



Communication CBFA_2008_19 du 9 octobre 2008

Reconnaissance des organismes externes d'évaluation du crédit (OEEC)

Champ d'application:

Les établissements de crédit et les entreprises d'investissement.

Résumé/Objectifs:

Conformément à l'article V.12 du règlement relatif aux fonds propres des établissements de crédit et des entreprises d'investissement du 17 octobre 2006, Rating and Investment Information Inc. est reconnue comme OEEC.

Madame, Monsieur,

Conformément à l'article V.12 du règlement relatif aux fonds propres des établissements de crédit et des entreprises d'investissement du 17 octobre 2006, les évaluations externes du crédit publiées par les OEEC ne peuvent être utilisées dans le cadre du calcul du volume pondéré des risques par les établissements que lorsque ces organismes ont été reconnus comme éligibles par la CBFA.

La présente communication complète la liste des OEEC reconnus comme éligibles par la CBFA ainsi que les tables de correspondance mentionnées dans la circulaire PPB-2007-2-CPB du 8 février 2007.

Ainsi, la Rating and Investment Information Inc. (ou R&I) est reconnue comme OEEC éligible pour les segments de marché relatifs aux entités commerciales (en ce compris les entreprises, les établissements et les établissements financiers¹) et aux finances publiques dans le cadre de l'approche standard pour les expositions à long terme et à court terme.

La CBFA, conformément à l'article V.14, §2, du règlement susvisé autorise également l'utilisation des notations non sollicitées de cet organisme.

Conformément à l'article V.13, les évaluations de R&I sont associées aux échelons de qualité crédit suivants :

Approche standard :

Mapping long terme

Echelon de qualité de crédit	Notation R&I
1	AAA à AA-
2	A+ à A-
3	BBB+ à BBB-
4	BB+ à BB-
5	B+ à B-
6	inférieur ou égal à CCC+

¹ Au sens du règlement de la Commission bancaire, financière et des assurances du 17 octobre 2006 concernant les fonds propres des établissements de crédit et des entreprises d'investissement.

Mapping court terme

Echelon de qualité de crédit	Notation R&I
1	a-1+, a-1
2	a-2
3	a-3
4	Toutes les notations court terme inférieures à a-3 (à savoir, les catégories b et c)
5	
6	

Veillez agréer, Madame, Monsieur, l'expression de mes sentiments les meilleurs.

Le Président,

Jean-Paul SERVAIS.