KOMISIJOS ĮGYVENDINIMO REGLAMENTAS (ES) 2020/744

2020 m. birželio 4 d.

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

(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 dalį,

kadangi:

(1) Komisijos įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 ([2]) priede nurodoma, be kita ko, 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]) I antraštinės dalies I skyriaus 2 skirsnyje nustatytų kredito kokybės žingsnių atitiktis;

(2) atsižvelgiant į naujausius Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 priedo pakeitimus, padarytus Komisijos įgyvendinimo reglamentu (ES) 2018/633 ([4]), pasikeitė kiekybiniai ir kokybiniai veiksniai, kuriais grindžiami kai kurių Įgyvendinimo reglamento (ES) 2016/1800 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) 2018/633 priėmimo pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamentą (EB) Nr. 1060/2009 ([5]) buvo įregistruota dar viena kredito reitingų agentūra. Kadangi Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 575/2013 ([6]) 136 straipsnio 1 dalyje reikalaujama tiksliai nurodyti visoms ECAI nustatytus priskyrimus, būtina tai įregistruotai naujai ECAI nustatyti priskyrimą. Įregistruotos naujos ECAI taikomi kredito rizikos vertinimai yra pagrįsti ta pačia metodika, kaip tie, kuriuos taiko jos patronuojančioji įmonė, t. y. trečiosios šalies ECAI, kuriai priskyrimas jau buvo nustatytas. 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 (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]) 2018 m. balandžio 24 d. Komisijos įgyvendinimo reglamentas (ES) 2018/633, 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 105, 2018 4 25, p. 6).

([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]) 2013 m. birželio 26 d. Europos Parlamento ir Tarybos reglamentas (ES) Nr. 575/2013 dėl prudencinių reikalavimų kredito įstaigoms ir investicinėms įmonėms ir kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 648/2012 (OL L 176, 2013 6 27, p. 1).

(5) Europos priežiūros institucijos dėl techninių įgyvendinimo standartų projektų, kuriais pagrįstas šis reglamentas, 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 ([7]) 37 straipsnį, Vertybinių popierių ir rinkų suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1095/2010 ([8]) 37 straipsnį, ir Draudimo ir perdraudimo suinteresuotųjų subjektų grupės, įsteigtos pagal Europos Parlamento ir Tarybos reglamento (ES) Nr. 1094/2010 ([9]) 37 straipsnį;

(6) 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 2020 m. birželio 4 d.

Komisijos vardu
Pirmininkė
Ursula VON DER LEYEN

([7]) 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).

([8]) 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).

([9]) 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 pagal Direktyvą 2009/138/EB

Kredito kokybės žingsnis	0	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 Ltd.							
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
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**
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							
Ilgalaikių reitingų skalė	**AAA**	**AA**	**A**		**BBB**	**BB**	**B, C, SD, 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**
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							
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 Limited							
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 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 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		**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**		
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 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**		
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**
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**