VYKONÁVACIE NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2018/634

z 24. apríla 2018,

ktorým sa mení vykonávacie nariadenie (EÚ) 2016/1799, pokiaľ ide o tabuľky zaraďovania, v ktorých sa uvádza zhoda medzi hodnoteniami kreditného rizika od externých ratingových agentúr a stupňami kreditnej kvality uvedenými v nariadení Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 575/2013

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 575/2013 z 26. júna 2013 o prudenciálnych požiadavkách na úverové inštitúcie a investičné spoločnosti ([1]), a najmä na jeho článok 136 ods. 1 tretí pododsek,

keďže:

(1) V prílohe III k vykonávaciemu nariadeniu Komisie (EÚ) 2016/1799 ([2]) sa stanovuje zhoda medzi príslušnými ratingovými hodnoteniami, ktoré vydáva externá ratingová agentúra (ECAI), a stupňom kreditnej kvality stanoveným v tretej časti hlave II kapitole 2 oddiele 2 nariadenia (EÚ) č. 575/2013 (zaraďovanie).

(2) Od prijatia vykonávacieho nariadenia (EÚ) 2016/1799 boli v súlade s nariadením Európskeho parlamentu a Rady (ES) č. 1060/2009 ([3]) zaregistrované alebo certifikované dodatočné ratingové agentúry. Jednej z externých ratingových agentúr, pre ktorú sa vo vykonávacom nariadení (EÚ) 2016/1799 uvádzalo zaraďovanie, bola navyše registrácia zrušená. Vzhľadom na to, že v článku 136 ods. 1 nariadenia (EÚ) č. 575/2013 sa vyžaduje, aby sa pre všetky ECAI stanovilo zaraďovanie, je nevyhnutné zmeniť vykonávacie nariadenie (EÚ) 2016/1799 tak, aby sa pre novo registrované alebo certifikované ECAI poskytlo zaraďovanie a aby sa zrušilo zaraďovanie ECAI so zrušenou registráciou.

(3) Toto nariadenie vychádza z návrhu vykonávacích technických predpisov, ktorý Komisii spoločne predložili európske orgány dohľadu (Európsky orgán pre bankovníctvo, Európsky orgán pre cenné papiere a trhy a Európsky orgán pre poisťovníctvo a dôchodkové poistenie zamestnancov).

(4) Európske orgány dohľadu vykonali otvorené verejné konzultácie k návrhu vykonávacích technických predpisov, z ktorých toto nariadenie vychádza, analyzovali možné súvisiace náklady a prínosy a požiadali o stanovisko Skupinu zainteresovaných strán v bankovníctve zriadenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1093/2010 ([4]), Skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov zriadenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 ([5]) a Skupinu zainteresovaných strán v poisťovníctve a zaisťovníctve zriadenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1094/2010 ([6]).

(5) Vykonávacie nariadenie (EÚ) 2016/1799 by sa preto malo zodpovedajúcim spôsobom zmeniť,

---

([1]) Ú. v. EÚ L 176, 27.6.2013, s. 1.

([2]) Vykonávacie nariadenie Komisie (EÚ) 2016/1799 zo 7. októbra 2016, ktorým sa stanovujú vykonávacie technické predpisy, pokiaľ ide o zaraďovanie ratingových hodnotení od externých ratingových agentúr pre kreditné riziko v súlade s článkom 136 ods. 1 a článkom 136 ods. 3 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 575/2013 (Ú. v. EÚ L 275, 12.10.2016, s. 3).

([3]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (ES) č. 1060/2009 zo 16. septembra 2009 o ratingových agentúrach (Ú. v. EÚ L 302, 17.11.2009, s. 1).

([4]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1093/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre bankovníctvo) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/78/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 12).

([5]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/77/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84).

([6]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1094/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre poisťovníctvo a dôchodkové poistenie zamestnancov) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/79/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 48).

