

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

Abréviations et termes en relation avec l'approche IRB

... 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 |
| PME | | petites et moyennes entreprises |
| 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 |