

## Corep-formulieren wijzigen met ingang van december 2011

Met ingang van de rapportageperiode **december 2011** zal DNB CRD III-wijzigingen in de Corep-formulieren doorvoeren waardoor deze overeenkomen met het door EBA European Banking Authority opgelegde format. Tot voor kort had DNB voor beleggingsondernemingen beperkte ruimte om formulieren naar eigen inzicht aan te passen. In het verleden is er bijvoorbeeld voor gekozen om onnodige regels en kolommen uit de set voor beleggingsondernemingen te verwijderen. Dit is voor Corep vanaf december 2011 niet meer toegestaan. Verder zijn er in een aantal formulieren (kleine) wijzigingen doorgevoerd. Mogelijk heeft dit gevolgen voor de rapportages die u instuurt. Hieronder wordt een korte toelichting gegeven welke formulieren wijzigen en wat de gevolgen hiervan zijn.

### FORMULIEREN

Deze brief is bestemd voor alle beleggingsondernemingen met een afzonderlijk Corep-profiel (Corep Bo SA K, Corep Bo SA M, Corep Bo SA IRB K, Corep Bo SA IRB M, Corep Bo SA MRK K of Corep Bo SA MRK M). Een toelichting op formulieren die niet in uw profiel voorkomen kunt u negeren.

**CA**; van dit formulier wijzigt enkel de lay-out. Een aantal regels is aangepast aan de CRD III-tekst.

**CRSA**: van dit formulier wijzigt enkel de lay-out. Een aantal regels en kolommen is toegevoegd waardoor u nu het volledige CRSA-formulier krijgt te zien. Hierdoor zijn regelnummers soms gewijzigd. Hiermee dient u bij het invullen van het formulier rekening mee te houden.

**CRIRB**: van dit formulier wijzigt enkel de lay-out. Een aantal regels en kolommen is toegevoegd waardoor u nu het volledige CRSA-formulier krijgt te zien. Het formulier kunt u op dezelfde wijze invullen als de vorige versie.

**CREQUIRB**: van dit formulier wijzigt enkel de lay-out. Een aantal regels en kolommen is toegevoegd waardoor u nu het volledige CRSA-formulier krijgt te zien. Het formulier kunt u op dezelfde wijze invullen als de vorige versie.

**CRTBSETT**: met ingang van december 2011 dient u ook het non-trading book te verantwoorden.

**OPR**: er zijn extra regels opgenomen waardoor er een betere uitsplitsing naar onderdelen kan worden gemaakt. Indien u volgens de Basic Indicator Approach rapporteert wijzigt er niets.

**MKRIM**: er zijn extra regels en kolommen opgenomen.

**MKRIMDetails**: er zijn extra regels en kolommen opgenomen.

**MKRSATDI**: nummering kolom 9 en 10 is verwisseld.

**MKRSAEQU**: percentage specifiek risico is verhoogd.

**MKRSAFX**: ERM2 currency positions zijn afgenomen doordat een aantal landen is overgegaan naar de Euro.

**MKRSACOM**: dit formulier is ongewijzigd.