

Document d'aide Circulaire 2017/7 « Risques de crédit – banques »

Abréviations et termes en relation avec l'approche IRB

20 juin 2018

A-IRB	advanced IRB	IRB avancée
CCF	credit conversion factor	facteur de conversion en équivalent-crédit
CCP	central counterparty	contrepartie centrale
CF	commodities finance	financement de matières premières
CRE	commercial real estate	immobilier commercial
EAD	exposure at default	exposition (valeur de la position) en cas de défaut
EL	expected loss	perte attendue
F-IRB	foundation IRB	IRB simple
HVCRE	high-volatility commercial real-estate	immobilier commercial à forte volatilité
IPRE	income-producing real estate	immobilier de rapport
IRB	internal ratings-based approach	approche fondée sur les notations internes
LGD	loss given default	perte en cas de défaut
SME	small and medium-sized enterprises	petites et moyennes entreprises (PME)
M	effective maturity	échéance effective
OF	object finance	financement d'objets
PD	probability of default	probabilité de défaut
PF	project finance	financement de projets
RRE	residential real estate	immobilier résidentiel
UL	unexpected loss	perte inattendue
RPV	replacement value	valeur de remplacement
SL	specialised lending	financements spécialisés