

Contenido

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

$$c020 : \{r050\} = \text{sum}(\{r[060, 070, 080]\})$$

b0002_m (1 control)

$$c030 : \{r090\} = \text{sum}(\{r[100, 200, 240, 330]\})$$

b0003_m (1 control)

$$c030 : \{r240\} = \text{sum}(\{r[250-270]\})$$

b0004_m (1 control)

$$c050 : \{r090\} = \text{sum}(\{r[100, 200, 240, 280, 290, 330]\})$$

b0005_m (1 control)

$$c050 : \{r240\} = \text{sum}(\{r[250-270]\})$$

b0006_m (1 control)

$$c050 : \{r290\} = \text{sum}(\{r[300-320]\})$$

b0007_m (1 control)

$$c050 : \{r380\} = \text{sum}(\{r[090, 340]\})$$

b0008_m (1 control)

$$c030 : \{r100\} \geq \text{sum}(\{r[110-130]\})$$

b0009_m (1 control)

$$c030 : \{r100\} \geq \text{sum}(\{r[140, 180]\})$$

b0010_m (1 control)

c030 : {r140} >= sum({r[150-170]})

b0011_m (1 control)

c030 : {r200} >= sum({r[210, 220]})

b0012_m (1 control)

c030 : {r200} >= {r230}

b0013_m (1 control)

c050 : {r100} >= sum({r[110-130]})

b0014_m (1 control)

c050 : {r100} >= sum({r[140, 180]})

b0015_m (1 control)

c050 : {r140} >= sum({r[150-170]})

b0016_m (1 control)

c050 : {r200} >= sum({r[210, 220]})

b0017_m (1 control)

c050 : {r200} >= {r230}

b0018_m (71 controles)

Las filas 0340, 0350, 0360 y 0370 para la columna 050 pueden ser negativas

r[020, 030, 040] : {c010} >= 0
r[050, 060, 070, 080] : {c020} >= 0
r[090, 100-180, 200-270, 330] : {c030} >= 0
r[110-130, 150-190, 210-230, 250-280, 300-330] : {c040} >= 0
r[090, 100-180, 200-330, 380] : {c050} >= 0

b0019_m (1 control)

Si existe, c050, r190 debe tener importe negativo

c050, r190 : efn:imp(exists(R100), R100 < 0)

b0020_m (6 controles)

Las siguientes claves deben reportarse siempre:

R100 : exists({c010, r020}{c010, r040}{c010, r030}{c020, r060}{c050, r090}{c050, r380}) and count({c010, r020}{c010, r040}{c010, r030}{c020, r060}{c050, r090}{c050, r380}) = 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.

r[120-170, 220] : exists({c030}) 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({c030, r260}) 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({c030, r270}) 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.

r[120, 130, 150-170, 220] : exists({c040}) and count(\$att_so_mirb) > 0
r[120-170, 220] : exists({c050}) 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[040, 050] : exists({r260}) 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[040, 050] : exists({r270}) and count(\$att_so_c16) > 0

R100. Relaciones con otras tablas: C 01.00

b0027_m (1 control)

$$\{R100, c020, r050\} = \{c010\}\{C_42.00, r040\}\{C_01.00, r010\}$$

b0028_m (1 control)

$$\{R100, c020, r060\} = \{c010, r020\}\{C_42.00\}\{C_01.00\}$$

b0029_m (1 control)

$$\{R100, c020, r070\} = \{C_01.00, c010, r530\}$$

b0030_m (1 control)

$$\{R100, c020, r080\} = \{C_01.00, c010, r750\}$$

R100. Relaciones con otras tablas: C 02.00

b0031_m (1 control)

$$\{R100, c030, r090\} = (\{C_02.00, c010\}\{r010\} - \{r460\}) * 0.08$$

b0032_m (1 control)

$$\{R100, c030, r100\} = (\{C_02.00, c010\}\text{sum}(\{r[040, 640]\}) - \{r460\}) * 0.08$$

b0033_m (1 control)

$$\{R100, c030, r110\} = \{C_02.00, c010, r050\} * 0.08$$

b0034_m (1 control)

$$\text{sum}(\{R100, c030, r[120, 130]\}) = \{C_02.00, c010, r240\} * 0.08$$

b0035_m (1 control)

$$\text{sum}(\{R100, c030, r[150-170]\}) = \{C_10.01, c080, r010\}\{C_02.00, c010, r420\} * 0.08$$

b0036_m (1 control)

$$\{R100, c030, r180\} \leq \text{sum}(\{C_07.00.a, c220, r010, z1:017\}\{C_02.00, c010, r211\}\{C_02.00, c010, r450\}) * 0.08$$

b0037_m (1 control)

{R100, c030, r200} = sum({C_02.00, c010, r[490, 520]}) * 0.08

b0038_m (1 control)

{R100, c030, r210} = {C_02.00, c010, r530} * 0.08

b0039_m (1 control)

{R100, c030, r220} = {C_24.00, c130, r010}{C_02.00, c010, r580} * 0.08

b0040_m (1 control)

{R100, c030, r240} = {C_02.00, c010, r590} * 0.08

b0041_m (1 control)

{R100, c030, r250} = {C_16.00.a, c071, r010}{C_02.00, c010, r600} * 0.08

b0042_m (1 control)

{R100, c030, r260} = {C_16.00.a, c071, r020}{C_02.00, c010, r610} * 0.08

b0043_m (1 control)

{R100, c030, r270} = {C_02.00, c010, r620} * 0.08

b0044_m (1 control)

{R100, c030, r330} = sum({C_02.00, c010, r[630, 680, 690]}) * 0.08

R100. Relaciones con otras tablas: C 03.00

b0024_m (1 control)

c010 : {R100, r020} = {C_03.00, r050}

b0025_m (1 control)

c010, r030 : {R100} = {C_03.00}

b0026_m (1 control)

c010 : {R100, r040} = {C_03.00, r010}

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

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

$$\text{count}(\{c2, r^*\}[\neq 0]) = 3$$

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

$$r010 : \text{efn:imp}\{c2\} \neq 0, \text{ some } \$i \text{ in } \{c[3-10]\} \text{ satisfies } (\{c[3-10]\} \neq 0)$$

b0051_m (1 control)

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

$$r020 : \text{efn:imp}\{c2\} \neq 0, \text{ some } \$i \text{ in } \{c[4, 5, 7, 8, 10]\} \text{ satisfies } (\{c[4, 5, 7, 8, 10]\} \neq 0)$$

b0052_m (1 control)

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

$$r030 : \text{efn:imp}\{c2\} \neq 0, \text{ some } \$i \text{ in } \{c[4, 5, 7, 8, 10]\} \text{ satisfies } (\{c[4, 5, 7, 8, 10]\} \neq 0)$$

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

r, ID:* : efn:imp(some \$i in {c[3-16]} satisfies ((c[3-16]} ne 0),{c1} R102 != 0 and string-length(R102) > 1)

b0054_m (1 control)

En la primera columna deberá figurar obligatoriamente un número

r, 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

$c[1-4], r, ID:* : \text{sum}(R103) = R103$

b0056_m (4 controles)

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

$c[1-4] : \{r, ID:* \} \geq 0$

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