



## AVIS

**Mise en œuvre des orientations de l’Autorité bancaire européenne relatives à la détermination de la maturité moyenne pondérée de la tranche, conformément à l’article 257, paragraphe 1, point a), du règlement (UE) n° 575/2013 (EBA/GL/2020/04)**

L’Autorité de contrôle prudentiel et de résolution s’est déclarée conforme aux orientations de l’Autorité bancaire européenne (EBA/GL/2020/04) relatives à la détermination de la maturité moyenne pondérée de la tranche, conformément à l’article 257, paragraphe 1, point a), du règlement (UE) n° 575/2013.

Ces orientations détaillent, en particulier, deux méthodes de calcul de la maturité moyenne pondérée d’une tranche de titrisation, selon que la titrisation est traditionnelle ou synthétique, afin de permettre un calcul des pondérations plus sensibles au risque pour les expositions sur des titrisations. Les règles d’utilisation des données et des modèles externes sont également précisées.

Ces orientations sont applicables aux établissements de crédit.