

**DIRECTION DES RESSOURCES HUMAINES,
METHODES ET SYSTÈME D'INFORMATION**

SERVICE INFORMATIQUE :
REPORTING ET GRANDS PROJETS

Paris, le 7 février 2012

NOTE TECHNIQUE n° 2012 – 01

Objet : Précisions sur les taxonomies COREP V1.04 et Engagements Internationaux V1.07

Taxonomies COREP V1.04

MKR_IM Détails : Information détaillée sur les modèles internes de risques de marché

Tableau « Informations Générales » :

Colonne 1 : « Code de l'instrument pour le modèle réglementaire »

Les codes suivants permettent d'identifier les catégories d'instruments couverts par le modèle:

- 1 = titres de propriété ;
- 2 = instruments de dette ;
- 3 = devises étrangères ;
- 4 = produits de base ;

5 = si un modèle est calculé pour les titres de propriétés et/ou les instruments de taux et/ou les devises étrangères, le code à reporter est 5

MKR_CA_CTP : Approche standard du risque spécifique pour les positions du portefeuille de corrélation,
et
MKR_SA_SEC : Titrisations dans le portefeuille de négociation

Positions déduites des fonds propres : Longues (colonne 3)
(PositionsDeductedFromOwnFundsLong)

Positions déduites des fonds propres : Courtes (colonne 4)
(PositionsDeductedFromOwnFundsShort)

Ces deux éléments qui doivent être déduits ne doivent pas, contrairement à l'usage actuel dans COREP, figurer avec un signe négatif dans l'instance.

CR SA : Risque de crédit, de contrepartie et de règlement-livraison en approche standard :

La nouvelle ligne de pondération à 70% « d-rw_RiskWeight70Percent » n'est pas autorisée pour les colonnes 1 à 4 conformément à la taxonomie européenne dont elle hérite.

Taxonomies SURFI Engagements Internationaux V1.07

ENGAG_INT : Risques liés à l'activité bancaire internationale

Colonne 3 : pour être conforme avec la taxonomie, la valeur de dimension à servir dans l'instance est « **Administrations publiques hors administrations centrales** »

« **d-scp_AdministrationsPubliquesHorsAdministrationsCentrales** »;

Colonne 5 : « **Clientèle financière y compris OPCVM monétaires** »

« **d-scp_ClienteleFinanciere** »:

- cette valeur de dimension doit être utilisée dans l'instance pour le tableau « **Engagements bruts en risque immédiat** » ;

- compte tenu d'un écart entre le tableau de l'instruction ACP et la taxonomie, il convient d'utiliser de manière transitoire la valeur de dimension

OPCVM monétaires » « **d-scp_OpcvmMonetaires** »

dans l'instance pour les tableaux « **Engagements bruts en risque ultime** » et « **Engagements bruts en risque ultime faisant l'objet d'une dépréciation au titre du risque de crédit** ».

Une correction de la taxonomie aura lieu ultérieurement.

