

COMMUNIQUE

■ PUBLICATION D'UN DOCUMENT CONSULTATIF DE LA COMMISSION EUROPEENNE SUR LE RISQUE DE CREDIT DE CONTREPARTIE

La Commission européenne a publié un document consultatif (« Counterparty credit risk – capitalisation of bank exposures to central counterparties and treatment of incurred credit valuation adjustment ») sur le calcul des exigences de fonds propres des expositions sur des contreparties centrales ainsi que sur le traitement des ajustements de valeur constitués pour le risque de crédit de la contrepartie (« credit valuation adjustment (CVA) ») liés aux instruments dérivés traités sur le marché de gré à gré.

Les parties intéressées sont invitées à soumettre leurs commentaires éventuels pour le 9 mars 2011 à l'adresse de courrier électronique markt-crd-consultation@ec.europa.eu.

Luxembourg, le 23 février 2011

