



# DEX Regulatory Suite

DEX Regulatory Suite voor EBA

Deze whitepaper bespreekt EBA regulatory reporting en DEX Regulatory Suite voor EBA.

## Capital Requirements Directive iv

Veel financiële regelgeving richt zich op Basel III, de regelgevingen die wereldwijde, financiële organisaties besturen. In Europa zijn deze samen verzameld in CRD (Capital Requirements Directive) iv. Het kenmerkende van CRD iv is dat het na 2008 een hele reeks governance rond bankorganisaties samenbrengt om toekomstige liquiditeitscrises te voorkomen.

## CRD iv reporting

Om de CRD IV-verordening te kunnen handhaven, heeft de Europese Banking Authority een uitgebreide reeks rapporten opgesteld. Marktpartijen moeten regelmatig rapporteren over hun financiële positie. De volgende rapportagesets (taxonomieën) zijn gedefinieerd:

- COREP
- FINREP
- Funding Plans
- Asset Encumbrance
- Resolution
- Supervisory Benchmarking

## DEX Regulatory Suite voor EBA

Om te kunnen voldoen aan de CRD iv-voorschriften, biedt DEX Data Explorers DEX Regulatory Suite voor EBA. DEX RS genereert wettelijke rapporten met behulp van de EBA-specificaties.

Entity

Define a source hierarchy	Load source system hierarchy sheet	Define source system data	Load datamodel
Create source system relation	Create sourceview	Encrypt sourcedata	Define projectscope
Define metric mapping	Load source data	Calculate datapoints	Load expressions for validations
Evaluate expressions	Display report	Document report	Create XBRL Files

Close

EBA heeft een datapointmodel gepubliceerd met alle definities van de CRD iv-rapporten. Een datapointmodel is een database die alle nodige informatie bevat om de rapporten te genereren. DEX RS gebruikt de informatie in het datapointmodel om de rapporten te genereren, de uitkomsten te valideren met de EBA-validatieregels en de XBRL-interfaces te genereren. Aangezien de rapporten worden gegenereerd volgens de EBA-normen, zijn de rapporten altijd compatibel en voldoen ze aan de nieuwste normen.

Hieronder wordt een voorbeeld van een Liquidity Coverage rapport weergegeven dat is gegenereerd door DEX RS.

**DEX  
EBA**

Table 612: C\_51.00.b - Liquidity Coverage. Liquid assets (II). Total Export to Excel

Frequency: quarterly  
Period: 2019-Q1

Total currencies

		Extremely high liquidity and credit qu.		High liquidity and credit quality asset:	
		Market value	Value according to Art. 418 CRR	Market value	Value according to Art. 418 CRR
		C020	C030	C050	C060
. assets issued by a credit institution which has been set up by a Member State central or regional government where at least one of the conditions in Art. 416 (2)(a)(iii) CRR is met	180	613049.0	380621.0	96863.0	37073.0
<b>. non financial corporate bonds</b>	185				
. . credit quality step 1	190	685722.0	820312.0	917603.0	832782.0
. . credit quality step 2	200	343185.0	153263.0	379119.0	630414.0
. . credit quality step 3	210	983636.0	590852.0	483940.0	192966.0
<b>. bonds issued by a credit institution eligible for the treatment set out in Art. 129(4) or (5) CRR</b>	215				
. . credit quality step 1	220	775603.0	457350.0	434376.0	510441.0
. . credit quality step 2	230	366863.0	235374.0	559975.0	293118.0
. . credit quality step 3	240	486575.0	688603.0	532625.0	863501.0

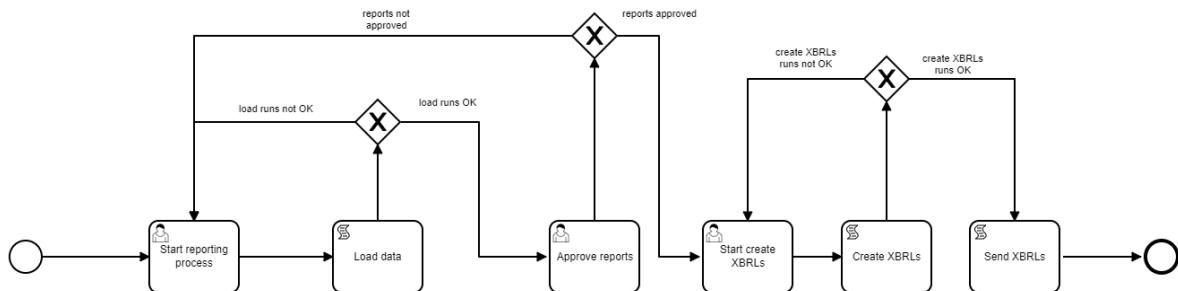
DEX Data Explorers handhaaft de definities van de rapporten volgens de regulatorstandaarden. Wanneer er updates voor de standaarden worden ingediend, ontvangt u als klant een update van de reeks rapportagedefinities.