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Zmena vykonávacieho nariadenia (EÚ) 2016/1799

Príloha III k vykonávaciemu nariadeniu (EÚ) 2016/1799 sa nahrádza textom uvedeným v prílohe k tomuto nariadeniu.

Článok 2

Nadobudnutie účinnosti

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 24. apríla 2018

Za Komisiu

predseda

Jean-Claude JUNCKER

PRÍLOHA

„PRÍLOHA III

Tabuľky zaraďovania na účely článku 16

Stupeň kreditnej kvality	**1**	**2**	**3**	**4**	**5**	**6**
AM Best Europe-Rating Services Ltd.						
Stupnica pre dlhodobé úverové ratingy emitentov	aaa, a. a.+, a. a., a. a.-	a+, a, a-	bbb+, bbb, bbb-	bb+, bb, bb-	b+, b, b-	ccc+, ccc, ccc-, cc, c, rs
Stupnica pre dlhodobé ratingy dlhu	aaa, a. a.+, a. a., a. a.-	a+, a, a-	bbb+, bbb, bbb-	bb+, bb, bb-	b+, b, b-	ccc+, ccc, ccc-, cc, c, d
Stupnica pre ratingy finančnej sily	A++, A+	A, A-	B++, B+	B, B-	C++, C+	C, C-, D, E, F, S
Stupnica pre krátkodobé ratingy	AMB-1+	AMB-1-	AMB-2, AMB-3	AMB-4		
ARC Ratings S.A.						
Stupnica pre strednodobý a dlhodobý rating emitentov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre strednodobý a dlhodobý rating emisií	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre krátkodobý rating emitentov	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Stupnica pre krátkodobý rating emisií	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH						
Stupnica pre dlhodobý úverový rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC/C, D
Stupnica pre krátkodobý rating spoločností	A++	A		B, C, D		
Axesor SA						
Stupnica pre globálny rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E
Banque de France						
Stupnica pre globálne dlhodobé úverové ratingy emitentov	3++	3+, 3	4+	4, 5+	5, 6	7, 8, 9, P

BCRA – Credit Rating Agency AD						
Stupnica pre dlhodobé ratingy bánk	AAA, AA	A	BBB	BB	B	C, D
Stupnica pre dlhodobé ratingy poisťovní	iAAA, iAA	iA	iBBB	iBB	iB	iC, iD
Stupnica pre dlhodobé ratingy spoločností	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre dlhodobé ratingy obcí	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre dlhodobé ratingy emisií	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre krátkodobé ratingy bánk	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Stupnica pre krátkodobé ratingy spoločností	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Stupnica pre krátkodobé ratingy obcí	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Stupnica pre krátkodobý rating emisie	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Capital Intelligence Ltd						
Stupnica pre medzinárodný dlhodobý rating emitenta	AAA, AA	A	BBB	BB	B	C, RS, SD, D
Stupnica pre medzinárodný dlhodobý rating emisie	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre medzinárodný krátkodobý rating emitenta	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Stupnica pre medzinárodný krátkodobý rating emisie	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Cerved Rating Agency S.p.A.						
Stupnica pre dlhodobý rating spoločností	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
Creditreform Ratings AG						
Stupnica pre dlhodobý rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	C, D
CRIF S.p.A.						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, D1, D2
Dagong Europe Credit Rating						
Stupnica pre dlhodobý úverový rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre krátkodobý úverový rating	A-1		A-2, A-3	B, C, D		

