

ANEJO III

ESTADOS QUE HAY QUE REMITIR SOBRE RIESGO DE TIPO DE INTERÉS

INFORMACIÓN SOBRE ESTIMACIONES INTERNAS DEL RIESGO DE TIPO DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN ESTADO R14

Importes en miles de euros

[illegible]

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

ESTADO RI2.1

Importes en miles de euros

[illegible]

INFORMACIÓN SOBRE POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN (Continuación) ESTADO R12.2
Importes en miles de euros

DISTRIBUCIÓN DE LAS POSICIONES SENSIBLES A LOS TIPOS DE INTERÉS, EN ACTIVIDADES FUERA DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN, POR BANDAS DE REPRECIACIÓN																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																			
SALDO	TIPO DE INTERÉS MEDIO(%)	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		TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)		FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS		TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)		FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS		TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)		FLUJO DE PRINCIPAL E INTERÉS		TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																			
		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA		DEL QUE: PRINCIPAL QUE REPRECIA																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																					
																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																																			</

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

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

ESTADO RI2.4

Importes en miles de euros

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 (%)		VENCIMIENTO (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									
PASIVO																							
DEPÓSITOS DE BANCOS CENTRALES Y ENTIDADES DE CRÉDITO, CTA																							
DEPÓSITOS DE LA CLIENTELA RESIDENTES Y NO RESIDENTES																							
2.1. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO NO REMUNERADAS																							
2.2. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO REMUNERADAS, DE TIPO ADMINISTRADO																							
2.3. CUENTAS CORRIENTES Y DE AHORRO REFERENCIADAS A TIPO VARIABLE																							
2.4. DEPÓSITOS A PLAZO TRADICIONALES																							
2.5. DEPÓSITOS Y FONDOS TOMADOS CON REMUNERACIÓN FIJA O A Opciones																							
DEBITOS REFINANCIADOS POR VALORES NEGOCIABLES																							
3.1. VALORES DEL MERCADO MONETARIO Y VALORES A TIPO DE INTERÉS VARIABLE																							
3.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES																							
3.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES																							
3.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO																							
3.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN																							
3.2. VALORES DE TIPO DE INTERÉS FIJO																							
FRANCCIONES SUBORDINADAS (INCLUIDAS PARTICIPACIONES REFERENTES)																							
4.1. TÍTULOS EMITIDOS A TIPO DE INTERÉS VARIABLE																							
4.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES																							
4.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES																							
4.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO																							
4.1.4. OTRAS REFERENCIAS DE REPRECIACIÓN																							
4.2. TÍTULOS EMITIDOS A TIPO DE INTERÉS FIJO																							
OTROS PASIVOS SENSIBLES																							
DERIVADOS PARA LA GESTIÓN DEL RIESGO DE INTERÉS Y OTROS DERIVADOS QUE AFECTEN AL RIESGO DE INTERÉS																							
6.1. IRS Y CROSS CURRENCY SWAP																							
6.1.1. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO HASTA 3 MESES																							
6.1.2. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 6 MESES																							
6.1.3. REFERENCIADO A TIPO INTERBANCARIO A 1 AÑO																							
6.1.4. RESTO																							
FRAS, CALL MONEY SWAPS E FUTUROS INTERÉS, COMPRAVENTA DE DIVISA Y																							

