

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación**

(presentación semestral)

El estado RI2 deberá remitirse de forma semestral al Banco de España con el ámbito de declaración establecido en la CBE 2/2016, N<sup>o</sup> 2 y considerando lo establecido en la CBE 2/2016, N<sup>o</sup> 63.

**1. Sumas horizontales:**

No existen.

**2. Sumas verticales:**

Se definen las comprobaciones para la primera columna, debiendo verificarse también para las columnas 3, 4, 6, 7, 9, 10, 12, 13, 15, 16, 17, 18, 19, 20, 21, 22 y 23:

$$0005 = 0006 + 0016$$

$$0006 = 0012 + 0013 + 0014 + 0015$$

$$0025 = 0026 + 0031$$

$$0026 = 0027 + 0028 + 0029 + 0030$$

$$0040 = 0041 + 0046$$

$$0041 = 0042 + 0043 + 0044 + 0045$$

$$0055 = 0056 + 0057 + 0058 + 0059 + 0060$$

$$0065 = 0066 + 0071$$

$$0066 = 0067 + 0068 + 0069 + 0070$$

$$0075 = 0076 + 0081$$

$$0076 = 0077 + 0078 + 0079 + 0080$$

$$0090 = 0091 + 0096$$

$$0091 = 0092 + 0093 + 0094 + 0095$$

**3. Otras relaciones internas:**

En "DIVISA" se podrá consignar cualquier código de divisa (no se admitirá 9001).

Al menos una de las claves de la columna 1 debe ser distinta de cero.

Las columnas 2, 5, 8, 11, 14, 25, 26, y 27 se expresarán en tanto por ciento con dos decimales.

Las claves 0201 a 0215, 0225 a 0231, 0240 a 0246, 0250, 0265 a 0281, 0290 a 0296, 0501 a 0515, 0525 a 0531, 0540 a 0546, 0550, 0565 a 0581, 0590 a 0596, 0801 a 0815, 0825 a 0831, 0840 a 0846, 0850, 0865 a 0881, 0890 a 0896, 1101 a 1115, 1125 a 1131, 1140 a 1146, 1150, 1165 a 1181, 1190 a 1196, 1401 a 1415, 1425 a 1431, 1440 a 1446, 1450, 1465 a 1481, 1490 a 1496, 1501 a 1515, 1525 a 1531, 1540 a 1546, 1550, 1565 a 1581, 1590 a 1596, 1601 a 1615, 1625 a 1631, 1640 a 1646, 1650, 1665 a 1681, 1690 a 1696, 1701 a 1715, 1725 a 1731, 1740 a 1746, 1750, 1765 a 1781, 1790 a 1796, 1801 a 1815, 1825 a 1831, 1840 a 1846, 1850, 1865 a 1881, 1890 a 1896, 1901 a 1915, 1925 a 1931, 1940 a 1946, 1950, 1965 a 1981, 1990 a 1996, 2001 a 2015, 2025 a 2031, 2040 a 2046, 2050, 2065 a 2081, 2090 a 2096, 2101 a 2115, 2125 a 2131, 2140 a 2146, 2150, 2165 a 2181, 2190 a 2196, 2201 a 2215, 2225 a 2231, 2240 a 2246, 2250, 2265 a 2281, 2290 a 2296, relativas a "Flujos de principal e interés", podrán presentar valores negativos.

Las claves 0101, 0127 a 0131, 0142 a 0146, 0150, 0167 a 0181, 0192 a 0196, 0401, 0427 a 0431, 0442 a 0446,

T 3 0 5 2

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación**

(presentación semestral)

0450, 0467 a 0481, 0492 a 0496, 0701, 0727 a 0731, 0742 a 0746, 0750, 0767 a 0781, 0792 a 0796, 1001, 1027 a 1031, 1042 a 1046, 1050, 1067 a 1081, 1092 a 1096, 1301, 1327 a 1331, 1342 a 1346, 1350, 1367 a 1381, 1392 a 1396, relativas a "Tipo de interés medio", podrán presentar valores negativos.

Si existe importe en la clave 0001 debe haber importe en alguna de las siguientes claves: 0201, 0501, 0801, 1101, 1401, 1501, 1601, 1701, 1801, 1901, 2001, 2101, 2201.

.....

