

**SECRÉTARIAT GÉNÉRAL DE
L'AUTORITÉ DE CONTRÔLE PRUDENTIEL**

**Direction des Ressources Humaines,
Méthodes et Système d'information**
Service informatique : remise et grands projets

Paris, le 10 novembre 2011

Modifications contenues dans la version 1.0.4 de COREP

(en rouge : les suppressions ; en bleu : les ajouts ; en vert : les modifications)

Tableau CA

Ligne 1.1.5.3a : **nouveau concept**

p-ca_AdditionalValueAdjustmentNecessaryWithRespectToFairValueInstruments

(-) Réfactions supplémentaires correspondantes aux actifs évalués à la juste valeur par résultat

Ligne 1.3.7 : **libellé de concept modifié**

p-ca_CertainSecuritisationExposuresNotIncludedRiskWeightedAssets

(-) Positions de titrisation pondérées à 1250% **(non incluses dans les actifs pondérés, ni dans les positions nettes soumises à des exigences en fonds propres)**

Ligne 2.1.1.2* : **nouvelle valeur de dimension (SecuritizationPositionsSAHypercube)**

d-cr_CreditRiskSASecuritizationOfWhichResecuritisation

Dont: retitrisation (SA)

Ligne 2.1.1.2 : rattachement de la valeur de dimension d-cr_CreditRiskSASecuritization au nouvel hypercube « t-ca_SecuritizationPositionsSAHypercube »

Ligne 2.1.2.4* : **nouvelle valeur de dimension (SecuritizationPositionsIRBHypercube)**

d-cr_CreditRiskIRBSecuritizationOfWhichResecuritisation

Dont: retitrisation (IRB)

Ligne 2.1.2.4 : rattachement de la valeur de dimension d-cr_CreditRiskIRBSecuritization au nouvel hypercube « t-ca_SecuritizationPositionsIRBHypercube »

Ligne 2.2 : **nouvelle valeur de dimension (SettlementRiskHypercube)**

d-ut_TotalUnsettledTransactions

Montant total des opérations non dénouées dans le portefeuille de négociation

Ligne 2.2.1 : **nouvelle valeur de dimension (SettlementRiskHypercube)**

d-ut_TotalUnsettledTransactionsInTheNonTradingBook

Risque de règlement-livraison au sein du portefeuille bancaire

Ligne 2.2.2 : reprise du name de l'ancienne ligne 2.2 et modification du label de la dimension
(SettlementRiskHypercube)

d-ut_TotalUnsettledTransactionsInTheTradingBook

Risque de règlement-livraison au sein du portefeuille de négociation

Ligne 2.3.1.1.01 : **nouvelle valeur de dimension (MarketRiskHypercube)**

d-mr_MRISATDIDGeneralAndSpecificRisk

Risque général et risque spécifique reportés dans l'état MKR SA TDI

Ligne 2.3.1.1.02 : **nouvelle valeur de dimension (MarketRiskHypercube)**

d-mr_MRISASECSpecificRiskSecuritisationPositions

Risque spécifique relatif aux positions de titrisation

Ligne 2.3.1.1.03 : **nouvelle valeur de dimension (MarketRiskHypercube)**

d-mr_MKRSACTPSpecificRiskCorrelationTradingPortfolio

Risque spécifique relatif aux positions du portefeuille de corrélation

Tableau CRSA

Ligne de pondération 70 % : **nouvelle valeur de dimension (SectionRiskWeightsHypercube)**

d-rw_RiskWeight70Percent

70 %

Tableau CR IRB

Ligne 1.4 : **libellé de dimension modifié**

d-cr_CreditRiskIRBCreditCounterpartyCreditDeliveryFreeDeliveriesApplyingRiskWeights

Traitement alternatif des expositions résultant d'opérations donnant lieu à la délivrance d'espèces sans réception des titres, des devises ou des produits de base ou inversement **et autres expositions soumises à pondérations**

Tableau CR SEC SA

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Tranche avec le rang le plus élevé : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMostSenior

Tranche avec le rang le plus élevé

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Tranche "mezzanine" : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMezzanine

Tranche "mezzanine"

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Tranche de première perte : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsFirstLoss

Tranche de première perte

Ligne Total des expositions/Dont retitrisations : **nouvelle valeur de dimension**

d-cr_CreditRiskSASecuritizationOfWhichResecuritisation

Dont: retitrisation

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Titrisations : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisations

Titrisations (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Retitrisations : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsReSecuritisations

Retitrisations (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisations

Titrisations (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Originateur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Retitrisations : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsReSecuritisations

Retitrisations (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Investisseur/Dont originées... : **libellé de dimension modifié**

d-cr_CreditRiskSASecuritizationInvestorOfWhichOriginatedSponsoredEntitiesNotSubjectCRD

dont : originées ou sponsorisées par des entités qui **ne respectent pas les exigences de l'art.217-1 e) de l'arrêté du 20/02/2007**

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Tranche avec le rang le plus élevé : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMostSenior

Tranche avec le rang le plus élevé

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Tranche "mezzanine" : valeur de dimension supprimée

d-et_OnBalanceSheetItemsMezzanine

Tranche "mezzanine"

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Tranche de première perte : valeur de dimension supprimée

d-et_OnBalanceSheetItemsFirstLoss

Tranche de première perte

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Titrisations : nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisations

Titrisations (Bilan)

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Retitrisations : nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)

d-et_OnBalanceSheetItemsReSecuritisations

Retitrisations (Bilan)

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations : nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisations

Titrisations (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Retitrisations : nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)

d-et_OffBalanceSheetItemsReSecuritisations

Retitrisations (Hors-bilan et inst. dérivés)

Colonne 22 b : nouveau concept

p-ss_ExposureValueRiskWeightBreakdownRated40Percent

40 %

Colonne 24 b : nouveau concept

p-ss_ExposureValueRiskWeightBreakdownRated225Percent

225 %

Colonne 25 b : nouveau concept

p-ss_ExposureValueRiskWeightBreakdownRated650Percent

650 %

Tableau CR SEC IRB

Ligne Total des expositions/Dont retitrisations : nouvelle valeur de dimension

d-cr_CreditRiskIRBSecuritizationOfWhichResecuritisation

Dont : retitrisation

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Tranche avec le rang le plus élevé : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMostSenior

Tranche avec le rang le plus élevé

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Tranche "mezzanine" : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMezzanine

Tranche "mezzanine"

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Tranche de première perte : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsFirstLoss

Tranche de première perte

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Titrisations A : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisationsA

Titrisations A (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Titrisations B : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisationsB

Titrisations B (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Titrisations C : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisationsC

Titrisations C (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Retitrisations D : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsReSecuritisationsD

Retitrisations D (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments de bilan/Retitrisations E : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OnBalanceSheetItemsReSecuritisationsE

Retitrisations E (Bilan)

Ligne Originateur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations A : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisationsA

Titrisations A (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Originateur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations B : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisationsB

Titrisations B (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Originateur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations C : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisationsC

Titrisations C (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Originateur/ Eléments hors bilan et instruments dérivés /Retitrisations D : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsReSecuritisationsD

Retitrisations D (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Originateur/ Eléments hors bilan et instruments dérivés /Retitrisations E : **nouvelle valeur de dimension**

d-et_OffBalanceSheetItemsReSecuritisationsE

Retitrisations E (Hors-bilan et inst. dérivés)

Ligne Investisseur/Dont originées... : **libellé de dimension modifié**

d-cr_CreditRiskIRBSecuritizationInvestorOfWhichOriginatedSponsoredEntitiesNotSubjectCRD

dont : originées ou sponsorisées par des entités qui **ne respectent pas les exigences de l'art.217-1 e) de l'arrêté du 20/02/2007.**

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Tranche avec le rang le plus élevé : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMostSenior

Tranche avec le rang le plus élevé

Ligne Investisseur /Eléments de bilan/Tranche "mezzanine" : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsMezzanine

Tranche "mezzanine"

Ligne Investisseur /Eléments de bilan/Tranche de première perte : **valeur de dimension supprimée**

d-et_OnBalanceSheetItemsFirstLoss

Tranche de première perte

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Titrisations A : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisationsA

Titrisations A

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Titrisations B : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisationsB

Titrisations B

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Titrisations C : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OnBalanceSheetItemsSecuritisationsC

Titrisations C

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Retitrisations D : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OnBalanceSheetItemsReSecuritisationsD

Retitrisations D

Ligne Investisseur/Eléments de bilan/Retitrisations E : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OnBalanceSheetItemsReSecuritisationsE

Retitrisations E

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations A : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisationsA

Titrisations A

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations B : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisationsB

Titrisations B

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Titrisations C : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OffBalanceSheetItemsSecuritisationsC

Titrisations C

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Retitrisations D : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OffBalanceSheetItemsReSecuritisationsD

