

## Contenido

<b>Resumen del proceso de Autoevaluación del Capital [3104]</b> .....	2
<b>Resumen del Proceso de Autoevaluación del Capital - Planificación ordinaria [3105]</b> .....	7
<b>Planificación del Capital - Evolución de los RR.PP. en escenarios de tensión [3106]</b> .....	8
<b>Planificación del Capital - Fuentes alternativas de capital [3107]</b> .....	9

# CUADRES Y RELACIONES DE LOS ESTADOS

## Informe de Autoevaluación de Capital

### Resumen del proceso de Autoevaluación del Capital [3104]

[\(Volver a la Tabla de Contenido\)](#)

#### **R100. Cuadros internos**

##### **b0001\_m (1 control)**

$$\{c0061\} = \text{sum}(\{c[0062-0064]\})$$

##### **b0002\_m (1 control)**

$$\{c0115\} = \text{sum}(\{c[0116, 0126, 0130, 0139]\})$$

##### **b0003\_m (1 control)**

$$\{c0130\} = \text{sum}(\{c[0131-0133]\})$$

##### **b0004\_m (1 control)**

$$\{c0215\} = \text{sum}(\{c[0216, 0226, 0230, 0234, 0235, 0239]\})$$

##### **b0005\_m (1 control)**

$$\{c0230\} = \text{sum}(\{c[0231-0233]\})$$

##### **b0006\_m (1 control)**

$$\{c0235\} = \text{sum}(\{c[0236-0238]\})$$

##### **b0007\_m (1 control)**

$$\{c0244\} = \text{sum}(\{c[0215, 0240]\})$$

##### **b0008\_m (1 control)**

$$\{c0116\} \geq \text{sum}(\{c[0117-0119]\})$$

##### **b0009\_m (1 control)**

$$\{c0116\} \geq \text{sum}(\{c[0120, 0124]\})$$

**b0010\_m (1 control)**

{c0120} >= sum({c[0121-0123]})

**b0011\_m (1 control)**

{c0126} >= sum({c[0127, 0128]})

**b0012\_m (1 control)**

{c0126} >= {c0129}

**b0013\_m (1 control)**

{c0216} >= sum({c[0217-0219]})

**b0014\_m (1 control)**

{c0216} >= sum({c[0220, 0224]})

**b0015\_m (1 control)**

{c0220} >= sum({c[0221-0223]})

**b0016\_m (1 control)**

{c0226} >= sum({c[0227, 0228]})

**b0017\_m (1 control)**

{c0226} >= {c0229}

**b0018\_m (71 controles)**

Las claves 0240, 0241, 0242 y 0243 pueden ser negativas

c[0001-0224, 0226-0239, 0244] : {R100} >= 0

**b0019\_m (1 control)**

La clave 0225, en caso de tener importe, será obligatoriamente negativa

c0225 : efn:imp(exists(R100), R100 < 0)

**b0020\_m (6 controles)**

Las siguientes claves deben llevar importe:

R100 : exists({c[0001-0010, 0062, 0215, 0244]}) and count({c[0001-0010, 0062, 0215, 0244]}) = 6

**b0021\_m (7 controles)**

Las claves 0118, 0119, 0120, 0121, 0122, 0123 y 0128 solo podrán tener importe en aquellos Bancos, Cajas de Ahorros y Cooperativas de Crédito que utilicen modelos IRB.

c[0118-0123, 0128] : exists(R100) and count(\$att\_so\_mirb) > 0

#### **b0022\_m (1 control)**

La clave 0132 solo puede tener importe en aquellos Bancos, Cajas de Ahorros y Cooperativas de Crédito que utilicen el método estándar para el cálculo de requerimientos por riesgo operacional.

exists({c0132}) and count(\$att\_so\_c16) > 0

#### **b0023\_m (1 control)**

La clave 0133 solo podrá tener importe en aquellas entidades que utilicen modelos avanzados para el cálculo de requerimientos por riesgo operacional.

exists({c0133}) and count(\$att\_so\_c16) > 0

#### **b0045\_m (13 controles)**

Para los Bancos, Cajas de Ahorro y Cooperativas de Crédito las claves 0168, 0169, 0171, 0172, 0173, 0178, 0218, 0219, 0220, 0221, 0222, 0223 y 0228 solo pueden tener importe en aquellas entidades autorizadas a modelos internos.

