

Correspondiente al ____ de ____ de ____

ENTIDAD: _____

DIVISA

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

OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS IMPLÍCITAS	IMPORTE TOTAL	DIFERENCIAL MEDIO DE TIPO DE INTERÉS (P.B.)	PLAZO MEDIO DE VENCIMIENTO (MESES)	ANTIGÜEDAD MEDIA (MESES)	COMISIÓN DE CANCELACIÓN (%)
	1	2	3	4	5
OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS Ó DE CANCELACIÓN IMPLÍCITAS EN INSTRUMENTOS DEL ACTIVO					
1. LÍMITES DE RENTABILIDAD (TECHOS Y SUELOS) EN PRÉSTAMOS Y VALORES A TIPO VARIABLE					
1.1. TECHOS A LA RENTABILIDAD (CAPS VENDIDOS)					
1.1.1. TECHO POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (TECHO A LA RENTABILIDAD ACTIVADO)	0002				
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0003	0153	0303		
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0004	0154	0304		
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0005	0155	0305		
1.2. SUELOS A LA RENTABILIDAD (FLOORS COMPRADOS)					
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO A LA RENTABILIDAD ACTIVADO)	0006	0156	0306		
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0007				
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0008	0158	0308		
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0009	0159	0309		
2. OPCIONES DE CANCELACIÓN SOBRE VALORES A TIPO FIJO					
2.1. VALORES CON OPCIÓN DE AMORTIZACIÓN A FAVOR DEL EMISOR (IMPLÍCITO SWAPTION VENDIDO RECEIVER)					
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES	0010	0160	0310		
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES	0011	0161	0311		
2.2. VALORES CON OPCIÓN DE AMORTIZACIÓN A FAVOR DEL INVERSOR (IMPLÍCITO SWAPTION COMPRADO PAYER)					
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES	0016				
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES	0017	0167	0317		
2.2.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES	0018	0168	0318		
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES	0019	0169	0319		
3. PRÉSTAMOS A TIPO DE INTERÉS FIJO (A MÁS DE 5 AÑOS RESIDUALES) (IMPLÍCITO SWAPTION VENDIDO RECEIVER)					
3.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS	0020	0170	0320		
3.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS	0021				
3.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS	0022	0172	0322		
3.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS	0023	0173	0323		
4. OTRAS OPCIONES DE INTERÉS IMPLÍCITAS EN ACTIVOS					
4.040				0480	0630
OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS Ó DE CANCELACIÓN IMPLÍCITAS EN INSTRUMENTOS DEL PASIVO					
1. LÍMITES EN EL COSTE DE FINANCIACIÓN (TECHOS Y SUELOS) EN EMISIONES A TIPO VARIABLE					
1.1. TECHOS EN EL COSTE DE FINANCIACIÓN (CAPS COMPRADOS)					
1.1.1. TECHO POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (TECHO AL COSTE DE FINANCIACIÓN ACTIVADO)	0031	0181	0331	0481	0631
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0032	0182	0332	0482	0632
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0033	0183	0333	0483	0633
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0034	0184	0334	0484	0634
1.2. SUELOS EN EL COSTE DE FINANCIACIÓN (FLOORS VENDIDOS)					
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO AL COSTE DE FINANCIACIÓN ACTIVADO)	0040				
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0046				
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0047	0197	0347		
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0048	0198	0348		
2. OPCIONES DE CANCELACIÓN SOBRE EMISIONES A TIPO FIJO					
2.1. EMISIONES CON OPCIÓN DE CANCELACIÓN A FAVOR DE LA ENTIDAD (IMPLÍCITO SWAPTION COMPRADO RECEIVER)					
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0049	0199	0349		
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0050	0200	0350		
2.1.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0051				
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0052	0202	0352		
2.2. EMISIONES CON OPCIÓN DE CANCELACIÓN A FAVOR DEL INVERSOR (IMPLÍCITO SWAPTION VENDIDO PAYER)					
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0053	0203	0353		
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0054	0204	0354		
2.2.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0055	0205	0355		
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN	0061				
3. OTRAS OPCIONES DE INTERÉS IMPLÍCITAS EN PASIVOS					
0062	0212	0362			
0063	0213	0363			
0064	0214	0364			
0065	0215	0365			
0066					
0067	0217	0367			
0068	0218	0368			
0069	0219	0369			
0070	0220	0370			
0075					

