



Communication CBFA_2008_11 du 9 mai 2008

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

Champ d'application:

Etablissements de crédit, entreprises d'investissement, organismes de liquidation et organismes assimilés à des organismes de liquidation et compagnies financières.

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, le mapping long terme de la Japan Credit Rating Agency est revu et la reconnaissance étendue aux évaluations à court terme.

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 vise à mettre à jour les informations relatives à 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, conformément à l'article V.13, les évaluations de la *Japan Credit Rating Agency* (ou JCR) sont associées aux échelons de qualité crédit suivants :

Approche standard :

Mapping long terme

Echelon de qualité de crédit	Notation JCR
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

Mapping court terme

Echelon de qualité de crédit	Notation JCR
1	J-1
2	J-2
3	J-3
4	Toutes les notations court terme inférieures à J-3 (NJ)
5	Toutes les notations court terme inférieures à J-3 (NJ)
6	Toutes les notations court terme inférieures à J-3 (NJ)

Veillez agréer, Madame, Monsieur, l'expression de nos sentiments distingués.

Le Président,

Jean-Paul Servais.