KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2019/2028

2019 m. lapkričio 29 d.

kuriuo dėl priskyrimo lentelių, kuriose nurodoma išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų pateiktų kredito rizikos vertinimų ir Europos Parlamento ir Tarybos reglamente (ES) Nr. 575/2013 nustatytų kredito kokybės žingsnių atitiktis, iš dalies keičiamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1799

(Tekstas svarbus EEE)

EUROPOS KOMISIJA,

atsižvelgdama į Sutartį dėl Europos Sąjungos veikimo,

atsižvelgdama į 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (ES) Nr. 575/2013 dėl prudencinių reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms ([1]), ypač į jo 136 straipsnio 1 dalies trečią pastraipą,

kadangi:

(1) Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1799 ([2]) III priede nurodoma išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų (toliau – ECAI) nustatytų atitinkamų kredito rizikos vertinimų ir Reglamento (ES) Nr. 575/2013 trečios dalies II antraštinės dalies 2 skyriaus 2 skirsnyje nustatytų kredito kokybės žingsnių atitiktis (priskyrimas);

(2) atsižvelgiant į naujausius Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1799 III priedo pakeitimus, padarytus Komisijos įgyvendinimo reglamentu (ES) 2018/634 ([3]), pasikeitė kiekybiniai ir kokybiniai veiksniai, kuriais grindžiami kai kurių Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1799 III priede nurodytų priskyrimų kredito rizikos vertinimai. Be to, kai kurios ECAI savo kredito vertinimus pradėjo taikyti naujiems rinkos segmentams, todėl atsirado naujų reitingų skalių ir naujų kredito reitingų rūšių. Todėl reikia atnaujinti atitinkamoms ECAI nustatytus priskyrimus;

(3) po Įgyvendinimo reglamento (ES) 2018/634 priėmimo pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (EB) Nr. 1060/2009 ([4]) buvo užregistruota dar viena kredito reitingų agentūra. Kadangi Reglamento (ES) Nr. 575/2013 136 straipsnio 1 dalyje reikalaujama tiksliai nurodyti visoms ECAI nustatytus priskyrimus, būtina tai įregistruotai naujai ECAI nustatyti priskyrimą. Įregistruotos naujos ECAI taikomi kredito vertinimai yra pagrįsti ta pačia metodika, kaip ta, kurią taiko jos patronuojančioji įmonė, t. y. trečiosios šalies ECAI, kuriai priskyrimas jau buvo nustatytas Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1799 III priede. Todėl šiuo konkrečiu atveju tikslinga, kad įregistruotai naujai ECAI nustatytas priskyrimas atitiktų tai trečiosios šalies ECAI nustatytą priskyrimą;

(4) šis reglamentas grindžiamas Europos bankininkystės institucijos, Europos vertybinių popierių ir rinkų institucijos ir Europos draudimo ir profesinių pensijų institucijos (Europos priežiūros institucijų) kartu Komisijai pateiktais techninių įgyvendinimo standartų projektais;

([1]) OL L 176, 2013 6 27, p. 1.

([2]) 2016 m. spalio 7 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1799, kuriuo pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 575/2013 136 straipsnio 1 ir 3 dalis nustatomi techniniai įgyvendinimo standartai, susiję su išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų pateiktų pozicijų, susijusių su kredito rizika, kredito rizikos vertinimų priskyrimu (OL L 275, 2016 10 12, p. 3).

([3]) 2018 m. balandžio 24 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2018/634, kuriuo dėl priskyrimo lentelių, kuriose nurodoma išorinių kredito rizikos vertinimo institucijų pateiktų kredito rizikos vertinimų ir Europos Parlamento ir Tarybos reglamente (ES) Nr. 575/2013 nustatytų kredito kokybės žingsnių atitiktis, iš dalies keičiamas Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1799 (OL L 105, 2018 4 25, p. 14).

([4]) 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).

(5) Europos priežiūros institucijos dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų surengė atviras viešas konsultacijas, išnagrinėjo galimas susijusias sąnaudas ir naudą ir paprašė savo nuomonę pateikti Bankininkystės suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1093/2010 ([5]) 37 straipsnį, Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([6]) 37 straipsnį, ir Draudimo ir perdraudimo suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1094/2010 ([7]) 37 straipsnį.

(6) todėl Įgyvendinimo reglamentas (ES) 2016/1799 turėtų būti atitinkamai iš dalies pakeistas,

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

1 straipsnis

Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1799 pakeitimas

Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1799 III priedas pakeičiamas šio reglamento priede pateiktu 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 2019 m. lapkričio 29 d.

Komisijos vardu
Pirmininkas
Jean-Claude JUNCKER

([5]) 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).

([6]) 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).

([7]) 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

”

III PRIEDAS

Priskyrimo lentelės 16 straipsnio taikymo tikslais

Kredito kokybės žingsnis	1	2	3	4	5	6
ACRA Europe, a.s (buvusi European Rating Agency, a.s.)						
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Pasaulinių trumpalaikių reitingų skalė	S1		S2	S3, S4, NS		
AM Best Europe Rating Services						
Emitentų ilgalaikių kredito reitingų skalė	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
Emisijų ilgalaikių reitingų skalė	aaa, aa+, 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
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 reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D, E

Kredito kokybės žingsnis	1	2	3	4	5	6
Banque de France						
Emitentų pasaulinių ilgalaikių kredito reitingų skalė	3++	3+, 3	4+	4, 5+	5, 6	7, 8, 9, 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
Creditreform Rating AG						
Emitentų 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		

Kredito kokybės žingsnis	1	2	3	4	5	6
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
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		
Dagong Europe Credit Rating Srl						
Ilgalaikių kredito reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Trumpalaikių kredito reitingų skalė	A-1		A-2, A-3	B, C, D		
DBRS Ratings						
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
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		
Euler Hermes Rating GmbH						
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, SD, D
EuroRating Sp. z o.o.						
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D
Fitch Ratings						
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 tarptautinių ilgalaikių reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C

Kredito kokybės žingsnis	1	2	3	4	5	6
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 Group S.A						
Pasaulinių ilgalaikių reitingų skalė		AA, A	BB, B	C, D	E, F	G, H
INC Rating Sp. z o.o.						
Emitentų ilgalaikių kredito 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						
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		
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		

Kredito kokybės žingsnis	1	2	3	4	5	6
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		
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 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
Scope Ratings GmbH						
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		
S&P Global Ratings Europe Limited						
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
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		
The Economist Intelligence Unit Ltd						
Valstybių reitingų skalė	AAA, AA	A	BBB	BB	B	CCC, CC, C, D