DEX Regulatory Suite biedt de volgende functionaliteit:

- Rapporten gegenereerd volgens de nieuwste normen
- Analysetools voor het in mappen van eigen gegevenssets met het EBA CRD iv-model
- Validatie van de gegevens volgens de validatieregels gedefinieerd door EBA; dit geeft u de mogelijkheid om de rapporten te valideren voordat u ze verzendt
- XBRL-generatie in overeenstemming met de normen van EBA
- Verwerking van de feedback van EBA
- Automatisch gegenereerde documentatie
- Workflow ondersteuning
- Mogelijkheid om uw eigen rapporten te definiëren

## Workflow ondersteuning

DEX RS biedt workflowintegratie. De DEX RS-functionaliteit is geïntegreerd in workflowsystemen. Gebruikers worden door het regulatory proces geleid; handmatige stappen zijn geïntegreerd met geautomatiseerde stappen. Alle acties worden vastgelegd.



## Ontwerp uw eigen rapportages

Naast het leveren van de vereiste regelgevingsrapporten biedt DEX RS u de mogelijkheid om uw eigen rapporten te ontwerpen. Op deze manier kunt u de gegevens die u gebruikt opnieuw gebruiken voor reguleringsrapporten voor bijvoorbeeld interne rapporten. U kunt ook uw eigen berekeningen en validaties toevoegen.

**DEX EBA**

Tableversion: 1399: C 03.00 - 1399: C\_03.00 - Capital Adequacy - Ratios

X-axisordinate: 55661: 010 - Amount      Y-axisordinate: 55662: 010 - CET1 Capital ratio

ExpressionId	ExpressionCode	Type	Severity	Formula	Message
27190	v6252_m		Signalling	if {r020} < 0 then {r010} < 0.045	
Scope					
<input type="radio"/> Row					
<input checked="" type="radio"/> Column					
<input type="radio"/> Cell					
27191	v6253_m		Signalling	if {r010} < 0.045 then {r020} < 0	
Scope					
<input type="radio"/> Row					
<input checked="" type="radio"/> Column					
<input type="radio"/> Cell					

## Beschikbare oplossingen

---

DEX Regulatory Suite ondersteunt de volgende regelingen:

- CRD iv (COREP, FINREP, Funding Plans, Asset Encumbrance, Supervisory Benchmarking Portfolio)
- AnaCredit
- Residential Real Estate
- Depositogarantiestelsel
- MIFID ii
- SFTR
- Sociaal-economische rapportages
- Digitale Rapportage (DRA)
- Solvency
- IORP ii
- Landenrisico
- Financieel toetsingskader (FTK)
- Fiscale rapportage (VIA, Fatca)

## Addition Knowledge House en DEX Regulatory Suite

---

Addition Knowledge House ([www.addition.nu](http://www.addition.nu)) is een reseller van DEX Regulatory Suite.

Addition Knowledge House biedt de volgende diensten met betrekking tot DEX Regulatory Suite:

- Ondersteuning bij de implementatie
- Support
- Business Process Outsourcing



Addition Knowledge House biedt de mogelijkheid om grote delen van het CRD iv-proces uit te besteden. Addition kan de volgende diensten aanbieden met DEX RS:

- Verzamelen van de informatie van de bronsystemen
- Generatie van CRD iv-rapporten en distributie naar geïnteresseerde partijen
- Maken van de XBRL en het versturen naar de toezichthouder

Elke situatie is uniek. Addition Knowledge House bespreekt graag hoe we uw proces optimaal kunnen ondersteunen.

# DEX Data Explorers

[info@dataexplorers.nl](mailto:info@dataexplorers.nl)

<http://www.dataexplorers.nl>