c[0168-0173, 0178, 0218-0223, 0228] : exists(R100) and count(\$att\_so\_mirb) > 0

#### **b0046\_m (2 controles)**

Para los Bancos, Caja de Ahorro y Cooperativas de Crédito las claves 0182 y 0232 solo pueden tener importe en aquellas entidades autorizadas al Método Estándar por Riesgo Operacional.

c[0182, 0232] : exists(R100) and count(\$att\_so\_c16) > 0

#### **b0047\_m (2 controles)**

Para los Bancos, Cajas de Ahorro y Cooperativas de Crédito las claves 0183 y 0233 solo pueden tener importe en aquellas entidades autorizadas a Modelos Avanzados.

c[0183, 0233] : exists(R100) and count(\$att\_so\_c16) > 0

### **R100. Relaciones con otras tablas: C 01.00**

#### **b0027\_m (1 control)**

{R100, c0061} = {C\_42.00, c0004}{C\_01.00, c0001}

**b0028\_m (1 control)**

$$\{R100, c0062\} = \{C\_42.00, c0002\}\{C\_01.00, c0003\}$$

**b0029\_m (1 control)**

$$\{R100, c0063\} = \{C\_01.00, c0057\}$$

**b0030\_m (1 control)**

$$\{R100, c0064\} = \{C\_01.00, c0078\}$$

**R100. Relaciones con otras tablas: C 02.00****b0031\_m (1 control)**

$$\{R100, c0115\} = (\{C\_02.00\}\{c0001\} - \{c0047\}) * 0.08$$

**b0032\_m (1 control)**

$$\{R100, c0116\} = (\{C\_02.00\}\text{sum}(\{c[0004, 0063]\}) - \{c0047\}) * 0.08$$

**b0033\_m (1 control)**

$$\{R100, c0117\} = \{C\_02.00, c0005\} * 0.08$$

**b0034\_m (1 control)**

$$\text{sum}(\{R100, c[0118, 0119]\}) = \{C\_02.00, c0025\} * 0.08$$

**b0035\_m (1 control)**

$$\text{sum}(\{R100, c[0121-0123]\}) = \{C\_10.01, c0701\}\{C\_02.00, c0043\} * 0.08$$

**b0036\_m (1 control)**

$$\{R100, c0124\} \leq \text{sum}(\{C\_07.00.a, c0841, z1:017\}\{C\_02.00, c0022\}\{C\_02.00, c0046\}) * 0.08$$

**b0037\_m (1 control)**

$$\{R100, c0126\} = \text{sum}(\{C\_02.00, c[0048, 0051]\}) * 0.08$$

**b0038\_m (1 control)**

$$\{R100, c0127\} = \{C\_02.00, c0052\} * 0.08$$

**b0039\_m (1 control)**

$\{R100, c0128\} = \{C\_24.00, c1001\}\{C\_02.00, c0057\} * 0.08$

**b0040\_m (1 control)**

$\{R100, c0130\} = \{C\_02.00, c0058\} * 0.08$

**b0041\_m (1 control)**

$\{R100, c0131\} = \{C\_16.00.a, c0211\}\{C\_02.00, c0059\} * 0.08$

**b0042\_m (1 control)**

$\{R100, c0132\} = \{C\_16.00.a, c0212\}\{C\_02.00, c0060\} * 0.08$

**b0043\_m (1 control)**

$\{R100, c0133\} = \{C\_02.00, c0061\} * 0.08$

**b0044\_m (1 control)**

$\{R100, c0139\} = \text{sum}(\{C\_02.00, c[0062, 0067, 0068]\}) * 0.08$

**R100. Relaciones con otras tablas: C 03.00**

**b0024\_m (1 control)**

$\{R100, c0001\} = \{C\_03.00, c0005\}$

**b0025\_m (1 control)**

$\{R100, c0002\} = \{C\_03.00, c0003\}$

**b0026\_m (1 control)**

$\{R100, c0010\} = \{C\_03.00, c0001\}$

[\(Volver a la Tabla de Contenido\)](#)

# Resumen del Proceso de Autoevaluación del Capital - Planificación ordinaria [3105]

[\(Volver a la Tabla de Contenido\)](#)

## **R101. Cuadros internos**

### **b0049\_m (1 control)**

Debe existir importe en al menos una de las siguientes claves: 0001, 0002, 0004

```
count({c[0001-0004]}[. != 0]) = 3
```

