE TIPO DE INTERÉS FIJO	0031	0131	0231	0331	0431	0531	0631	0731	0831	0931	1031	1131	1231	1331		
<b>4. OTROS ACTIVOS SENSIBLES</b>	0035	0135	0235	0335	0435	0535	0635	0735	0835	0935	1035	1135	1235	1335		
<b>5. DERIVADOS PARA LA GESTIÓN DEL RIESGO DE INTERÉS Y OTROS DERIVADOS QUE AFECTEN AL RIESGO DE INTERÉS</b>	0040		0240	0340		0540	0640		0840	0940		1140	1240			
5.1. IRS Y CROSS CURRENCY SWAPS	0041		0241	0341		0541	0641		0841	0941		1141	1241			
5.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	0042	0142	0242	0342	0442	0542	0642	0742	0842	0942	1042	1142	1242	1342		
5.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	0043	0143	0243	0343	0443	0543	0643	0743	0843	0943	1043	1143	1243	1343		
5.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	0044	0144	0244	0344	0444	0544	0644	0744	0844	0944	1044	1144	1244	1344		
5.1.4. RESTO	0045	0145	0245	0345	0445	0545	0645	0745	0845	0945	1045	1145	1245	1345		
5.2. FRAS, CALL MONEY SWAPS, FUTUROS INTERÉS, COMPRAVENTAS DE DIVISA Y OTROS	0046	0146	0246	0346	0446	0546	0646	0746	0846	0946	1046	1146	1246	1346		

(\*) Se consignarán:  
0 Estado correspondiente a grupo consolidado  
1 Estado correspondiente a subgrupo consolidado  
2 Estado individual correspondiente a entidad  
3 Estado individual correspondiente a entidad que presenta sus recursos propios con instrumentales