DBRS Ratings Limited						
Stupnica pre dlhodobý rating záväzkov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre rating komerčných cenných papierov a krátkodobého dlhu	R-1 H, R-1 M	R-1 L	R-2, R-3	R-4, R-5, D		
Stupnica pre rating schopnosti vyplácať poistné plnenia	IC-1	IC-2	IC-3	IC-4	IC-5	D
Egan-Jones Ratings Co.						
Stupnica pre dlhodobý úverový rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC,CC, C, D
Stupnica pre krátkodobý úverový rating	A-1+	A-1	A-2	A-3, B, C, D		
Euler Hermes Rating GmbH						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, SD, D
European Rating Agency, a. s.						
Stupnica pre dlhodobý rating		AAA, AA, A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre krátkodobý rating		S1	S2	S3, S4, NS		
EuroRating Sp. z o.o.						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Fitch Ratings						
Stupnica pre dlhodobé úverové ratingy emitentov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, RD, D
Finančné záväzky podnikov – stupnica pre dlhodobé ratingy	AAA AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C
Stupnica pre dlhodobé medzinárodné ratingy finančnej sily poisťovateľa	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C
Stupnica pre krátkodobý rating	F1+	F1	F2, F3	B, C, RD, D		
Stupnica pre krátkodobé ratingy finančnej sily poisťovateľa	F1+	F1	F2, F3	B, C		
GBB-Rating Gesellschaft für Bonitäts-beurteilung mbH						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	AAA, AA		A, BBB	BB	B	CCC, CC, C, D

HR Ratings de México, S.A. de C.V.						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	HR AAA(G)/HR AA(G)	HR A(G)	HR BBB(G)	HR BB(G)	HR B(G)	HR C(G)/HR D(G)
Stupnica pre globálny krátkodobý rating	HR+1(G)/HR1(G)	HR2(G)	HR3(G)	HR4(G), HR5(G), HR D(G)		
ICAP Group S.A						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating		AA, A	BB, B	C, D	E, F	G, H
INC Rating Sp. z o.o.						
Stupnica pre dlhodobý úverový rating emitentov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC,CC, C, D
Japan Credit Rating Agency Ltd						
Stupnica pre dlhodobé ratingy emitentov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, LD, D
Stupnica pre dlhodobé ratingy emisie	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre krátkodobé ratingy emitentov	J-1+	J-1	J-2	J-3, NJ, LD, D		
Stupnica pre krátkodobé úverové ratingy emisie	J-1+	J-1	J-2	J-3, NJ, D		
Kroll Bond Rating Agency						
Stupnica pre dlhodobý úverový rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre krátkodobý úverový rating	K1+	K1	K2, K3	B, C, D		
modeFinance S.r.l.						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	A1,A2	A3	B1	B2	B3	C1, C2, C3, D
Moody's Investors Service						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	Aaa, Aa	A	Baa	Ba	B	Caa, Ca, C
Stupnica pre rating dlhopisových fondov	Aaa-bf, Aa-bf	A-bf	Baa-bf	Ba-bf	B-bf	Caa-bf, Ca-bf, C-bf
Stupnica pre globálny krátkodobý rating	P-1	P-2	P-3	NP		

Rating-Agentur Expert RA GmbH						
Stupnica pre medzinárodný úverový rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC,CC, C, D
Stupnica pre medzinárodný rating spoľahlivosti	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC,CC, C, D, E
Scope Ratings AG						
Stupnica pre globálny dlhodobý rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC,C, D
Stupnica pre globálny krátkodobý rating	S-1+	S-1	S-2	S-3, S-4		
Spread Research						
Stupnica pre medzinárodný dlhodobý rating	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Standard & Poor's Ratings Services						
Stupnica pre dlhodobé úverové ratingy emitentov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, R, SD/D
Stupnica pre dlhodobé úverové ratingy emisie	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Stupnica pre ratingy finančnej sily poisťovateľa	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, SD/D, R
Stupnica pre ratingy úverovej kvality fondov	AAAf, AAf	Af	BBBf	BBf	Bf	CCCf
Stupnica pre ratingy hodnotenia spoločností na strednom trhu		MM1	MM2	MM3, MM4	MM5, MM6	MM7, MM8, MMD
Stupnica pre krátkodobé úverové ratingy emitentov	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, R, SD/D		
Stupnica pre krátkodobé úverové ratingy emisie	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
The Economist Intelligence Unit Ltd						
Stupnica pre rating štátov	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D“