

INFORME DE CUADRES Y RELACIONES DE LOS ESTADOS

Septiembre 2023

Taxonomía: LQBG_LQIM_2023-03 - Información sobre el Conjunto de Cobertura de Liquidez de los bonos garantizados y otros instrumentos de movilización de préstamos

LQB_1 Colchón de liquidez bonos garantizados - Activos, exposiciones y depósitos a corto plazo [3071]

LQB_2 Colchón de liquidez bonos garantizados - Salidas [3072]

LQB_3.a Colchón de liquidez bonos garantizados - Cálculo - Importe [3073]

LQB_3.b Colchón de liquidez bonos garantizados - Cálculo - Porcentaje [3073]

Taxonomía: LQBG_LQIM_2023-03 - Información sobre el Conjunto de Cobertura de Liquidez de los bonos garantizados y otros instrumentos de movilización de préstamos

LQB_1 Colchón de liquidez bonos garantizados - Activos, exposiciones y depósitos a corto plazo [3071]

LQB_1. Cuadros internos

- **b0001_m (12 evaluaciones, Exacto)**
r[0060, 0070, 0080, 0090, 0100, 0110, 0120, 0130, 0140, 0150, 0170, 0460] : {c0020, CCC:*} = 1
- **b0002_m (1 evaluación, Exacto)**
{c0020, r0160, CCC:*} = 0.95
- **b0003_m (2 evaluaciones, Exacto)**
r[0190, 0340] : {c0020, CCC:*} = 0.8
- **b0004_m (1 evaluación, Exacto)**
{c0020, r0220, CCC:*} = 0.93
- **b0005_m (1 evaluación, Exacto)**
{c0020, r0230, CCC:*} = 0.88
- **b0006_m (5 evaluaciones, Exacto)**
r[0290, 0300, 0310, 0320, 0330] : {c0020, CCC:*} = 0.85

- **b0007_m (4 evaluaciones, Exacto)**
 $r[0380, 0390, 0510, 0520] : \{c0020, CCC:* \} = 0.75$
- **b0008_m (2 evaluaciones, Exacto)**
 $r[0400, 0470] : \{c0020, CCC:* \} = 0.7$
- **b0009_m (2 evaluaciones, Exacto)**
 $r[0410, 0480] : \{c0020, CCC:* \} = 0.65$
- **b0010_m (4 evaluaciones, Exacto)**
 $r[0420, 0430, 0440, 0450] : \{c0020, CCC:* \} = 0.5$
- **b0011_m (1 evaluación, Exacto)**
 $\{c0020, r0490, CCC:* \} = 0.6$
- **b0012_m (1 evaluación, Exacto)**
 $\{c0020, r0500, CCC:* \} = 0.45$
- **b0016_m (1 evaluación, Exacto)**
 $\{c0060, r0650, CCC:* \} \geq 0$
- **b0017_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0010\} = \{r0030\} + \{r0250\}$
- **b0018_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0030\} = \{r0050\} + \{r0200\}$
- **b0019_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0050\} = \text{sum}(\{r[0060, 0070, 0080, 0090, 0100, 0110, 0120, 0130, 0140, 0150, 0160, 0170, 0180, 0190]\})$
- **b0020_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0200\} = \text{sum}(\{r[0220, 0230, 0240]\})$
- **b0021_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0250\} = \{r0270\} + \{r0360\}$
- **b0022_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0270\} = \text{sum}(\{r[0290, 0300, 0310, 0320, 0330, 0340, 0350]\})$
- **b0023_m (2 evaluaciones, Auto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* : \{r0360\} = \text{sum}(\{r[0380, 0390, 0400, 0410, 0420, 0430, 0440, 0450, 0460, 0470, 0480, 0490, 0500, 0510, 0520, 0530]\})$
- **b0024_m (12 evaluaciones, Exacto)**
 $c[0010, 0030], CCC:* :$
 $\{r0030\} \geq \{r0040\}$
 $\{r0270\} \geq \{r0280\}$
 $\{r0360\} \geq \{r0370\}$
 $\{r0200\} \geq \{r0210\}$

$\{r0250\} \geq \{r0260\}$
 $\{r0010\} \geq \{r0020\}$

- **b0025_m (1 evaluación, Auto)**

$c0040, CCC:* : \{r0540\} = \text{sum}(\{r[0550, 0560, 0570, 0580, 0590]\})$

- **b0026_m (65 evaluaciones, Exacto)**

$CCC:* :$

$r0660 : \{c0050\} > 0$

$r[0010, 0020, 0030, 0040, 0050, 0060, 0070, 0080, 0090, 0100, 0110, 0120, 0130, 0140, 0150, 0160, 0170, 0180, 0190, 0200, 0210, 0220, 0230, 0240, 0250, 0260, 0270, 0280, 0290, 0300, 0310, 0320, 0330, 0340, 0350, 0360, 0370, 0380, 0390, 0400, 0410, 0420, 0430, 0440, 0450, 0460, 0470, 0480, 0490, 0500, 0510, 0520, 0530] : \{c0010\} > 0$