(*) 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

Correspondiente al ____ de ____ de ____

ENTIDAD: _____

DIVISA: _____

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

OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS EXPLÍCITAS	IMPORTE TOTAL	DIFERENCIAL MEDIO DE TIPO DE INTERÉS (P.B.)	PLAZO MEDIO DE VENCIMIENTO (MESES)	ANTIGÜEDAD MEDIA (MESES)	COMISIÓN DE CANCELACIÓN (%)
	1	2	3	4	5
OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS EXPLÍCITAS COMPRADAS					
1. OPCIONES DE TIPOS DE INTERÉS MÁXIMOS (CAPS/TECHOS) Y MÍNIMOS (FLOORS/SUELOS)					
1.1. CAPS COMPRADOS (DERECHO A COBRAR DIFERENCIAL POSITIVO ENTRE TIPO DE REFERENCIA Y UN TECHO)					
1.1.1. TECHO POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (TECHO ACTIVADO)	0081				
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0082	0232	0382		
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0083	0233	0383		
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0084	0234	0384		
1.2. FLOORS COMPRADOS (DERECHO A COBRAR DIFERENCIAL POSITIVO ENTRE UN SUELO Y TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA)	0085	0235	0385		
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO ACTIVADO)	0086				
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0087	0237	0387		
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0088	0238	0388		
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0089	0239	0389		
2. SWAPTIONS	0090	0240	0390		
2.1. SWAPTION COMPRADOS RECEIVER (DERECHO A INICIAR UN IRS COBRANDO UN TIPO FIJO PREFUJADO-TIPO DEL SWAPTION-)	0096				
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0097	0247	0397		
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0098	0248	0398		
2.1.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0099	0249	0399		
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0100	0250	0400		
2.2. SWAPTION COMPRADOS PAYER (DERECHO DE INICIAR IRS PAGANDO UN TIPO FIJO PREFUJADO-TIPO DEL SWAPTION-)	0101				
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0102	0252	0402		
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0103	0253	0403		
2.2.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0104	0254	0404		
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0105	0255	0405		
3. OTRAS OPCIONES COMPRADAS DE TIPO DE INTERÉS	0110				
OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS EXPLÍCITAS VENDIDAS					
1. OPCIONES DE TIPOS DE INTERÉS MÁXIMOS (CAPS/TECHOS) Y MÍNIMOS (FLOORS/SUELOS)					
1.1. CAPS VENDIDOS (OBLIGACIÓN A PAGAR DIFERENCIAL POSITIVO ENTRE TIPO DE REFERENCIA Y UN TECHO)					
1.1.1. TECHO POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (TECHO ACTIVADO)	0116				
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0117	0267	0417		
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0118	0268	0418		
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0119	0269	0419		
1.2. FLOORS VENDIDOS (OBLIGACIÓN A PAGAR DIFERENCIAL POSITIVO ENTRE UN SUELO Y TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA)	0120	0270	0420		
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO ACTIVADO)	0121				
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0122	0272	0422		
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0123	0273	0423		
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA	0124	0274	0424		
2. SWAPTIONS	0125	0275	0425		
2.1. SWAPTION VENDIDOS RECEIVER (OBLIGACIÓN DE INICIAR IRS PAGANDO UN TIPO FIJO PREFUJADO-TIPO DEL SWAPTION-)	0131				
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0132	0282	0432		
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0133	0283	0433		
2.1.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0134	0284	0434		
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0135	0285	0435		
2.2. SWAPTION VENDIDOS PAYER (OBLIGACIÓN DE INICIAR IRS COBRANDO UN TIPO FIJO PREFUJADO-TIPO DEL SWAPTION-)	0136				
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0137	0287	0437		
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0138	0288	0438		
2.2.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0139	0289	0439		
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION	0140	0290	0440		
3. OTRAS OPCIONES VENDIDAS SOBRE TIPO DE INTERÉS	0145				

(*) 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