INFORMACIÓN SOBRE OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN

ESTADO R3.1

DIVISA		DIFERENCIAL DE TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	PLAZO MEDIO DE VENCIMIENTO (MESES)	ANTIGÜEDAD MEDIA (MESES)	Importes en miles de euro	
IMPORTE TOTAL					COMISIÓN DE CANCELACIÓN (%)	
OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS 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 YA ACTIVADO)						
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.2. SUELOS A LA RENTABILIDAD (FLOORS COMPRADOS)						
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO A LA RENTABILIDAD YA ACTIVADO)						
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
2. OPCIONES DE CANCELACIÓN SOBRE VALORES A TIPO FIJO						
2.1. VALORES CON OPCIÓN DE AMORTIZACIÓN A FAVOR DEL EMISOR						
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES						
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES						
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 LOS VALORES						
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES						
2.2. VALORES CON OPCIÓN DE AMORTIZACIÓN A FAVOR DEL INVERSOR						
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES						
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES						
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						
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LOS VALORES						
3. PRÉSTAMOS A TIPO DE INTERÉS FIJO (A MÁS DE 5 AÑOS RESIDUALES)						
3.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS						
3.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS						
3.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS						
3.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE LOS PRÉSTAMOS						
4. OTRAS OPCIONES DE INTERÉS IMPLÍCITAS EN ACTIVOS						
OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS 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 YA ACTIVADO)						
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
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 YA ACTIVADO)						
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA						
2. OPCIONES DE CANCELACIÓN SOBRE EMISIONES A TIPO FIJO						
2.1. EMISIONES CON OPCIÓN DE CANCELACIÓN A FAVOR DE LA ENTIDAD						
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN						
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN						
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						
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN						
2.2. EMISIONES CON OPCIÓN DE CANCELACIÓN A FAVOR DEL INVERSOR						
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN						
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN						
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						
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS CONTRACTUAL DE LA EMISIÓN						
OTRAS OPCIONES DE INTERÉS IMPLÍCITAS EN PASIVOS						

ESTADO R13.2

INFORMACIÓN SOBRE OPCIONES DE TIPO DE INTERÉS EN ACTIVIDADES QUE NO SEAN DE LA CARTERA DE NEGOCIACIÓN (Continuación)

DIVISA		DIFERENCIAL DE TIPO DE INTERÉS MEDIO (%)	PLAZO MEDIO DE VENCIMIENTO (MESES)	ANTIGÜEDAD MEDIA (MESES)	COMISIÓN DE CANCELACIÓN (%)
IMPORTE TOTAL					
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)					
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.2. FLOORS COMPRADOS (DERECHO A COBRAR DIFERENCIAL POSITIVO ENTRE UN SUELO Y TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA)					
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO YA ACTIVADO)					
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
2. SWAPPTIONS					
2.1. SWAPTION COMPRADOS RECEIVER (DERECHO A INICIAR UN IRS COBRANDO UN TIPO FIJO PREFIJADO-TIPO DEL SWAPTION-)					
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
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					
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.2. SWAPTION COMPRADOS PAYER (DERECHO DE INICIAR IRS PAGANDO UN TIPO FIJO PREFIJADO-TIPO DEL SWAPTION-)					
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
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					
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
3. OTRAS OPCIONES COMPRADAS DE TIPO DE INTERÉS					
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 YA ACTIVADO)					
1.1.2. TECHO HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.1.3. TECHO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.1.4. TECHO A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.2. FLOORS VENDIDOS (OBLIGACIÓN A PAGAR DIFERENCIAL POSITIVO ENTRE UN SUELO Y TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA)					
1.2.1. SUELO POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA (SUELO YA ACTIVADO)					
1.2.2. SUELO HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.2.3. SUELO A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
1.2.4. SUELO A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DE REFERENCIA					
2. SWAPPTIONS					
2.1. SWAPTION VENDIDOS RECEIVER (OBLIGACIÓN DE INICIAR IRS COBRANDO UN TIPO FIJO PREFIJADO-TIPO DEL SWAPTION-)					
2.1.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.1.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.1.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.1.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.2. SWAPTION VENDIDOS PAYER (OBLIGACIÓN DE INICIAR IRS PAGANDO UN TIPO FIJO PREFIJADO-TIPO DEL SWAPTION-)					
2.2.1. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE POR DEBAJO DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.2.2. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE HASTA 200 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.2.3. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 200 P.B. Y HASTA 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
2.2.4. TIPO DE MERCADO EQUIVALENTE A MÁS DE 400 P.B. POR ENCIMA DEL TIPO DE INTERÉS DEL SWAPTION					
OTRAS OPCIONES VENDIDAS SOBRE TIPO DE INTERÉS					