KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2021/2006

2021 m. lapkričio 16 d.

kuriuo nustatomi techniniai įgyvendinimo standartai, kuriais dėl išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų kredito rizikos vertinimų susiejimo su objektyvia kredito kokybės žingsnių skale pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2009/138/EB iš dalies keičiamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1800

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2009 m. lapkričio 25 d. Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2009/138/EB dėl draudimo ir perdraudimo veiklos pradėjimo ir jos vykdymo (Mokumas II) ([1]), ypač į jos 109a straipsnio 1 dalies trečią pastraipą,

kadangi:

(1) Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 ([2]) priede, be kitų dalykų, nurodyta išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų (toliau – ECAI) nustatytų atitinkamų kredito rizikos vertinimų (toliau – išoriniai kredito rizikos vertinimai) ir Komisijos deleguotojo reglamento (ES) 2015/35 ([3]) 3 straipsnyje nurodytų kredito kokybės žingsnių atitiktis;

(2) nuo paskutinių Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 priedo pakeitimų, padarytų Komisijos įgyvendinimo reglamentu (ES) 2020/744 ([4]), pasikeitė kiekybiniai ir kokybiniai veiksniai, kuriais grindžiami kai kurių priskyrimų kredito rizikos vertinimai. Be to, kai kurios ECAI savo kredito rizikos vertinimus pradėjo taikyti naujiems rinkos segmentams, todėl atsirado naujų reitingų skalių ir naujų kredito reitingų rūšių. Todėl reikia atnaujinti atitinkamoms ECAI nustatytus priskyrimus;

(3) nuo tada, kai buvo priimtas Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2020/744, pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1060/2009 ([5]) 14–18 straipsnius buvo įregistruotos dvi kredito reitingų agentūros, o dar dvi ECAI, kurioms pagal Įgyvendinimo reglamentą (ES) 2016/1800 buvo nustatytas priskyrimas, buvo išregistruotos. Todėl būtina nustatyti priskyrimą įregistruotoms naujoms ECAI ir panaikinti priskyrimą išregistruotoms ECAI;

(4) be to, viena pagal Reglamento (ES) Nr. 1060/2009 14–18 straipsnius įregistruota ECAI, kuriai pagal Įgyvendinimo reglamentą (ES) 2016/1800 buvo nustatytas priskyrimas, iš dalies pakeitė simbolius, naudojamus jos reitingų skalių reitingų kategorijoms nurodyti. Todėl būtina iš dalies pakeisti tai ECAI nustatytą priskyrimą, kad jis atitiktų tos ECAI dabar naudojamus simbolius;

(5) šis reglamentas grindžiamas Europos bankininkystės institucijos (EBA), Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos (ESMA) ir Europos draudimo ir profesinių pensijų institucijos (EIOPA) (toliau – Europos priežiūros institucijos) Komisijai bendrai pateiktais techninių įgyvendinimo standartų projektais;

([1]) OL L 335, 2009 12 17, p. 1.

([2]) 2016 m. spalio 11 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1800, kuriuo pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2009/138/EB nustatomi techniniai įgyvendinimo standartai, susiję su išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų kredito rizikos vertinimų susiejimu su objektyvia kredito kokybės žingsnių skale (OL L 275, 2016 10 12, p. 19).

([3]) 2014 m. spalio 10 d. Komisijos deleguotasis reglamentas (ES) 2015/35, kuriuo papildoma Europos Parlamento ir Tarybos direktyva 2009/138/EB dėl draudimo ir perdraudimo veiklos pradėjimo ir jos vykdymo (Mokumas II), (OL L 12, 2015 1 17, p. 1.).

([4]) 2020 m. birželio 4 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2020/744, kuriuo iš dalies keičiamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1800, kuriuo pagal Europos Parlamento ir Tarybos direktyvą 2009/138/EB nustatomi techniniai įgyvendinimo standartai, susiję su išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų kredito rizikos vertinimų susiejimu su objektyvia kredito kokybės žingsnių skale (OL L 176, 2020 6 5, p. 4).

([5]) 2009 m. rugsėjo 16 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (EB) Nr. 1060/2009 dėl kredito reitingų agentūrų (OL L 302, 2009 11 17, p. 1).

(6) Europos priežiūros institucijos dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė Bankininkystės suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1093/2010 ([6]) 37 straipsnį, patarimo, Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([7]) 37 straipsnį, patarimo ir Draudimo ir perdraudimo suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1094/2010 ([8]) 37 straipsnį, patarimo;

(7) todėl Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1800 turėtų būti atitinkamai iš dalies pakeistas,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 pakeitimas

Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 priedas pakeičiamas šio reglamento priedo tekstu.