Retitrisations D

Ligne Investisseur/Eléments hors bilan et instruments dérivés/Retitrisations E : **nouvelle valeur de dimension (idem ci-dessus)**

d-et_OffBalanceSheetItemsReSecuritisationsE

Retitrisations E

~~Colonne 20 : concept supprimé~~

~~p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod6To10Percent~~

~~6% – 10%~~

Colonne 20 : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod7To10Percent

7 % – 10 %

Colonne 23 : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod40To75Percent

40 % – 75 %

~~Colonne 23 : concept supprimé~~

~~p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod50To75Percent~~

~~50% – 75%~~

Colonne 24b : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod150Percent
150 %

Colonne 24c : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod200Percent
200 %

Colonne 24d : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod225Percent
225 %

Colonne 25b : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod300Percent
300 %

Colonne 25c : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod350Percent
350 %

Colonne 26b : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod500Percent
500 %

Colonne 27b : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod750Percent
750 %

Colonne 27c : **nouveau concept**

p-si_ExposureValueRiskWeightBreakdownRatingBasedMethod850Percent
850 %

Tableau CR SEC DETAILS

Colonne 3a : **nouveau concept**

p-sd-fr_SecuritisationOrResecuritisation
Titrisation ou retitrisation (T/R)

Colonne 3d : **nouveau concept**

p-sd_ComplianceWithTheRetentionRequirement
Respect de l'exigence de rétention (oui/non)

Colonne 4 : libellé de concept modifié

p-sd_RoleOfTheInstitutionSponsorOriginator

Rôle de l'établissement (sponsor/originateur/**prêteur initial**)

Tableau CR SETT (ex CR TB SETT)

Ligne 1 : **nouvelle valeur de dimension**

d-ut_TotalUnsettledTransactionsInTheNonTradingBook

Montant total des opérations non dénouées dans le portefeuille bancaire

Ligne 1.1 : **nouvelle valeur de dimension**

d-ut_TransactionsUnsettledUpTo4DaysInTheNonTradingBook

Opérations non dénouées jusqu'à 4 jours

Ligne 1.2 : **nouvelle valeur de dimension**

d-ut_TransactionsUnsettledBetween5And15DaysInTheNonTradingBook

Opérations non dénouées entre 5 et 15 jours

Ligne 1.3 : **nouvelle valeur de dimension**

d-ut_TransactionsUnsettledBetween16And30DaysInTheNonTradingBook

Opérations non dénouées entre 16 et 30 jours

Ligne 1.4 : **nouvelle valeur de dimension**

d-ut_TransactionsUnsettledBetween31And45DaysInTheNonTradingBook

Opérations non dénouées entre 31 et 45 jours

Ligne 1.5 : **nouvelle valeur de dimension**

d-ut_TransactionsUnsettledFor46DaysOrMoreInTheNonTradingBook

Opérations non dénouées pour 46 jours et plus

Tableau MKR SA TDI

Ligne 3.5 : ~~valeur de dimension supprimée~~

~~d-~~

~~mr_MRiskSATDISecuritisationExposuresSubject1250PercentRiskWeightingOrDeductionUnratedLiquidityFacilities~~

~~Positions de titrisation pondérées à 1250% ou déduites et lignes de liquidité qui ne bénéficient d'aucune évaluation externe de crédit~~

Ligne Total : « Ensemble des positions du portefeuille de négociation exposées au risque de taux » :

nouvelle valeur de dimension définissant la d-mr_MRiskSATDIGeneralAndSpecificRisk (suite à la création des tableaux MKR SA SEC et MKR SA CTP)

Tableau MKR SA EQU

Ligne 2.1 : valeur de dimension supprimée

~~d_mr_MRiskSAEQUHighQualityLiquidDiversifiedPortfoliosSubjectLowerCapitalRequirements~~

~~Positions sur titres faisant l'objet d'exigences de fonds propres réduites~~

Ligne 2.2 : valeur de dimension supprimée

~~d_mr_MRiskSAEQUOtherEquitiesThanHighQualityLiquidDiversifiedPortfolios~~

~~Autres positions sur titres~~

Tableau MKR IM

Entête des colonnes 1 et 2 : **nouvel élément abstrait**

p-mi_VaR

Valeur en risque

Colonne 3 : concept supprimé

~~p_mi_SpecificRiskSurcharge~~

~~Exigence supplémentaire au titre du risque spécifique~~

Colonne 4 : concept supprimé

~~p_mi_IncrementalDefaultRiskSurcharge~~

~~Exigence supplémentaire au titre du risque de défaut additionnel~~

Entête des colonnes 3a et 3b : **nouvel élément abstrait**

p-mi_StressedVaR

Valeur en risque stressée

Colonne 3a : **nouveau concept**

p-mi_MultiplicationFactorXAveragePrevious60WorkingDaysSVaR

Coefficient multiplicateur (ms) X la moyenne des mesures quotidiennes de la valeur en risque stressée au cours des 60 jours ouvrés précédents (SVaRavg)

