

N. Réf. : PV/JMR

Rappel des modifications intervenues depuis la version 1.0 de Corep:

Modification contenue dans la version 1.0.2 de COREP

Tableau OPR : Correction d'une calculation dans la taxonomie p-op-fr

[-] Calculation View	
[-] Extended Link (op)	
[-] Exigences de fonds propres avant réduction résultant des pertes attendues et des mécanismes de transfert des risques	
(1) Exigences de fonds propres au titre du risque opérationnel	
(1) Réduction des exigences de fonds propres résultant de la prise en compte des pertes attendues dans les pratiques internes (-)	
(1) Réduction des exigences de fonds propres résultant des mécanismes de transfert des risques (-)	
(-1) Réduction des exigences de fonds propres résultant de la prise en compte des pertes attendues dans les pratiques internes (-)	
(-1) Réduction des exigences de fonds propres résultant des mécanismes de transfert des risques (-)	
Extended Link (Default Link)	

Modification du coefficient (-1) des 2 composantes identifiés en col.10 et 11 du tableau OPR

Modifications précédentes contenues dans la version 1.0.1 de COREP

1) Changement du data type de l'élément IncomePositiveCurrentYear dans la taxonomie p-ca

Elements by name Report						
ID	Bal	Per	Nil	Type	NS	Label
1		I	T	Monetary	p-ca	IncomePositiveCurrentYear

« Monetary » au lieu de « nonNegativeMonetaryItemType »

2) Changement du data type des éléments CountrySpecificDeductionsTotalOwnFunds et ParticipationsInInsuranceUndertakings dans la taxonomie p-ca

Elements by name Report

ID	Bal	Per	Nil	Type	NS	Label/Name
1		I	T	dt:nonPositiveMonetaryItemType	p-ca	Autres déductions du total des fonds propres CountrySpecificDeductionsTotalOwnFunds

Elements by name Report

ID	Bal	Per	Nil	Type	NS	Label/Name
1		I	T	dt:nonPositiveMonetaryItemType	p-ca	Traitement transitoire des éléments visés aux lignes 1.3.4 et 1.3.5 ParticipationsInInsuranceUndertakings

« nonPositiveMonetaryItemType » au lieu de « Monetary »

3) Correction d'une calcul dans la taxonomie p-ca-fr

Calculation Report

23/01/2008 15:50:27

ID	Wgt	Bal	Per	Nil	Type	NS	Label/Name
1							Extended Link (Calculation16LETotalFPLimitesGrandsRisques)
2			I	T	Monetary	p-ca	Pour mémoire : Total des fonds propres utilisés pour calculer les limites relatives aux grands risques et celles relatives aux participations dans le capital d'entreprise MemorandumItemTotalOwnFundsRelevantLimitsLargeExposuresAdditionalCapitalCoverMarketRisksUsed
3	1		I	T	Monetary	p-ca	Fonds propres de base OriginalOwnFunds
4	1		I	T	Monetary	p-ca	Fonds propres complémentaires AdditionalOwnFunds
5	-1		I	T	Monetary	p-ca	Pour les établissements assujettis utilisant les approches notations internes du risque de crédit, la différence positive entre la somme des ajustements de valeur et des dépréciations collectives afférents aux expositions concernées et les pertes attendues IRBProvisionExcess
6	1		I	T	dt:nonPositiveMonetaryItemType	p-ca	(-) DEDUCTIONS DES FONDS PROPRES DE BASE ET COMPLEMENTAIRES DeductionsOriginalAdditionalOwnFunds
7	-1		I	T	dt:nonPositiveMonetaryItemType	p-ca	(-) positions de titrisation pondérées à 1250% CertainSecuritisationExposuresNotIncludedRiskWeightedAssets
8	-1		I	T	dt:nonPositiveMonetaryItemType	p-ca	(-) Pour les établissements assujettis utilisant les approches notations internes, différence négative entre la somme des ajustements de valeur et des dépréciations collectives afférentes aux expositions concernées et les pertes attendues IRBProvisionShortfall
9	1		I	T	dt:nonPositiveMonetaryItemType	p-ca	(-) DEDUCTIONS DES FONDS PROPRES DE BASE ET COMPLEMENTAIRES DeductionsTotalOwnFunds

Ajout de l'élément 1.7

4) Modification d'un hypercube dans la taxonomie t-mt-fr

Dans le but de supprimer des « warnings », prohibition des relations sur les éléments dont le target role renvoie vers des éléments prohibés du défaut link et re-création de ces relations sans target role.