2 straipsnis

Įsigaliojimas

Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas privalomas visas ir tiesiogiai taikomas visose valstybėse narėse.

Priimta Briuselyje 2021 m. lapkričio 16 d.

Komisijos vardu
Pirmininkė
Ursula VON DER LEYEN

([6]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1093/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos bankininkystės institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/78/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 12).

([7]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1095/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos vertybinių popierių ir rinkų institucija) ir iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB bei panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/77/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 84).

([8]) 2010 m. lapkričio 24 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 1094/2010, kuriuo įsteigiama Europos priežiūros institucija (Europos draudimo ir profesinių pensijų institucija), iš dalies keičiamas Sprendimas Nr. 716/2009/EB ir panaikinamas Komisijos sprendimas 2009/79/EB (OL L 331, 2010 12 15, p. 48).

PRIEDAS

„„PRIEDAS

Kredito rizikos vertinimų, kuriuos nustato išorinės kredito rizikos vertinimo institucijos, susiejimas su objektyvia kredito kokybės žingsnių skale

Kredito kokybės žingsnis	0	1	2	3	4	5	6
A.M. Best (EU) Rating Services B.V.							
Emitentų ilgalaikių kredito reitingų skalė	aaa	aa, aa-	a+, a, a-	bbb+, bbb, bbb-	bb+, bb, bb-	b+, b, b-	ccc+, ccc, ccc-, cc, c, d, e, f, s
Emisijų ilgalaikių reitingų skalė	aaa	aa, aa-	a+, a, a-	bbb+, bbb, bbb-	bb+, bb, bb-	b+, b, b-	ccc+, ccc, ccc-, cc, c, d, s
Finansinio patikimumo reitingų skalė		A++, A+	A, A-	B++, B+	B, B-	C++, C+	C, C-, D, E, F, S
Emitentų trumpalaikių reitingų skalė		AMB-1+	AMB-1-	AMB-2, AMB-3	AMB- 4, d, e, f, s		
Emisijų trumpalaikių reitingų skalė		AMB-1+	AMB-1-	AMB-2, AMB-3	AMB- 4, d, s		
ARC Ratings S.A.							
Emitentų vidutinės trukmės ir ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Emisijų vidutinės trukmės ir ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Žalos išmokėjimo pajėgumo reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, R
Emitentų trumpalaikių reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Emisijų trumpalaikių reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH							
Ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC/C, D

Įmonių trumpalaikių reitingų skalė		A++	A		B, C, D		
Axesor Risk Management SL							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E
Pasaulinių trumpalaikių reitingų skalė		AS1+	AS1	AS2	AS3, AS4, AS5		
Banque de France							
Emitentų pasaulinių ilgalaikių kredito reitingų skalė		3++	3+, 3	4+	4, 5+	5, 6	7, 8, 9, P
Emitentų pasaulinių ilgalaikių kredito reitingų skalė (nauja reitingų skalė, NEC)		1+	1, 1-	2+, 2, 2-	3+, 3, 3-, 4+, 4, 4-, 5+	5, 5-, 6+, 6, 6-	7, 8, P
BCRA – Credit Rating Agency AD							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Pasaulinių trumpalaikių reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Pensijų draudimo įmonių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Pensijų draudimo įmonių trumpalaikių reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Pensijų fondų ilgalaikių reitingų skalė	AAA pf	AA pf	A pf	BBB pf	BB pf	B pf	C pf
Garantijų fondų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	C, D
Garantijų fondų trumpalaikių reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Capital Intelligence Ratings Ltd							
Emitentų tarptautinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	C, RS, SD, D
Emisijų tarptautinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D

Draudikų finansinio patikimumo tarptautinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	C, RS, SD, D
Emitentų tarptautinių trumpalaikių reitingų skalė		A1+	A1	A2, A3	B, C, RS, SD, D		
Emisijų tarptautinių trumpalaikių reitingų skalė		A1+	A1	A2, A3	B, C, D		
Draudikų finansinio patikimumo tarptautinių trumpalaikių reitingų skalė		A1+	A1	A2, A3	B, C, RS, SD, D		
Cerved Rating Agency S.p.A.							
Įmonių ilgalaikių reitingų skalė	A1.1	A1.2, A1.3	A2.1, A2.2, A3.1	B1.1, B1.2	B2.1, B2.2	C1.1	C1.2, C2.1
Įmonių trumpalaikių reitingų skalė		S-1	S-2	S-3	V-1, R-1		
Creditreform Rating AG							
Ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A		BBB	BB, B	C, SD, D
Emisijų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A		BBB	BB, B	C, D
Trumpalaikių reitingų skalė	L1	L2		L3, NEL, D			
CRIF Ratings S.r.l.							
Emitentų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D1S, D
Emisijų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, DS
MVĮ reitingų skalė		SME1, SME2		SME3	SME4	SME5, SME6	SME7, SME8
Emitentų trumpalaikių reitingų skalė		IG-1		IG-2	SIG-1, SIG-2, SIG-3, SIG-4		
Emisijų trumpalaikių reitingų skalė		IG-1		IG-2	SIG-1, SIG-2, SIG-3, SIG-4		