$r[0540, 0550, 0560, 0570, 0580, 0590, 0600, 0610, 0620, 0630, 0640] : \{c0040\} > 0$

- **b0032_m (1 evaluación, Exacto)**

La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta

- **b0043_m (53 evaluaciones, Auto)**

$r[0010, 0020, 0030, 0040, 0050, 0060, 0070, 0080, 0090, 0100, 0110, 0120, 0130, 0140, 0150, 0160, 0170, 0180, 0190, 0200, 0210, 0220, 0230, 0240, 0250, 0260, 0270, 0280, 0290, 0300, 0310, 0320, 0330, 0340, 0350, 0360, 0370, 0380, 0390, 0400, 0410, 0420, 0430, 0440, 0450, 0460, 0470, 0480, 0490, 0500, 0510, 0520, 0530], CCC:* : \{c0030\} = \{c0010\} * \{c0020\}$

- **b0045_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0003 es distinta de 0

$CCC:* : \{c0020, r0030\} = ((\{r0050\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0200\}\{c0020\} * \{c0010\})) \text{ div } \{c0010, r0030\}$

- **b0047_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0025 es distinta de 0

$CCC:* : \{c0020, r0250\} = ((\{r0270\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0360\}\{c0020\} * \{c0010\})) \text{ div } \{c0010, r0250\}$

- **b0049_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0001 es distinta de 0

$CCC:* : \{c0020, r0010\} = ((\{r0030\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0250\}\{c0020\} * \{c0010\})) \text{ div } \{c0010, r0010\}$

- **b0074_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0005 es distinta de 0

$$\text{CCC:*} : \{c0020, r0050\} = ((\{r0060\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0070\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0080\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0090\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0100\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0110\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0120\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0130\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0140\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0150\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0160\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0170\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0180\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0190\}\{c0020\} * \{c0010\})) \text{div} \{c0010, r0050\}$$

- **b0076_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0020 es distinta de 0

$$\text{CCC:*} : \{c0020, r0200\} = ((\{r0220\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0230\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0240\}\{c0020\} * \{c0010\})) \text{div} \{c0010, r0200\}$$

- **b0080_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0036 es distinta de 0

$$\text{CCC:*} : \{c0020, r0360\} = ((\{r0380\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0390\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0400\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0410\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0420\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0430\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0440\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0450\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0460\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0470\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0480\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0490\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0500\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0510\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0520\}\{c0020\} * \{c0010\}) + (\{r0530\}\{c0020\} * \{c0010\})) \text{div} \{c0010, r0360\}$$

- **b0084_m (2 evaluaciones, Auto)**

$$c\{0010, 0030\}, \text{CCC:*} : \{r0020\} = \{r0040\} + \{r0260\}$$

- **b0085_m (2 evaluaciones, Auto)**

$$c\{0010, 0030\}, \text{CCC:*} : \{r0260\} = \{r0280\} + \{r0370\}$$

- **b0086_m (1 evaluación, Auto)**

$$c0010, \text{CCC:*} : \{r0040\} \geq \{r0210\}$$

- **b0090_m (1 evaluación, Exacto)**

La celda 0564 delLQB1 y la celda 0001 delLQB_3.a deben reportarse siempre

- **b0093_m (53 evaluaciones, Exacto)**

$$r\{0010, 0020, 0030, 0040, 0050, 0060, 0070, 0080, 0090, 0100, 0110, 0120, 0130, 0140, 0150, 0160, 0170, 0180, 0190, 0200, 0210, 0220, 0230, 0240, 0250, 0260, 0270, 0280, 0290, 0300, 0310, 0320, 0330, 0340, 0350, 0360, 0370, 0380, 0390, 0400, 0410, 0420, 0430, 0440, 0450, 0460, 0470, 0480, 0490, 0500, 0510, 0520, 0530\}, \text{CCC:*} : \text{efn:iff}(\{c0010\}>0, \{c0020\}>0)$$

- **b0108_m (6 evaluaciones, Exacto)**

$$r\{0020, 0040, 0210, 0260, 0280, 0370\} : \{c0020, \text{CCC:*}\} \leq 1$$

- **b0109_m (106 evaluaciones, Exacto)**

c[0020, 0030], r[0010, 0020, 0030, 0040, 0050, 0060, 0070, 0080, 0090, 0100, 0110, 0120, 0130, 0140, 0150, 0160, 0170, 0180, 0190, 0200, 0210, 0220, 0230, 0240, 0250, 0260, 0270, 0280, 0290, 0300, 0310, 0320, 0330, 0340, 0350, 0360, 0370, 0380, 0390, 0400, 0410, 0420, 0430, 0440, 0450, 0460, 0470, 0480, 0490, 0500, 0510, 0520, 0530] : {CCC:*} >=0