Definition Report						
ID	Bal	Per	Nil Type	NS	ArcRole	Label/Name
1						Extended Link (ExcZonesHypercube)
2	I		(SbGp: xbrldt:hypercubeItem)	t-mt		ExcZonesHypercube ExcZonesHypercube
3	I		(SbGp: xbrldt:dimensionItem)	d-mr	hypercube-dimension	MarketRiskDimension MarketRiskDimension
4	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 1 (Default Link) MRiskSATDIZone1GeneralRiskMaturityBased
5	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 1 MRiskSATDIZone1GeneralRiskMaturityBased
6	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 2 (Default Link) MRiskSATDIZone2GeneralRiskMaturityBased
7	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 2 MRiskSATDIZone2GeneralRiskMaturityBased
8	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 3 (Default Link) MRiskSATDIZone3GeneralRiskMaturityBased
9	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 3 MRiskSATDIZone3GeneralRiskMaturityBased
10	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 1 MRiskSATDIZone1GeneralRiskDurationBased
11	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 2 MRiskSATDIZone2GeneralRiskDurationBased
12	I		(String)	d-mr	dimension-domain	Zone 3 MRiskSATDIZone3GeneralRiskDurationBased
13	I		(SbGp: xbrldt:dimensionItem)	d-cu	hypercube-dimension	CurrencyDimension CurrencyDimension
14	I		(String)	d-cu	dimension-domain	Code devise (Domaine) (Default Link) CurrencyCodeDomain

Definition Report						
ID	Bal	Per	Nil Type	NS	ArcRole	Label
1						Extended Link (Default Link)
2	I		(String)	d-mr		Risques de marché (Domaine)
3	I		(String)	d-mr	domain-member	Total des exigences de fonds propres au titre des risques de marché
4	I		(String)	d-mr	domain-member	Total des exigences de fonds propres au titre des risques de marché (SA)
5	I		(String)	d-mr	domain-member	Ensemble des positions (SA TD)
6	I		(String)	d-mr	domain-member	Risque général: Méthode de l'échéancier
7	I		(String)	d-mr	domain-member	Zone 1
8	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone1Between0And1Month
9	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone1Between1And3Months
10	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone1Between3And6Months
11	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone1Between6And12Months
12	I		(String)	d-mr	domain-member	Zone 2
13	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone2Between1And2Years
14	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone2Between2And3Years
15	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone2Between3And4Years
16	I		(String)	d-mr	domain-member	Zone 3
17	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Between4And5Years
18	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Between5And7Years
19	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Between7And10Years
20	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Between10And15Years
21	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Between15And20Years
22	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Greater20YearsLoss12ForCouponLoss2Percent
23	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Greater20YearsLoss20ForCouponLoss3Percent
24	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSATDIZone3Greater20YearsGreater30ForCouponLoss3Percent
25	I		(String)	d-mr	domain-member	Somme des positions pondérées compensées de toutes les fourchettes d'échéance
26	I		(String)	d-mr	domain-member	Position pondérée compensée dans la zone 1
27	I		(String)	d-mr	domain-member	Position pondérée compensée dans la zone 2
28	I		(String)	d-mr	domain-member	Position pondérée compensée dans la zone 3
29	I		(String)	d-mr	domain-member	Position pondérée compensée entre les zones 1 et 2
30	I		(String)	d-mr	domain-member	Position pondérée compensée entre les zones 2 et 3
31	I		(String)	d-mr	domain-member	Position pondérée compensée entre les zones 1 et 3
32	I		(String)	d-mr	domain-member	Positions finales

23/01/2008 15:1

5) Prohibition d'un hypercube d'exclusion inactif dans la taxonomie t-mf-fr

Dans le but de supprimer des « warnings » d'un target role renvoyant vers des éléments prohibés du default link.

Definition Report				NS	ArcRole	Label
ID	Bal	Per	Nil Type			
1						Extended Link (ExcMemorandumItemsHypercube)
2	I		(SbGp: xbrldt:dimensionItem)	d-mr		MarketRiskDimension
3	I		(String)	d-mr	dimension-domain	<i>Pour mémoire: détail des principales positions en devises (Default Link)</i>
4	I		(SbGp: xbrldt:hypercubeItem)	t-mf		ExcMemorandumItemsHypercube
5	I		(SbGp: xbrldt:dimensionItem)	d-mr	hypercube-dimension	MarketRiskDimension
6	I		(String)	d-mr	dimension-domain	<i>Pour mémoire: détail des principales positions en devises (Default Link)</i>

Definition Report				NS	ArcRole	Label
ID	Bal	Per	Nil Type			
1						Extended Link (Default Link)
2	I		(String)	d-mr		<i>Risques de marché (Domaine)</i>
3	I		(String)	d-mr	domain-member	<i>Total des exigences de fonds propres au titre des risques de marché</i>
4	I		(String)	d-mr	domain-member	<i>Total des exigences de fonds propres au titre des risque de marché (SA)</i>
5	I		(String)	d-mr	domain-member	<i>Ensemble des positions en devises (SA FX)</i>
6	I		(String)	d-mr	domain-member	<i>Pour mémoire: détail des principales positions en devises</i>
7	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXEuro
8	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXERM2Currencies
9	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXDKK
10	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXEEK
11	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXLTL
12	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXSIT
13	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXCYP
14	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXLVL
15	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXMTL
16	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXSKK
17	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXGBP
18	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXSEK
19	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXCHF
20	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXOtherEEECurrencies
21	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXUSD
22	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXCAD
23	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXAUD
24	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXJPY
25	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXOtherNonEEECurrencies
26	I		(String)	d-mr	domain-member	MRiskSAFXCIUsTratedSeparateCurrencies