KOMMISSIONENS GENNEMFØRELSESFORORDNING (EU) 2019/2028

af 29. november 2019

om ændring af gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 for så vidt angår de konverteringstabeller, der angiver, til hvilke kreditkvalitetstrin i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 kreditrisikovurderingerne fra eksterne kreditvurderingsbureauer svarer

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 af 26. juni 2013 om tilsynsmæssige krav til kreditinstitutter og investeringsselskaber ([1]), særlig artikel 136, stk. 1, tredje afsnit, og

ud fra følgende betragtninger:

(1) I bilag III til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 ([2]) angives det, til hvilke kreditkvalitetstrin i tredje del, afsnit II, kapitel 2, afdeling 2, i forordning (EU) nr. 575/2013 de relevante kreditvurderinger fra et eksternt kreditvurderingsbureau (»ECAI«) svarer (konvertering).

(2) Efter de seneste ændringer ved Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2018/634 ([3]) af bilag III til gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 har de kvantitative og kvalitative faktorer, som ligger til grund for kreditvurderingerne for flere konverteringer i bilag III til gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799, ændret sig. Endvidere har flere ECAI'er udvidet deres kreditvurderinger til at omfatte nye markedssegmenter, hvilket har ført til nye ratingskalaer og nye kreditvurderingstyper. Det er derfor nødvendigt at opdatere konverteringerne for de berørte ECAI'er.

(3) Siden vedtagelsen af gennemførelsesforordning (EU) 2018/634 er der blevet registreret yderligere et kreditvurderingsbureau i overensstemmelse med Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 ([4]). Da det i henhold til artikel 136, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013 kræves, at der angives konverteringer for alle ECAI'er, er det nødvendigt at fastsætte en konvertering for nævnte nyligt registrerede ECAI. De kreditvurderinger, som det nyligt registrerede ECAI anvender, er baseret på den samme metode som den, der anvendes af dets moderselskab, et ECAI fra et tredjeland, for hvilket der allerede er blevet fastsat en konvertering i bilag III til gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799. I dette særlige tilfælde bør nævnte konvertering for det nyligt registrerede ECAI afspejle den konvertering, der er fastsat for nævnte ECAI fra et tredjeland.

(4) Denne forordning er baseret på det udkast til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Banktilsynsmyndighed, Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed og Den Europæiske Tilsynsmyndighed for Forsikrings- og Arbejdsmarkedspensionsordninger i fællesskab (de europæiske tilsynsmyndigheder) har forelagt Kommissionen.

([1]) EUT L 176 af 27.6.2013, s. 1.

([2]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 af 7. oktober 2016 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder vedrørende konvertering af kreditvurderinger fra eksterne kreditvurderingsbureauer med hensyn til kreditrisiko i overensstemmelse med artikel 136, stk. 1 og 3, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 (EUT L 275 af 12.10.2016, s. 3).

([3]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2018/634 af 24. april 2018 om ændring af gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 for så vidt angår de konverteringstabeller, der angiver til hvilke kreditkvalitetstrin i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 kreditrisikovurderingerne fra eksterne kreditvurderingsbureauer svarer (EUT L 105 af 25.4.2018, s. 14).

([4]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EF) nr. 1060/2009 af 16. september 2009 om kreditvurderingsbureauer (EUT L 302 af 17.11.2009, s. 1).

(5) De europæiske tilsynsmyndigheder har afholdt åbne offentlige høringer om udkastet til gennemførelsesmæssige tekniske standarder, analyseret de potentielle omkostninger og fordele i forbindelse hermed samt anmodet interessentgruppen for banker, der er nedsat i henhold artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1093/2010 ([5]), interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold til artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 ([6]), og interessentgruppen for forsikrings- og genforsikringsordninger, der er nedsat i henhold til artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1094/2010 ([7]), om en udtalelse.

(6) Gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 bør derfor ændres —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Ændring af gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799

Bilag III til gennemførelsesforordning (EU) 2016/1799 erstattes af teksten i bilaget til nærværende forordning.

Artikel 2

Ikrafttræden

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 29. november 2019.

