



BANQUE CENTRALE EUROPÉENNE
SUPERVISION BANCAIRE

COMMUNIQUÉ DE PRESSE

7 septembre 2018

La BCE lance une consultation publique sur les chapitres de son guide relatif aux modèles internes consacrés aux types de risque

- La BCE publie pour consultation les chapitres de son guide relatif aux modèles internes consacrés au risque de crédit, au risque de marché et au risque de contrepartie.
- La période de consultation s'achèvera le 7 novembre 2018.
- Les chapitres consacrés aux types de risque donnent un aperçu de la façon dont la BCE entend garantir l'interprétation uniforme du cadre juridique existant.

La Banque centrale européenne (BCE) publie ce jour pour consultation les trois chapitres de son guide relatif aux modèles internes consacrés aux types de risque. Ces chapitres – sur le risque de crédit, le risque de marché et le risque de contrepartie – visent à garantir une approche commune et cohérente des aspects les plus pertinents des réglementations applicables aux modèles internes pour les banques soumises à la surveillance prudentielle directe de la BCE.

Après la consultation sur le chapitre du guide consacré aux thèmes généraux, lancée le 28 mars 2018, les chapitres relatifs aux types de risque s'attachent à rendre plus transparente l'interprétation par la BCE des réglementations applicables à l'utilisation des modèles internes aux fins de calcul des exigences de fonds propres face au risque de crédit, au risque de marché et au risque de contrepartie.

Le guide a été élaboré en étroite coopération avec les autorités compétentes nationales (ACN) et s'appuie sur l'expérience acquise lors des enquêtes sur place réalisées dans le cadre du projet d'examen ciblé des modèles internes (*Targeted Review of Internal Models* – TRIM) en 2017 et 2018. Il s'appuie également sur les commentaires reçus des autres institutions au sujet d'une [première version du guide](#) mise à disposition le 28 février 2017.

Banque centrale européenne Direction générale Communication
Division Relations avec les médias, Sonnemanstrasse 20, 60314 Frankfurt am Main, Allemagne
Tél. : +49 69 1344 7455, courriel : media@ecb.europa.eu, internet : www.ecb.europa.eu

Reproduction autorisée en citant la source.

Traduction : Banque de France

COMMUNIQUÉ DE PRESSE / 7 septembre 2018

La BCE lance une consultation publique sur les chapitres de son guide relatif aux modèles internes consacrés aux types de risque

La consultation concernant le guide commence ce jour et s'achèvera le 7 novembre prochain. Le guide lui-même ainsi qu'une liste des questions fréquemment posées sont disponibles sur le site internet de la BCE consacré à la supervision bancaire.

Dans le cadre de cette consultation, la BCE organisera une audition publique le 17 octobre 2018. Des informations sur les formalités d'inscription à l'audition publique et sur la marche à suivre pour soumettre des commentaires sont disponibles sur le site internet de la BCE consacré à la supervision bancaire. À l'issue de la consultation publique, la BCE publiera les commentaires reçus ainsi qu'un compte rendu.

Pour toute demande d'information, les médias peuvent s'adresser à Esther Tejedor au +49 69 1344 95596.

Banque centrale européenne Direction générale Communication
Division Relations avec les médias, Sonnemanstrasse 20, 60314 Frankfurt am Main, Allemagne
Tél. : +49 69 1344 7455, courriel : media@ecb.europa.eu, internet : www.ecb.europa.eu

Reproduction autorisée en citant la source.

Traduction : Banque de France