INFORMACIÓN SOBRE POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN

Correspondiente al \_\_\_\_ de \_\_\_\_\_ de \_\_\_\_\_

ENTIDAD: \_\_\_\_\_

DIVISA: \_\_\_\_\_

Año	Mes	p	Estado	Código entidad	Tipo identificador (*)
			E	3052	

	SALDO	TIPO DE INTERÉS MEDIO(%)	DISTRIBUCIÓN DE LAS POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS, EN ACTIVIDADES FUERA DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN, POR BANDAS DE REPRECIACIÓN											
			HASTA 1 MES			MÁS DE 1 MES Y HASTA 3 MESES			MÁS DE 3 MESES Y HASTA 6 MESES			MÁS DE 6 MESES Y HASTA 1 AÑO		
			FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA	TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)
			1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
<b>PASIVO</b>														
<b>1. DEPÓSITOS DE BANCOS CENTRALES, DE EE.CC. Y CTA</b>	0050	0150	0250	0350	0450	0550	0650	0750	0850	0950	1050	1150	1250	1350
<b>2. DEPÓSITOS DE LA CLIENTELA (RESIDENTES Y NO RESIDENTES)</b>	0055													
2.1. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO NO REMUNERADAS	0056	0156												
2.2. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO REMUNERADAS, DE TIPO ADMINISTRADO	0057	0157												
2.3. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO REFERENCIADAS A INTERBANCARIO	0058	0158	0258	0358	0458	0558	0658	0758	0858	0958	1058	1158	1258	1358
2.4. DEPÓSITOS A PLAZO TRADICIONALES	0059	0159	0259	0359	0459	0559	0659	0759	0859	0959	1059	1159	1259	1359
2.5. DEPÓSITOS Y FONDOS TOMADOS CON REMUNERACIÓN LIGADA A OPCIONES	0060	0160	0260	0360	0460	0560	0660	0760	0860	0960	1060	1160	1260	1360
<b>3. DÉBITOS REPRESENTADOS POR VALORES NEGOCIABLES</b>	0065		0265	0365		0565	0665		0865	0965		1165	1265	
3.1. VALORES DEL MERCADO MONETARIO Y VALORES DE TIPO DE INTERÉS VARIABLE	0066		0266	0366		0566	0666		0866	0966		1166	1266	
3.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	0067	0167	0267	0367	0467	0567	0667	0767	0867	0967	1067	1167	1267	1367
3.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	0068	0168	0268	0368	0468	0568	0668	0768	0868	0968	1068	1168	1268	1368
3.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	0069	0169	0269	0369	0469	0569	0669	0769	0869	0969	1069	1169	1269	1369
3.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN	0070	0170	0270	0370	0470	0570	0670	0770	0870	0970	1070	1170	1270	1370
3.2. VALORES DE TIPO DE INTERÉS FLUJO	0071	0171	0271	0371	0471	0571	0671	0771	0871	0971	1071	1171	1271	1371
<b>4. FINANCIACIONES SUBORDINADAS (INCLUIDAS PARTICIPACIONES PREFERENTES)</b>	0075		0275	0375		0575	0675		0875	0975		1175	1275	
4.1. TÍTULOS EMITIDOS A TIPO DE INTERÉS VARIABLE	0076		0276	0376		0576	0676		0876	0976		1176	1276	
4.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	0077	0177	0277	0377	0477	0577	0677	0777	0877	0977	1077	1177	1277	1377
4.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	0078	0178	0278	0378	0478	0578	0678	0778	0878	0978	1078	1178	1278	1378
4.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	0079	0179	0279	0379	0479	0579	0679	0779	0879	0979	1079	1179	1279	1379
4.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN	0080	0180	0280	0380	0480	0580	0680	0780	0880	0980	1080	1180	1280	1380
4.2. TÍTULOS EMITIDOS A TIPO INTERÉS FLUJO	0081	0181	0281	0381	0481	0581	0681	0781	0881	0981	1081	1181	1281	1381
<b>5. OTROS PASIVOS SENSIBLES</b>	0085	0185	0285	0385	0485	0585	0685	0785	0885	0985	1085	1185	1285	1385
<b>6. DERIVADOS PARA LA GESTIÓN DEL RIESGO DE INTERÉS Y OTROS DERIVADOS QUE AFECTEN AL RIESGO DE INTERÉS</b>	0090		0290	0390		0590	0690		0890	0990		1190	1290	
6.1. IRS Y CROSS CURRENCY SWAP	0091		0291	0391		0591	0691		0891	0991		1191	1291	
6.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	0092	0192	0292	0392	0492	0592	0692	0792	0892	0992	1092	1192	1292	1392
6.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	0093	0193	0293	0393	0493	0593	0693	0793	0893	0993	1093	1193	1293	1393
6.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	0094	0194	0294	0394	0494	0594	0694	0794	0894	0994	1094	1194	1294	1394
6.1.4. RESTO	0095	0195	0295	0395	0495	0595	0695	0795	0895	0995	1095	1195	1295	1395
6.2. FRAS, CALL MONEY SWAPS, FUTUROS INTERÉS, COMPRAVENTA DE DIVISA Y OTROS	0096	0196	0296	0396	0496	0596	0696	0796	0896	0996	1096	1196	1296	1396

(\*) Se consignarán:

0 Estado correspondiente a grupo consolidado

1 Estado correspondiente a subgrupo consolidado

2 Estado individual correspondiente a entidad

3 Estado individual correspondiente a entidad que presenta sus recursos propios con instrumentales



INFORMACIÓN SOBRE POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN

Correspondiente al \_\_\_\_ de \_\_\_\_ de \_\_\_\_

ENTIDAD: \_\_\_\_\_

DIVISA: \_\_\_\_\_

Año	Mes		P	Estado	Código entidad	Tipo identificador (*)
				E	3052	

	DISTRIBUCIÓN DE LAS POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS, EN ACTIVIDADES FUERA DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN, POR BANDAS DE REPRECIACIÓN										CARACTERÍSTICAS DE LOS DEPÓSITOS A LA VISTA							
	AÑO 2	AÑO 3	AÑO 4	AÑO 5	AÑOS 6 - 7	AÑOS 8 - 10	AÑOS 11 - 15	AÑOS 16 - 20	MÁS 20 AÑOS	VALOR ECONÓMICO	PORCENTAJE INESTABLE DE LOS DEPÓSITOS A LA VISTA (%)	SENSIBILIDAD A CAMBIOS DE TIPOS (%)		DURACIÓN (MESES)		PLAZO DE REPRECIACIÓN (MESES)		
	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS	FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS			A SUBIDAS	A BAJADAS	EN SUBIDAS	EN BAJADAS	EN SUBIDAS	EN BAJADAS	
	15	16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	
<b>1. DEPÓSITOS DE BANCOS CENTRALES, DE EE.CC. Y CTA</b>	1450	1550	1650	1750	1850	1950	2050	2150	2250									
<b>2. DEPÓSITOS DE LA CLIENTELA (RESIDENTES Y NO RESIDENTES)</b>																		
2.1. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO NO REMUNERADAS										2356	2456			2756		2856	2956	3056
2.2. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO REMUNERADAS, DE TIPO ADMINISTRADO										2357	2457	2557	2657	2757	2857	2957	3057	
2.3. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO REFERENCIADAS A INTERBANCARIO	1458	1558	1658	1758	1858	1958	2058	2158	2258									
2.4. DEPÓSITOS A PLAZO TRADICIONALES	1459	1559	1659	1759	1859	1959	2059	2159	2259									
2.5. DEPÓSITOS Y FONDOS TOMADOS CON REMUNERACIÓN LIGADA A OPCIONES	1460	1560	1660	1760	1860	1960	2060	2160	2260									
<b>3. DÉBITOS REPRESENTADOS POR VALORES NEGOCIABLES</b>	1465	1565	1665	1765	1865	1965	2065	2165	2265									
3.1. VALORES DEL MERCADO MONETARIO Y VALORES DE TIPO DE INTERÉS VARIABLE	1466	1566	1666	1766	1866	1966	2066	2166	2266									
3.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	1467	1567	1667	1767	1867	1967	2067	2167	2267									
3.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	1468	1568	1668	1768	1868	1968	2068	2168	2268									
3.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	1469	1569	1669	1769	1869	1969	2069	2169	2269									
3.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN	1470	1570	1670	1770	1870	1970	2070	2170	2270									
3.2. VALORES DE TIPO DE INTERÉS FIJO	1471	1571	1671	1771	1871	1971	2071	2171	2271									
<b>4. FINANCIACIONES SUBORDINADAS (INCLUIDAS PARTICIPACIONES PREFERENTES)</b>	1475	1575	1675	1775	1875	1975	2075	2175	2275									
4.1. TÍTULOS EMITIDOS A TIPO DE INTERÉS VARIABLE	1476	1576	1676	1776	1876	1976	2076	2176	2276									
4.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	1477	1577	1677	1777	1877	1977	2077	2177	2277									
4.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	1478	1578	1678	1778	1878	1978	2078	2178	2278									
4.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	1479	1579	1679	1779	1879	1979	2079	2179	2279									
4.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN	1480	1580	1680	1780	1880	1980	2080	2180	2280									
4.2. TÍTULOS EMITIDOS A TIPO INTERÉS FIJO	1481	1581	1681	1781	1881	1981	2081	2181	2281									
<b>5. OTROS PASIVOS SENSIBLES</b>	1485	1585	1685	1785	1885	1985	2085	2185	2285									
<b>6. DERIVADOS PARA LA GESTIÓN DEL RIESGO DE INTERÉS Y OTROS DERIVADOS QUE AFECTEN AL RIESGO DE INTERÉS</b>	1490	1590	1690	1790	1890	1990	2090	2190	2290									
6.1. IRS Y CROSS CURRENCY SWAP	1491	1591	1691	1791	1891	1991	2091	2191	2291									
6.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES	1492	1592	1692	1792	1892	1992	2092	2192	2292									
6.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES	1493	1593	1693	1793	1893	1993	2093	2193	2293									
6.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO	1494	1594	1694	1794	1894	1994	2094	2194	2294									
6.1.4. RESTO	1495	1595	1695	1795	1895	1995	2095	2195	2295									
6.2. FRAS, CALL MONEY SWAPS, FUTUROS INTERÉS, COMPRAVENTA DE DIVISA Y OTROS	1496	1596	1696	1796	1896	1996	2096	2196	2296									

(\*) Se consignarán:  
0 Estado correspondiente a grupo consolidado  
1 Estado correspondiente a subgrupo consolidado  
2 Estado individual correspondiente a entidad  
3 Estado individual correspondiente a entidad que presenta sus recursos propios con instrumentales