

# AUTORIDAD BANCARIA EUROPEA

## DECISIÓN DE LA AUTORIDAD BANCARIA EUROPEA EBA DC 397

de 25 de junio de 2021

por la que se modifica la Decisión EBA DC 151 confirmando que las evaluaciones crediticias no solicitadas de ciertas ECAI no difieren en calidad de sus evaluaciones crediticias solicitadas

(2021/C 293/03)

LA JUNTA DE SUPERVISORES,

Visto el Reglamento (UE) n.º 1093/2010 del Parlamento Europeo y del Consejo de 24 de noviembre de 2010, por el que se crea una Autoridad Europea de Supervisión (Autoridad Bancaria Europea), se modifica la Decisión n.º 716/2009/CE y se deroga la Decisión 2009/78/CE de la Comisión<sup>(1)</sup>,

Visto el artículo 138 del Reglamento (UE) n.º 575/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo<sup>(2)</sup>,

Considerando lo siguiente:

- (1) El artículo 138 del Reglamento (UE) n.º 575/2013 permite la utilización de evaluaciones crediticias no solicitadas de una Agencia Externa de Calificación Crediticia («ECAI») para determinar las ponderaciones de riesgo que podrán asignarse a activos y a partidas fuera del balance a efectos de calcular los requisitos de fondos propios, sujeto a la confirmación por parte de la ABE de que las evaluaciones crediticias no solicitadas de esa ECAI no difieren en calidad de las evaluaciones crediticias solicitadas de esa misma ECAI. De conformidad con el mismo artículo, la ABE denegará o revocará esta confirmación, en particular si la ECAI ha utilizado una evaluación crediticia no solicitada para presionar a la entidad calificada con el fin de que requiera una evaluación crediticia u otros servicios. En consecuencia, la Decisión EBA DC 151 confirmando que las evaluaciones crediticias no solicitadas de ciertas ECAI no difieren en calidad de sus evaluaciones crediticias solicitadas<sup>(3)</sup> fue publicada el 22 de julio de 2016. Además, se modificó la Decisión EBA DC 151 para reflejar la evaluación referida en el artículo 138 del Reglamento (UE) n.º 575/2013 también con respecto a las ECAI registradas o certificadas y a la ECAI que empezó a emitir evaluaciones crediticias no solicitadas tras la publicación de dicha Decisión EBA DC 151; y para suprimir las referencias a una entidad que dejó de calificarse como una ECAI después de la adopción de la Decisión EBA DC 151. En consecuencia, la Decisión EBA DC 195 por la que se modificaba la decisión de la ABE confirmando que las evaluaciones crediticias no solicitadas de ciertas ECAI no difieren en calidad de sus evaluaciones crediticias solicitadas (195/C 266/05) fue publicada el 28 de julio de 2017<sup>(4)</sup>.
- (2) Tras la publicación de la Decisión EBA DC 195, se han registrado nuevas ECAI para las que también es necesario llevar a cabo la evaluación referida en el artículo 138 del Reglamento (UE) n.º 575/2013. Además, desde la publicación de la Decisión EBA DC 195, el registro como ACC de tres ECAI fue cancelado, puesto que ya no cumplen la definición de ECAI referida en el artículo 4, apartado 1, punto 98, del Reglamento (UE) n.º 575/2013. Como consecuencia de lo anterior, se debe llevar a cabo la evaluación referida en el artículo 138 del Reglamento (UE) n.º 575/2013, también con respecto a las ECAI recién registradas, y suprimir las referencias a las entidades que dejaron de calificarse como ECAI después de la adopción de la Decisión EBA DC 195.
- (3) Se ha informado a las ECAI afectadas de la intención de la ABE de adoptar la presente decisión y de darles la oportunidad de expresar sus opiniones al respecto.
- (4) Por consiguiente, la Decisión EBA DC 151 debe ser modificada,

<sup>(1)</sup> DO L 331 de 15.12.2010, p. 12.

<sup>(2)</sup> Reglamento (UE) n.º 575/2013 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 26 de junio de 2013, sobre los requisitos prudenciales de las entidades de crédito y las empresas de inversión, y por el que se modifica el Reglamento (UE) n.º 648/2012 (DO L 176 de 27.6.2013, p. 1).

<sup>(3)</sup> DO C 266 de 22.7.2016, p. 4.

<sup>(4)</sup> DO C 244 de 28.7.2017, p. 3.

HA DECIDIDO:

*Artículo 1*

El anexo de la Decisión EBA DC 151 se sustituye por el texto que figura en el anexo de la presente Decisión.

*Artículo 2*

Esta Decisión entrará en vigor a los veinte días de su publicación en el *Diario Oficial de la Unión Europea*.

Hecho en París, el 25 de junio de 2021.

*Por la Junta de Supervisores*

José Manuel CAMPA

*Presidente*

---

## ANEXO

**Agencias Externas de Calificación Crediticia (ECAI) cuyas evaluaciones crediticias no solicitadas ha confirmado la ABE que no difieren en calidad de sus evaluaciones crediticias solicitadas a efectos del artículo 138 del Reglamento (UE) n° 575/2013**

---

ARC Ratings S.A.

---

Axesor Risk Management S.L.

---

Banque de France

---

BCRA – Credit Rating Agency AD

---

Capital Intelligence Ratings Ltd

---

Cerved Rating Agency S.p.A.

---

Creditreform Rating AG

---

CRIF Ratings S.r.l.

---

DBRS Rating GmbH

---

Egan-Jones Ratings Co.

---

EuroRating Sp. z o.o.

---

Fitch Ratings Ireland Limited

---

GBB-Rating Gesellschaft fuer Bonitätsbeurteilung GmbH

---

HR Ratings de México, S.A. de C.V.

---

ICAP S.A.

---

INBONIS S.A.

---

Japan Credit Rating Agency Ltd

---

Kroll Bond Rating Agency Europe Limited

---

modeFinance S.r.l.

---

Moody's Investors Service

---

QIVALIO SAS (anteriormente Spread Research)

---

Rating-Agentur Expert RA GmbH

---

Scope Ratings GmbH

---

Scope Hamburg GmbH

---

S&P Global Ratings Europe Limited