- **b0113_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {c0040, r0600} = 0.15 * {c0050, r0660}
- **b0114_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {c0040, r0610} = 0.10 * {c0050, r0660}
- **b0115_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {c0040, r0620} = 0.08 * {c0050, r0660}
- **b0116_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {c0040, r0630} = 0.1 * {c0050, r0660}
- **b0117_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {c0040, r0640} = 0.15 * {c0050, r0660}
- **b0118_m (1 evaluación, Auto)**
c0040, CCC:* : sum({r[0550, 0570]}) <= {r0600}
- **b0119_m (1 evaluación, Auto)**
c0040, CCC:* : sum({r[0560, 0580]}) <= {r0610}
- **b0120_m (1 evaluación, Auto)**
c0040, CCC:* : {r0590} <= {r0620}
- **b0121_m (1 evaluación, Auto)**
c0040, CCC:* : sum({r[0560, 0580, 0590]}) <= {r0630}
- **b0122_m (1 evaluación, Auto)**
c0040, CCC:* : sum({r[0550, 0560, 0570, 0580, 0590]}) <= {r0640}
- **b0133_m (1 evaluación, Exacto)**
Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.
- **b0139_m (1 evaluación, Exacto)**
La celda 0465 debe reportarse siempre
- **b0141_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0027 es distinta de 0

CCC:* : {c0020, r0270} = ((({r0290}{c0020} * {c0010}) + ({r0300}{c0020} * {c0010}) +
({r0310}{c0020} * {c0010}) + ({r0320}{c0020} * {c0010}) + ({r0330}{c0020} * {c0010}) +
({r0340}{c0020} * {c0010}) + ({r0350}{c0020} * {c0010})) div {c0010, r0270}

- **b0144_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {c0060, r0650} = sum({c0030, r0010}{c0040, r0540})

LQB_1. Relaciones con otras tablas: BG_2-1

- **b0087_m (1 evaluación, Auto)**
CCC:* : {LQB_1, c0050, r0660} = {BG_2-1, c0020, r0020}

LQB_1. Relaciones con otras tablas: LQB_2

- **b0031_m (1 evaluación, Auto)**
c0010, r0020, CCC:* : {LQB_1} <= {LQB_2}
- **b0092_m (1 evaluación, Exacto)**
c0010, r0020, CCC:* : efn:iff({LQB_1}>0,{LQB_2}>0)

LQB_1. Relaciones con otras tablas: LQB_2, LQB_3.b

- **b0027_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0002 del estado LQB 3.a es distinta de 0

CCC:* : {LQB_3.b, c0020, r0030} = {LQB_1, c0060, r0650} div {LQB_2, c0010, r0010}

- **b0034_m (1 evaluación, Exacto)**
La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta
- **b0039_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez es mayor que 0 y la Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir es 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:*} = 999999.00

- **b0135_m (1 evaluación, Exacto)**
Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.
- **b0148_m (1 evaluación, Exacto)**
CCC:* : if({LQB_1, c0060, r0650} = 0 and {LQB_2, c0010, r0010} = 0) then ({LQB_3.b, c0020, r0030} = 0) else true()

- **IN_LQB (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez y Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir son mayores que 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:*} >= 1

LQB_2 Colchón de liquidez bonos garantizados - Salidas [3072]

LQB_2. Cuadros internos

- **b0013_m (2 evaluaciones, Exacto)**
r[0010, 0020] : {c0010, CCC:*} >=0

- **b0014_m (1 evaluación, Exacto)**
{c0010, r0030, CCC:*} >0

- **b0015_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- La celda 0001 es mayor que 0

La celda 0004 debe reportarse siempre

- **b0033_m (1 evaluación, Exacto)**
La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta
- **b0071_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El importe en la celda 0001 "Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir (b)" es superior a 0

La fecha reportada debe estar entre la fecha de referencia y los 180 días siguientes

- **b0091_m (1 evaluación, Exacto)**
La celda 0001 del LBQ2 y la celda 0002 del LBQ_3.a deben reportarse siempre
- **b0134_m (1 evaluación, Exacto)**
Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.
- **b0147_m (1 evaluación, Exacto)**
c0010, CCC:* : if({r0010}=0) then (empty({r0040}))else true()

LQB_2. Relaciones con otras tablas: LQB_1

- **b0031_m (1 evaluación, Auto)**
c0010, r0020, CCC:* : {LQB_1} <= {LQB_2}
- **b0092_m (1 evaluación, Exacto)**
c0010, r0020, CCC:* : efn:iff({LQB_1}>0,{LQB_2}>0)

LQB_2. Relaciones con otras tablas: LQB_1, LQB_3.b

- **b0027_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0002 del estado LQB 3.a es distinta de 0

CCC:* : {LQB_3.b, c0020, r0030} = {LQB_1, c0060, r0650} div {LQB_2, c0010, r0010}

- **b0034_m (1 evaluación, Exacto)**

La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta

- **b0039_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez es mayor que 0 y la Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir es 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:*} = 999999.00

- **b0135_m (1 evaluación, Exacto)**

Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.

