

Correspondencia Apartados Pilar III con Cuentas Anuales Consolidadas del Grupo

La información contenida en este Informe puede complementarse con la información financiera contenida en las Cuentas Anuales Consolidadas del Grupo. A estos efectos, se presenta en la tabla siguiente la correspondencia de los apartados del Informe de Pilar III con las Cuentas Anuales Consolidadas del Grupo.

Bloque	Apartado	CCAA Consolidadas Grupo	IRP (Pilar III)
Introducción	Entorno regulatorio	Nota 32	Introducción
	Denominación social y diferencias entre grupo consolidable a efectos de normativa de solvencia y criterios contables		
	Denominación social y ámbito de aplicación	Nota 1.1	1.1.1
	Diferencias entre grupo consolidable a efectos de normativa de solvencia y criterios contables	N/A	1.1.2
Requerimientos generales de información	Conciliación del Balance Público desde el perímetro contable al perímetro regulatorio	Nota 32	1.1.3
	Principales cambios en el perímetro del Grupo en el ejercicio 2017	Nota 3	1.1.4
	Identificación de entidades dependientes con recursos propios inferiores al mínimo exigido. Posibles impedimentos a la transferencia de fondos propios	N/A	1.2
	Exenciones a los requerimientos de capital a nivel individual o subconsolidado	N/A	1.3
	Características de los elementos computables	N/A	2.1
Recursos Propios y Capital	Importe de los recursos propios	Nota 32	2.2
	Perfil de riesgos de la entidad	Nota 7	2.3
	Detalle de los requerimientos de recursos propios mínimos por tipo de riesgo	Nota 32	2.4
	Procedimiento empleado proceso autoevaluación capital	N/A	2.5
	Modelo General de control y gestión de Riesgos		
	Gobierno y organización	Nota 7.1.1	3.1.1
	Marco de Apetito al Riesgo	Nota 7.1.2	3.1.2
	Decisiones y procesos	Nota 7.1.3	3.1.3
	Evolución, seguimiento y reporting	Nota 7.1.4	3.1.4
	Infraestructura	Nota 7.1.5	3.1.5
	Cultura de riesgos	Nota 7.1.6	3.1.6
	Riesgo de Crédito y Contraparte		
	Alcance y naturaleza de los sistemas de medición y de información del Riesgos de Crédito	Nota 7.3	3.2.1
	Definiciones y metodologías contables	Notas 2.2.1, 2.3 y Glosario	3.2.2
	Información sobre los riesgos de crédito	N/A	3.2.3
	Información sobre el método estándar	N/A	3.2.4
	Información sobre el método IRB	N/A	3.2.5
	Información sobre el riesgo de contraparte	N/A	3.2.6
	Información sobre titulizaciones	Nota 2.1	3.2.7
	Información sobre técnicas de reducción del riesgo de crédito	Nota 7.3.2	3.2.8
	Densidad de APRs por áreas geográficas	N/A	3.2.9
	Riesgo de Mercado		
	Alcance y naturaleza de los sistemas de medición y de información del Riesgo de Mercado	Nota 7.4	3.3.1
	Diferencias en la cartera de negociación a efectos de la normativa de solvencia y criterios contables	N/A	3.3.2
	Método Estándar	N/A	3.3.3
	Modelos internos	Nota 7.4.1	3.3.4
Riesgos			

Bloque	Apartado	CCAA Consolidadas Grupo	IRP (Pilar III)
	Riesgo estructural de Renta Variable		
	Alcance y naturaleza de los sistemas de medición y de información del Riesgo de Renta Variable	Nota 74.2	3.4.1
	Distinción entre las carteras mantenidas con ánimo de venta y las carteras mantenidas con fines estratégicos	N/A	3.4.2
	Valor en libros y exposición de las participaciones e instrumentos de capital contenidos en las carteras anteriores	N/A	3.4.3
	Activos ponderados por riesgo de las participaciones e instrumentos de capital	N/A	3.4.4
	Pérdidas y ganancias y ajustes por valoración de las participaciones e instrumentos de capital	Nota 49	3.4.5
	Riesgo de cambio estructural		
	Alcance y naturaleza de los sistemas de medición y de información del Riesgo de Cambio	Nota 74.2	3.5.1
	Riesgo de Tipo de Interés		
	Alcance y naturaleza de los sistemas de medición y de información del Riesgo de Tipo de Interés	Nota 74.2	3.6.1
	Naturaleza del riesgo de tipo de interés e hipótesis clave	Nota 74.2	3.6.2
	Variaciones en los tipos de interés	Nota 74.2	3.6.3
	Riesgo de Liquidez		
	Alcance y naturaleza de los sistemas de medición y de información del Riesgo de Liquidez	Nota 75.1	3.7.1
	Gobernanza y monitorización	Nota 75.1	3.7.2
	Comportamiento de liquidez y financiación en 2017	Nota 75.1	3.7.3
	Perspectivas de liquidez y financiación	N/A	3.7.4
	Disclosure LCR	Nota 75.1	3.7.5
	Activos comprometidos en operaciones de financiación	Nota 75.2	3.7.6
	Riesgo Operacional		
	Definición de Riesgo Operacional	Nota 76	3.8.1
	Metodología de Riesgo Operacional	N/A	3.8.2
	Modelo de 3 Líneas de Defensa	Nota 1.6	3.8.3
	Principios del modelo de gestión del Riesgo Operacional en BBVA	Nota 76	3.8.4
	Métodos Utilizados	N/A	3.8.5
	Perfil de Riesgo Operacional del Grupo	N/A	3.8.6
Remuneraciones	Información sobre remuneraciones	Nota 54	5
Información sobre el sistema de Gobierno Corporativo	Información sobre el sistema de gobierno corporativo	IAGC	6
Hechos posteriores	Hechos posteriores	Nota 56	7