Si existe importe en la clave 0096 debe haber importe en alguna de las siguientes claves : 0296, 0596, 0896, 1196, 1496, 1596, 1696, 1796, 1896, 1996, 2096, 2196, 2296.

Si existe importe en la clave 0001 debe existir importe en la clave 0101 y viceversa. Si el importe de la clave 0101 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%.

.....

Si existe importe en la clave 0096 debe existir importe en la clave 0196 y viceversa. Si el importe de la clave 0196 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%.

La clave 0160 deberá contener obligatoriamente dato y éste ser positivo si existe importe en la clave 0060. Si el importe de la clave 0160 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

Si existe importe en la clave 0301 debe existir importe en la clave 0401. Si el importe de la clave 0401 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

.....

Si existe importe en la clave 0396 debe existir importe en la clave 0496. Si el importe de la clave 0496 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

La clave 0460 deberá contener obligatoriamente dato y éste ser positivo si existe importe en la clave 0360. Si el importe de la clave 0460 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

Si existe importe en la clave 0601 debe existir importe en la clave 0701.. Si el importe de la clave 0701 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

.....

Si existe importe en la clave 0696 debe existir importe en la clave 0796. Si el importe de la clave 0796 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

La clave 0760 deberá contener obligatoriamente dato y éste ser positivo si existe importe en la clave 0660. Si el importe de la clave 0760 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

Si existe importe en la clave 0901 debe existir importe en la clave 1001.. Si el importe de la clave 1001 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

.....

Si existe importe en la clave 0996 debe existir importe en la clave 1096.. Si el importe de la clave 1096 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

La clave 1060 deberá contener obligatoriamente dato y éste ser positivo si existe importe en la clave 0960. Si el importe de la clave 1060 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

Si existe importe en la clave 1201 debe existir importe en la clave 1301.. Si el importe de la clave 1301 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

.....

T 3 0 5 2

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación**

(presentación semestral)

Si existe importe en la clave 1296 debe existir importe en la clave 1396.. Si el importe de la clave 1396 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

La clave 1360 deberá contener obligatoriamente dato y éste ser positivo si existe importe en la clave 1260. Si el importe de la clave 1360 es mayor a 0% e inferior a 0,01% se informará por un valor del 0,01%

Si existe importe en la clave 0401 debe existir importe en las claves 0201 y 0301.

.....

Si existe importe en la clave 0496 debe existir importe en las claves 0296 y 0396.

Si existe importe en la clave 0701 debe existir importe en las claves 0501 y 0601.

.....

Si existe importe en la clave 0796 debe existir importe en las claves 0596 y 0696.

Si existe importe en la clave 1001 debe existir importe en las claves 0801 y 0901.

.....

Si existe importe en la clave 1096 debe existir importe en las claves 0896 y 0996.

Si existe importe en la clave 1301 debe existir importe en las claves 1101 y 1201.

.....

Si existe importe en la clave 1396 debe existir importe en las claves 1196 y 1296.

Si existe importe en la clave 0056 debe haber importe en las siguientes claves: 2356 y 2456,

Si existe importe en la clave 0056 y la clave 2456 es inferior a 100%, debe existir además dato en las celdas 2756 y 2856.

En el RI2 (para cada divisa declarada), el importe de las claves 2756 o 2856 no puede ser superior a 60.

Si existe importe en la clave 0056 y la clave 2456 es igual a 100% no debe existir dato declarado en las celdas 2756, 2856, 2956 y 3056.

Si en el RI2 para la divisa Euro (0978), el importe de la clave 2456 es superior al 25% deberá figurar un comentario de texto asociado explicando el motivo.

Para la divisa Euro (0978), el importe de la clave 2456 deber ser igual o superior al 10%.

Si existe importe en la clave 0057 debe haber importe en las claves 2357 y 2457, en caso de que el importe declarado en la clave 2457 fuese 0, deberá figurar un comentario de texto asociado a la clave 0057 explicando el motivo.

Si existe importe en la clave 0057 y la clave 2457 es inferior a 100% debe existir dato declarado en las celdas 2557, 2657, 2757 y 2857.

Si existe importe en la clave 0057 y la clave 2457 es igual a 100% no debe existir dato declarado en las celdas 2557, 2657, 2757, 2857, 2957 y 3057.

Si en el RI2 para la divisa Euro (0978), el importe de la clave 2457 es superior al 25% deberá figurar un comentario de texto asociado explicando el motivo.