Colonne 3b : **nouveau concept**

p-mi_LatestAvailableSVaR

Dernière mesure disponible (SVaRt-1)

Entête des colonnes 4a et 4b : **nouvel élément abstrait**

p-mi_IncrementalDefaultAndMigrationRiskCapitalCharge

Exigence en fonds propres relative au risque additionnel de défaut et de migration

Colonne 4a : **nouveau concept**

p-mi_TwelveWeeksAverageMeasure

Mesure moyenne sur 12 semaines

Colonne 4b : **nouveau concept**

p-mi_LastMeasure

Dernière mesure disponible

Entête des colonnes 4c à 4f : **nouvel élément abstrait**

p-mi_AllPriceRisksCapitalChargeForCTP

Mesure globale des risques relative au portefeuille de corrélation

Colonne 4c : **nouveau concept**

p-mi_Floor

Niveau plancher

Colonne 4d : **nouveau concept**

p-mi_TwelveWeeksAverageMeasureCTP

Mesure moyenne sur 12 semaines

Colonne 4e : **nouveau concept**

p-mi_LastMeasureCTP

Dernière mesure disponible

Colonne 4f : **nouveau concept**

p-mi_SupplementalCapitalChargeStressTest

Exigence en fonds propres supplémentaires (scénarios de crise)

Colonne 5 : **remplacement du concept** p-cm-ca_CapitalRequirements **par :**

p-cm-ca_MarketRiskCapitalRequirements

Exigences de fonds propres au titre du risque de marché

~~Colonne 7 : **concept supprimé**~~

~~p-mi_MultiplicationFactor~~

~~Coefficient multiplicateur~~

Colonne 7a : **nouveau concept**

p-mi_VaRMultiplicationFactor

Coefficient multiplicateur de la valeur en risque (mc)

Colonne 7b : **nouveau concept**

p-mi_SVarMultiplicationFactor

Coefficient multiplicateur de la valeur en risque stressée (ms)

Colonne 8 : **nouveau concept**

p-mi_AssumedChargeForCTPFloorWeightedNetLongPositionsAfterCAP

Exigences totales de fonds propres pour risque spécifique qui s'appliquent aux seules positions longues nettes du portefeuille de corrélation pour le calcul du niveau plancher

Colonne 9 : **nouveau concept**

p-mi_AssumedChargeForCTPFloorWeightedNetShortPositionsAfterCAP

Exigences totales de fonds propres pour risque spécifique qui s'appliquent aux seules positions courtes nettes du portefeuille de corrélation pour le calcul du niveau plancher

Tableau MKR IM Details

Colonne 1 Informations générales : **ouvel élément dans la dimension typée d-ty-fr_BasicInformationFrench**

d-ty_InstrumentCodeRegulatoryModel

Code de l'instrument pour le modèle réglementaire

Colonne 9b : **nouveau concept**

p-md_SVaR

SVaR (T=10)

~~Colonne 10 : **concept supprimé**~~

~~p-md_SpecificRiskSurcharge~~

~~Exigence supplémentaire au titre du risque spécifique~~

~~Colonne 11 : **concept supprimé**~~

~~p-md_IncrementalDefaultRiskSurcharge~~

~~Exigence supplémentaire au titre du risque de défaut additionnel~~

Colonne 11a : **nouveau concept**

p-md_IncrementalDefaultAndMigrationRiskCapitalCharge

Exigence en fonds propres relative au risque additionnel de défaut et de migration

Colonne 11b : **nouveau concept**

p-md_AprCapitalChargeForCtpExcludingSupplementalCapitalCharge

Mesure globale des risques relative portefeuille de corrélation

Tableau MKR SA CTP : NOUVEAU TABLEAU

IDEM VERSION EUROPE (Taxonomie t-mp)

Tableau MKR SA SEC : NOUVEAU TABLEAU

IDEM VERSION EUROPE (Taxonomie t-ms) sauf :

Pas de ligne 8 « Securisations »