DBRS Ratings GmbH							
Ilgalaikių įsipareigojimų reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Komercinių vekselių ir trumpalaikių skolinių įsipareigojimų reitingų skalė		R-1 H, R-1 M	R-1 L	R-2, R-3	R-4, R-5, D		
Finansinio patikimumo reitingų skalė		AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, R
Tikėtino nuostolio reitingų skalė		AAA(el), AA(el)	A(el)	BBB(el)	BB(el)	B(el)	CCC(el), CC(el), C(el)
Egan-Jones Ratings Co.							
Ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Trumpalaikių kredito reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2	A-3, B, C, D		
EuroRating Sp. z o.o.							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Fitch Ratings Ireland Limited							
Emitentų įsipareigojimų neįvykdymo ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, RD, D
Įmonių finansavimo įsipareigojimų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C
Draudikų finansinio patikimumo ilgalaikių tarptautinių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C
Išvestinių finansinių priemonių sandorio šalių reitingų skalė		AAA dcr, AA dcr	A dcr	BBB dcr	BB dcr	B dcr	CCC dcr, CC dcr, C dcr
Trumpalaikių reitingų skalė		F1+	F1	F2, F3	B, C, RD, D		
Draudikų finansinio patikimumo trumpalaikių reitingų skalė		F1+	F1	F2, F3	B, C		

GBB-Rating Gesellschaft für Bonitätsbeurteilung mbH							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
HR Ratings de México, S.A. de C.V.							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	HR AAA(G)	HR AA(G)	HR A(G)	HR BBB(G)	HR BB(G)	HR B(G)	HR C(G)/HR D(G)
Pasaulinių trumpalaikių reitingų skalė	HR+1(G)	HR1(G)	HR2(G)	HR3(G)	HR4(G), HR5(G), HR D(G)		
ICAP S.A							
Emitentų pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė			AAA, AA	A, BBB	BB, B	CCC, CC	C, D
Emisijų pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė			AAA, AA	A, BBB	BB, B	CCC, CC	C, D
INBONIS SA							
Ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Japan Credit Rating Agency Ltd							
Emitentų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, LD, D
Emisijų ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Emitentų trumpalaikių reitingų skalė		J-1+	J-1	J-2	J-3, NJ, LD, D		
Emisijų trumpalaikių kredito reitingų skalė		J-1+	J-1	J-2	J-3, NJ, D		
Kroll Bond Rating Agency Europe							
Ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Trumpalaikių kredito reitingų skalė		K1+	K1	K2, K3	B, C, D		

modeFinance S.r.l.							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	A1	A2	A3	B1	B2	B3	C1, C2, C3, D
Moody's Investors Service							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	Aaa	Aa	A	Baa	Ba	B	Caa, Ca, C
Pasaulinių trumpalaikių reitingų skalė		P-1	P-2	P-3	NP		
Nordic Credit Rating AS							
Ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, SD
Trumpalaikių reitingų skalė				N-1+	N-1, N-2, N-3, N-4		
QIVALIO SAS (buvusi Spread Research)							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Pasaulinių trumpalaikių reitingų skalė		SR0		SR1, SR2	SR3, SR4, SR5, SRD		
Rating-Agentur Expert RA GmbH							
Tarptautinių ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E
Tarptautinių patikimumo reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E
Tarptautinių trumpalaikių reitingų skalė		RA1+	RA1	RA2, RA3	RA4, RA5, C, D		
Scope Ratings AG							
Ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Trumpalaikių reitingų skalė		S-1+	S-1	S-2	S-3, S-4		

Scope Hamburg GmbH							
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, SD, D
S&P Global Ratings							
Emitentų ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, R, SD/D
Emisijų ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Draudikų finansinio patikimumo reitingų skalė	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, SD/D, R
Ilgalaikiai finansų įstaigų pertvarkymo sandorio šalių reitingai	AAA	AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, SD, D
Vidutinės rinkos vertės įmonių reitingų skalė			MM1	MM2	MM3, MM4	MM5, MM6	MM7, MM8, MMD
Emitentų trumpalaikių kredito reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, R, SD/D		
Emisijų trumpalaikių kredito reitingų skalė		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Trumpalaikiai finansų įstaigų pertvarkymo sandorio šalių reitingai		A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, SD/D“		