Las claves 2557 y 2657 deben llevar un comentario de texto asociado.

Sólo en el caso de que las claves 2557 y 2657 sean iguales, el comentario de texto asociado figurará en la clave 2557.

T 3 0 5 2

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación**

2356 ≤ 0056

0156 < 0157

Si existe importe en la clave 0056 se debe cumplir que:

2756 ≥ 2757

2856 ≥ 2857

$(2356 / 0056) < (2357 / 0057)$

$0001 \times 1,25 \geq 0301 + 0601 + 0901 + 1201$

.....

$0096 \times 1,25 \geq 0396 + 0696 + 0996 + 1296$

$0312 + 0612 + 0912 + 1212 \geq 0,75 \times 0012$

.....

$0315 + 0615 + 0915 + 1215 \geq 0,75 \times 0015$

$0327 + 0627 + 0927 + 1227 \geq 0,75 \times 0027$

.....

$0330 + 0630 + 0930 + 1230 \geq 0,75 \times 0030$

$0342 + 0642 + 0942 + 1242 \geq 0,75 \times 0042$

.....

$0344 + 0644 + 0944 + 1244 \geq 0,75 \times 0044$

$0358 + 0658 + 0958 + 1258 \geq 0,75 \times 0058$

$0367 + 0667 + 0967 + 1267 \geq 0,75 \times 0067$

.....

$0370 + 0670 + 0970 + 1270 \geq 0,75 \times 0070$

$0377 + 0677 + 0977 + 1277 \geq 0,95 \times 0077$

.....

$0380 + 0680 + 0980 + 1280 \geq 0,95 \times 0080$

$0392 + 0692 + 0992 + 1292 \geq 0,75 \times 0092$

.....

$0394 + 0694 + 0994 + 1294 \geq 0,75 \times 0094$

$0001 \times 0,95 \leq |0201| + |0501| + |0801| + |1101| + |1401| + |1501| + |1601| + |1701| + |1801| + |1901| + |2001| + |2101| + |2201|$

.....

$0096 \times 0,95 \leq |0296| + |0596| + |0896| + |1196| + |1496| + |1596| + |1696| + |1796| + |1896| + |1996| + |2096| + |2196| + |2296|$

$0001 \times 1,4 \geq |0201| + |0501| + |0801| + |1101| + |1401| + |1501| + |1601| + |1701| + |1801| + |1901| + |2001| +$

T 3 0 5 2

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación**

(presentación semestral)

|2101| + |2201|

0012 x 1,4 ≥ |0212| + |0512| + |0812| + |1112| + |1412| + |1512| + |1612| + |1712| + |1812| + |1912| + |2012| + |2112| + |2212|

....

0015 x 1,4 ≥ |0215| + |0515| + |0815| + |1115| + |1415| + |1515| + |1615| + |1715| + |1815| + |1915| + |2015| + |2115| + |2215|

0042 x 1,4 ≥ |0242| + |0542| + |0842| + |1142| + |1442| + |1542| + |1642| + |1742| + |1842| + |1942| + |2042| + |2142| + |2242|

....

0044 x 1,4 ≥ |0244| + |0544| + |0844| + |1144| + |1444| + |1544| + |1644| + |1744| + |1844| + |1944| + |2044| + |2144| + |2244|

0046 x 1,4 ≥ |0246| + |0546| + |0846| + |1146| + |1446| + |1546| + |1646| + |1746| + |1846| + |1946| + |2046| + |2146| + |2246|

0050 x 1,4 ≥ |0250| + |0550| + |0850| + |1150| + |1450| + |1550| + |1650| + |1750| + |1850| + |1950| + |2050| + |2150| + |2250|

0058 x 1,4 ≥ |0258| + |0558| + |0858| + |1158| + |1458| + |1558| + |1658| + |1758| + |1858| + |1958| + |2058| + |2158| + |2258|

...

0060 x 1,4 ≥ |0260| + |0560| + |0860| + |1160| + |14600| + |1560| + |1660| + |1760| + |1860| + |1960| + |2060| + |2160| + |2260|

0067 x 1,4 ≥ |0267| + |0567| + |0867| + |1167| + |1467| + |1567| + |1667| + |1767| + |1867| + |1967| + |2067| + |2167| + |2267|

....