På Kommissionens vegne
Jean-Claude JUNCKER
Formand

([5]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1093/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Banktilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/78/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 12).

([6]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/77/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84).

([7]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1094/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Tilsynsmyndighed for Forsikrings- og Arbejdsmarkedspensionsordninger), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/79/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 48).

BILAG

»

BILAG III

Konverteringstabeller, jf. artikel 16

Kreditkvalitetstrin	1	2	3	4	5	6
ACRA Europe, a.s (tidligere European Rating Agency, a.s.)						
Global ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Global ratingskala, kortfristet	S1		S2	S3, S4, NS		
AM Best Europe Rating Services						
Kreditratingskala, udstedere, langfristet	aaa, aa+, aa, aa-	a+, a, a-	bbb+, bbb, bbb-	bb+, bb, bb-	b+, b, b-	ccc+, ccc, ccc-, cc, c, d, e, f, s
Ratingskala, udstedelser, langfristet	aaa, aa+, aa, aa-	a+, a, a-	bbb+, bbb, bbb-	bb+, bb, bb-	b+, b, b-	ccc+, ccc, ccc-, cc, c, d, s
Ratingskala, finansiel styrke	A++, A+	A, A-	B++, B+	B, B-	C++, C+	C, C-, D, E, F, S
Ratingskala, udstedere, kortfristet	AMB-1+	AMB-1-	AMB-2, AMB-3	AMB- 4, d, e, f, s		
Ratingskala, udstedelser, kortfristet	AMB-1+	AMB-1-	AMB-2, AMB-3	AMB- 4, d, s		
ARC Ratings S.A.						
Ratingskala, udstedere, mellem- og langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Ratingskala, udstedelser, mellem- og langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Ratingskala, udstedere, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Ratingskala, udstedelser, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
ASSEKURATA Assekuranz Rating-Agentur GmbH						
Kreditratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC/C, D
Ratingskala, erhvervsvirksomheder, kortfristet	A++	A		B, C, D		
Axesor Risk Management SL						
Global ratingskala	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E

Kreditkvalitetstrin	1	2	3	4	5	6
Banque de France						
Global kreditratingskala, udstedere, langfristet	3++	3+, 3	4+	4, 5+	5, 6	7, 8, 9, P
BCRA — Credit Rating Agency AD						
Global ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Global ratingskala, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Ratingskala, pensionsforsikringsselskaber, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Ratingskala, pensionsforsikringsselskaber, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Ratingskala, pensionskasser, langfristet	AAA pf, AA pf	A pf	BBB pf	BB pf	B pf	C pf
Ratingskala, garantifonde, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	C, D
Ratingskala, garantifonde, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
Capital Intelligence Ratings Ltd						
International ratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	C, RS, SD, D
International ratingskala, udstedelser, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
International ratingskala, forsikringsselskabers finansielle styrke, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	C, RS, SD, D
International ratingskala, udstedere, kortfristet	A1+	A1	A2, A3	B, C, RS, SD, D		
International ratingskala, udstedelser, kortfristet	A1+	A1	A2, A3	B, C, D		
International ratingskala, forsikringsselskabers finansielle styrke, kortfristet	A1+	A1	A2, A3	B, C, RS, SD, D		
Cerved Rating Agency S.p.A.						
Ratingskala, erhvervsvirksomheder, langfristet	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 Rating AG						
Ratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A		BBB	BB	B, C, SD, D
Ratingskala, udstedelser, langfristet	AAA, AA	A		BBB	BB	B, C, D
Ratingskala, kortfristet	L1	L2		L3, NEL, D		