- **b0148_m (1 evaluación, Exacto)**

CCC:* : if({LQB_1, c0060, r0650} = 0 and {LQB_2, c0010, r0010} = 0) then ({LQB_3.b, c0020, r0030} = 0) else true()

- **IN_LQB (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez y Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir son mayores que 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:*} >= 1

LQB_3.a Colchón de liquidez bonos garantizados - Cálculo - Importe [3073]

LQB_3.a. Cuadros internos

- **b0013_m (1 evaluación, Exacto)**

{c0010, r0020, CCC:*} >= 0

- **b0016_m (1 evaluación, Exacto)**

{c0010, r0010, CCC:*} >= 0

LQB_3.a. Relaciones con otras tablas: LQB_3.b

- **b0027_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0002 del estado LQB 3.a es distinta de 0

CCC:* : {LQB_3.b, c0020, r0030} = {LQB_3.a, c0010} {r0010} div {r0020}

- **b0034_m (1 evaluación, Exacto)**

La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta

- **b0039_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez es mayor que 0 y la Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir es 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:* } = 999999.00

- **b0135_m (1 evaluación, Exacto)**

Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.

- **b0148_m (1 evaluación, Exacto)**

CCC:* : if({LQB_3.a, c0010}{r0010} = 0 and {r0020} = 0) then ({LQB_3.b, c0020, r0030} = 0) else true()

- **IN_LQB (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez y Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir son mayores que 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:* } >= 1

LQB_3.b Colchón de liquidez bonos garantizados - Cálculo - Porcentaje [3073]

LQB_3.b.Relaciones con otras tablas: LQB_3.a

- **b0027_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0002 del estado LQB 3.a es distinta de 0

CCC:* : {LQB_3.b, c0020, r0030} = {LQB_3.a, c0010} {r0010} div {r0020}

- **b0034_m (1 evaluación, Exacto)**

La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta

- **b0039_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez es mayor que 0 y la Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir es 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:* } = 999999.00

- **b0135_m (1 evaluación, Exacto)**

Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.

- **b0148_m (1 evaluación, Exacto)**

CCC:* : if({LQB_3.a, c0010}{r0010} = 0 and {r0020} = 0) then ({LQB_3.b, c0020, r0030} = 0) else true()

- **IN_LQB (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez y Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir son mayores que 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:* } >= 1

LQB_3.b. Relaciones con otras tablas: LQB_1, LQB_2

- **b0027_m (1 evaluación, Auto)**

Precondición:

- La celda 0002 del estado LQB 3.a es distinta de 0

CCC:* : {LQB_3.b, c0020, r0030} = {LQB_1, c0060, r0650} div {LQB_2, c0010, r0010}

- **b0034_m (1 evaluación, Exacto)**

La codificación del conjunto de cobertura debe de ser correcta

- **b0039_m (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez es mayor que 0 y la Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir es 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:* } = 999999.00

- **b0135_m (1 evaluación, Exacto)**

Todos los códigos de conjunto de cobertura asignados a la entidad se han reportado.

- **b0148_m (1 evaluación, Exacto)**

CCC:* : if({LQB_1, c0060, r0650} = 0 and {LQB_2, c0010, r0010} = 0) then ({LQB_3.b, c0020, r0030} = 0) else true()

- **IN_LQB (1 evaluación, Exacto)**

Precondición:

- El colchón de liquidez y Salida neta de liquidez acumulada máxima (0 a 180 días) que se ha de cubrir son mayores que 0

{LQB_3.b, c0020, r0030, CCC:* } >= 1

DETALLE DE LOS EJES Z

- **1.- Conjunto de cobertura**

Estados: LQB_1, LQB_2, LQB_3.a, LQB_3.b

Dimensión: CCC - Código de identificación de los conjuntos de cobertura de los programas de bonos garantizados y de instrumentos de movilización

DATAPPOINTS EQUIVALENTES

- {LQB_3.a, r0010, c0010} == {LQB_1, r0650, c0060}
- {LQB_3.a, r0020, c0010} == {LQB_2, r0010, c0010}