0070 x 1,4 ≥ |0270| + |0570| + |0870| + |1170| + |1470| + |1570| + |1670| + |1770| + |1870| + |1970| + |2070| + |2170| + |2270|

0092 x 1,4 ≥ |0292| + |0592| + |0892| + |1192| + |1492| + |1592| + |1692| + |1792| + |1892| + |1992| + |2092| + |2192| + |2292|

....

0094 x 1,4 ≥ |0294| + |0594| + |0894| + |1194| + |1494| + |1594| + |1694| + |1794| + |1894| + |1994| + |2094| + |2194| + |2294|

0096 x 1,4 ≥ |0296| + |0596| + |0896| + |1196| + |1496| + |1596| + |1696| + |1796| + |1896| + |1996| + |2096| + |2196| + |2296|

0027 x 2,2 ≥ |0227| + |0527| + |0827| + |1127| + |1427| + |1527| + |1627| + |1727| + |1827| + |1927| + |2027| + |2127| + |2227|

.....

0030 x 2,2 ≥ |0230| + |0530| + |0830| + |1130| + |1430| + |1530| + |1630| + |1730| + |1830| + |1930| + |2030| + |2130| + |2230|

T 3 0 5 2

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación**

(presentación semestral)

$0077 \times 2,2 \geq |0277| + |0577| + |0877| + |1177| + |1477| + |1577| + |1677| + |1777| + |1877| + |1977| + |2077| + |2177| + |2277|$

.....

$0080 \times 2,2 \geq |0280| + |0580| + |0880| + |1180| + |1480| + |1580| + |1680| + |1780| + |1880| + |1980| + |2080| + |2180| + |2280|$

$0016 \times 3,0 \geq |0216| + |0516| + |0816| + |1116| + |1416| + |1516| + |1616| + |1716| + |1816| + |1916| + |2016| + |2116| + |2216|$

$0031 \times 3,0 \geq |0231| + |0531| + |0831| + |1131| + |1431| + |1531| + |1631| + |1731| + |1831| + |1931| + |2031| + |2131| + |2231|$

$0035 \times 3,0 \geq |0235| + |0535| + |0835| + |1135| + |1435| + |1535| + |1635| + |1735| + |1835| + |1935| + |2035| + |2135| + |2235|$

$0045 \times 3,0 \geq |0245| + |0545| + |0845| + |1145| + |1445| + |1545| + |1645| + |1745| + |1845| + |1945| + |2045| + |2145| + |2245|$

$0071 \times 3,0 \geq |0271| + |0571| + |0871| + |1171| + |1471| + |1571| + |1671| + |1771| + |1871| + |1971| + |2071| + |2171| + |2271|$

$0081 \times 3,0 \geq |0281| + |0581| + |0881| + |1181| + |1481| + |1581| + |1681| + |1781| + |1881| + |1981| + |2081| + |2181| + |2281|$

$0085 \times 3,0 \geq |0285| + |0585| + |0885| + |1185| + |1485| + |1585| + |1685| + |1785| + |1885| + |1985| + |2085| + |2185| + |2285|$

$0095 \times 3,0 \geq |0295| + |0595| + |0895| + |1195| + |1495| + |1595| + |1695| + |1795| + |1895| + |1995| + |2095| + |2195| + |2295|$

$|0201| \geq |0301|$

.....

$|0235| \geq |0335|$

$|0501| \geq |0601|$

.....

$|0535| \geq |0635|$

$|0801| \geq |0901|$

.....

$|0835| \geq |0935|$

$|1101| \geq |1201|$

.....

$|1135| \geq |1235|$

Si la diferencia, tomada en valor absoluto, entre las claves 0041 y 0091 del RI2 en € es superior al 5% del menor de los importes declarados en las celdas 0041 y 0091, la entidad debe enviar una explicación de esta diferencia, que se entiende debe estar asociada a la existencia de Cross Currency Swaps. Este comentario explicativo debe incluirse en la clave 0041.

**Información sobre posiciones sensibles a los tipos de interés en actividades que no sean de la cartera de negociación****4. Relaciones con otros estados:**

Si hay una declaración del estado RI1 debe existir una declaración del RI2. Si hay una declaración del estado RI2 debe existir una declaración del RI3, aunque sea en blanco.

En la declaración del estado RI2 con cualquier identificador las divisas declaradas en ambos estados serán las mismas, excepto porque en el RI2 no se declarará 9001.