Kreditkvalitetstrin	1	2	3	4	5	6
CRIF Ratings S.r.l.						
Ratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D1S, D
Ratingskala, udstedelser, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, DS
Ratingskala, udstedere, kortfristet	IG-1		IG-2	SIG-1, SIG-2, SIG-3, SIG-4		
Ratingskala, udstedelser, kortfristet	IG-1		IG-2	SIG-1, SIG-2, SIG-3, SIG-4		
Dagong Europe Credit Rating Srl						
Kreditratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Kreditratingskala, kortfristet	A-1		A-2, A-3	B, C, D		
DBRS Ratings						
Ratingskala, forpligtelser, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Ratingskala, virksomhedscertifikater/kortfristet gæld	R-1 H, R-1 M	R-1 L	R-2, R-3	R-4, R-5, D		
Ratingskala, finansiel styrke	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, R
Egan-Jones Ratings Co.						
Kreditratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Kreditratingskala, kortfristet	A-1+	A-1	A-2	A-3, B, C, D		
Euler Hermes Rating GmbH						
Global ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, SD, D
EuroRating Sp. z o.o.						
Global ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Fitch Ratings						
Misligholdelsesratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, RD, D
Erhvervsfinansieringsforpligtelser — ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C
International ratingskala, forsikringsselskabers finansielle styrke, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C

Kreditkvalitetstrin	1	2	3	4	5	6
Ratingskala — Derivatmodparter	AAA dcr, AA dcr	A dcr	BBB dcr	BB dcr	B dcr	CCC dcr, CC dcr, C dcr
Ratingskala, kortfristet	F1+	F1	F2, F3	B, C, RD, D		
Ratingskala, IFS, kortfristet	F1+	F1	F2, F3	B, C		
GBB-Rating Gesellschaft für Bonitätsbeurteilung GmbH						
Global ratingskala, langfristet	AAA, AA		A, BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
HR Ratings de México, S.A. de C.V.						
Global ratingskala, langfristet	HR AAA(G)/HR AA(G)	HR A(G)	HR BBB(G)	HR BB(G)	HR B(G)	HR C(G)/HR D(G)
Global ratingskala, kortfristet	HR+1(G)/HR1 (G)	HR2(G)	HR3(G)	HR4(G), HR5 (G), HR D(G)		
ICAP Group S.A						
Global ratingskala, langfristet		AA, A	BB, B	C, D	E, F	G, H
INC Rating Sp. z o.o.						
Kreditratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Japan Credit Rating Agency Ltd						
Ratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, LD, D
Ratingskala, udstedelser, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Ratingskala, udstedere, kortfristet	J-1+	J-1	J-2	J-3, NJ, LD, D		
Kreditratingskala, udstedelser, kortfristet	J-1+	J-1	J-2	J-3, NJ, D		
Kroll Bond Rating Agency						
Kreditratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Kreditratingskala, kortfristet	K1+	K1	K2, K3	B, C, D		
Kroll Bond Rating Agency Europe						
Kreditratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Kreditratingskala, kortfristet	K1+	K1	K2, K3	B, C, D		

Kreditkvalitetstrin	1	2	3	4	5	6
modeFinance S.r.l.						
Global ratingskala, langfristet	A1, A2	A3	B1	B2	B3	C1, C2, C3, D
Moody's Investors Service						
Global ratingskala, langfristet	Aaa, Aa	A	Baa	Ba	B	Caa, Ca, C
Global ratingskala, kortfristet	P-1	P-2	P-3	NP		
QIVALIO SAS (tidligere Spread Research)						
Global ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Global ratingskala, kortfristet	SR0		SR1, SR2	SR3, SR4, SR5, SRD		
Rating-Agentur Expert RA GmbH						
International kreditratingskala	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E
International pålidelighedsratingskala	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E
Scope Ratings GmbH						
Ratingskala, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC,C, D
Ratingskala, kortfristet	S-1+	S-1	S-2	S-3, S-4		
S&P Global Ratings Europe Limited						
Kreditratingskala, udstedere, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, R, SD/D
Kreditratingskala, udstedelser, langfristet	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Ratingskala, forsikringsselskabers finansielle styrke	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, SD/D, R
Ratingskala, midtmarkedsevalueringer		MM1	MM2	MM3, MM4	MM5, MM6	MM7, MM8, MMD
Kreditratingskala, udstedere, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, R, SD/D		
Kreditratingskala, udstedelser, kortfristet	A-1+	A-1	A-2, A-3	B, C, D		
The Economist Intelligence Unit Ltd						
Ratingskala (bånd), statslige låntagere	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D