### **b0050\_m (1 control)**

Si existe importe en la clave 0001, debe existir obligatoriamente importe en las claves 0006, 0011, 0016, 0021, 0026, 0031, 0036 y 0041

```
efn:imp({c0001} ne 0, some $i in {c[0006, 0011, 0016, 0021, 0026, 0031, 0036, 0041]}  
satisfies ({c[0006, 0011, 0016, 0021, 0026, 0031, 0036, 0041]} ne 0))
```

### **b0051\_m (1 control)**

Si existe importe en la clave 0004, debe existir obligatoriamente importe en las claves 0014, 0019, 0029, 0034 y 0044

```
efn:imp({c0004} ne 0, some $i in {c[0014, 0019, 0029, 0034, 0044]} satisfies ({c[0014, 0019,  
0029, 0034, 0044]} ne 0))
```

### **b0052\_m (1 control)**

Si existe importe en la clave 0002, debe existir obligatoriamente importe en las claves 0012, 0017, 0027, 0032 y 0042

```
efn:imp({c0002} ne 0, some $i in {c[0012, 0017, 0027, 0032, 0042]} satisfies ({c[0012, 0017,  
0027, 0032, 0042]} ne 0))
```

# Planificación del Capital - Evolución de los RR.PP. en escenarios de tensión [3106]

[\(Volver a la Tabla de Contenido\)](#)

## **R102. Cuadros internos**

### **b0053\_m (1 control)**

En las filas correspondientes a Concepto deberá figurar obligatoriamente un nombre

ID:\* : efn:imp(some \$i in {c[0030-0110]} satisfies ({c[0030-0110]} ne 0),{c0020} R102 != 0 and string-length(R102) > 1)

### **b0054\_m (1 control)**

En la primera columna deberá figurar obligatoriamente un número

ID:\* : substring(distinct-values(for \$i in {c\*} return xfi:fact-typed-dimension-value(\$i, xs:QName('es\_dim:ID'))/child::\* /text()), 1, 1) = ('1', '2', '3', '4', '5', '6', '7', '8', '9') or substring(distinct-values(for \$i in {c\*} return xfi:fact-typed-dimension-value(\$i, xs:QName('es\_dim:ID'))/child::\* /text()), 1, 2) = ('10', '11', '12', '13', '14', '15', '16', '17', '18', '19', '20', '21', '22', '23', '24', '25', '26', '27', '28', '29', '30', '31', '32', '33', '34', '35', '36', '37', '38', '39', '40', '41', '42', '43', '44', '45', '46', '47', '48', '49', '50', '51', '52', '53', '54', '55', '56', '57', '58', '59', '60', '61', '62', '63', '64', '65', '66', '67', '68', '69', '70', '71', '72', '73', '74', '75', '76', '77', '78', '79', '80', '81', '82', '83', '84', '85', '86', '87', '88', '89', '90', '91', '92', '93', '94', '95', '96', '97', '98', '99') and not(substring(distinct-values(for \$i in {c\*} return xfi:fact-typed-dimension-value(\$i, xs:QName('es\_dim:ID'))/child::\* /text()), 3, 1) = ('1', '2', '3', '4', '5', '6', '7', '8', '9'))



# Planificación del Capital - Fuentes alternativas de capital [3107]

[\(Volver a la Tabla de Contenido\)](#)

## **R103. Cuadros internos**

### **b0055\_m (4 controles)**

Para cada una de las columnas excepto la columna de concepto, la fila 9001 será igual a la suma de los importes del resto de filas

$c[0030-0060], ID:* : \text{sum}(R103) = R103$

### **b0056\_m (4 controles)**

Los importes reflejados en las columnas 1, 2, 3 y 4 deberán ser obligatoriamente positivos

$c[0030-0060] : \{ID:*\} \geq 0$

### **b0057\_m (1 control)**

Si se declara la columna de Concepto debe declararse al menos una de las siguientes columnas: 1, 2, 3, 4

### **b0058\_m (1 control)**

Si existe al menos una fila con datos de una "Fuente alternativa de capital" debe existir una fila totalizadora (9001), y viceversa

### **b0059\_m (1 control)**

En la columna de Concepto deberá figurar obligatoriamente un texto

### **b0060\_m (1 control)**

En la columna correspondiente a Fuentes alternativas de capital (primera columna) deberá figurar obligatoriamente un número

### **b0061\_m (1 control)**

La columna de Concepto debe declararse siempre que se reporte una fila