

GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) Nr. 448/2012 VAN DE COMMISSIE

van 21 maart 2012

tot aanvulling van Verordening (EG) nr. 1060/2009 van het Europees Parlement en de Raad met betrekking tot technische reguleringsnormen voor de presentatie van de informatie die ratingbureaus ter beschikking moeten stellen in een centrale databank die door de Europese Autoriteit voor effecten en markten is opgezet

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EG) nr. 1060/2009 van het Europees Parlement en de Raad van 16 september 2009 inzake ratingbureaus⁽¹⁾, en met name artikel 21, lid 4, onder c),

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Artikel 11, lid 2, van Verordening (EG) nr. 1060/2009 schrijft voor dat ratingbureaus bepaalde informatie over historische prestatiegegevens ter beschikking moeten stellen in een centrale databank die door de Europese Autoriteit voor effecten en markten (European Securities and Markets Authority, hierna „de ESMA” genoemd) is opgezet. Deze informatie moet in een door de ESMA voorgeschreven gestandaardiseerde vorm worden verstrekt en moet voor het publiek beschikbaar worden gemaakt door de ESMA, die ook beknopte informatie over de belangrijkste waargenomen ontwikkelingen dient te publiceren. Deze vereisten moeten worden aangevuld met voorschriften betreffende de presentatie van de verstrekte informatie, waaronder rapportagestructuur, -formaat, -methodologie en -periode.
- (2) Ratingbureaus die van een in de Unie gevestigde groep van ratingbureaus deel uitmaken, mogen afzonderlijk aan de centrale databank rapporteren. Wegens de sterk geïntegreerde functionele organisatie van ratingbureaus op Unieniveau en om het inzicht in de statistieken te bevorderen, dienen ratingbureaus er echter toe te worden aangemoedigd op globale basis voor de groep als geheel aan de centrale databank te rapporteren.
- (3) De centrale databank verzamelt ratinggegevens en bewaart deze op centraal niveau. Om marktdeelnemers de betrouwbaarheid van ratings beter te helpen inschatten en hen aldus bij het nemen van beleggings- en investeringsbeslissingen bij te staan, dient de centrale databank op vrijwillige basis ook ratings te aanvaarden die zijn afgegeven door ratingbureaus van derde landen welke tot dezelfde groep van ratingbureaus behoren, maar die niet in de Unie zijn bekrachtigd.
- (4) Om het inzicht in de opgestelde statistieken verder te bevorderen, moeten bij de rapportage van ratinggegevens ook alle gegevens worden verstrekt die ten minste op de

laatste tien jaar vóór de inwerkingtreding van Verordening (EG) nr. 1060/2009 betrekking hebben. Een ratingbureau mag er niet toe worden verplicht deze gegevens te rapporteren indien het kan aantonen dat zulks niet evenredig zou zijn gezien de omvang en complexiteit van die gegevens.

- (5) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische reguleringsnormen die de ESMA volgens de procedure van artikel 10 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad⁽²⁾ ter bevestiging door de Commissie aan de Commissie heeft voorgelegd.
- (6) De ESMA heeft een openbare raadpleging gehouden over de ontwerpen van technische reguleringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd en de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten om advies verzocht. De ESMA heeft echter geen kosten-batenanalyse verricht omdat zij vond dat zulks niet in verhouding stond tot het effect van de ontwerpen van technische reguleringsnormen. Het Comité van Europese effectenregelgevers (CEER) is immers al sinds 2010 bezig met het opzetten van de centrale databank en de ontwerpen van technische normen weerspiegelen de werking van het bestaande systeem, zonder dat wezenlijke nieuwe verplichtingen worden opgelegd. Er werd dan ook niet verwacht dat de normen in aanzienlijke extra kosten voor de ESMA of de ratingbureaus zouden resulteren,

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

HOOFDSTUK I

ALGEMENE BEPALINGEN

Artikel 1

Onderwerp

In deze verordening worden de voorschriften vastgelegd betreffende de presentatie van de verstrekte informatie (waaronder rapportagestructuur, -formaat, -methodologie en -periode) die ratingbureaus in een centrale databank ter beschikking moeten stellen overeenkomstig:

- a) artikel 11, lid 2, van Verordening (EG) nr. 1060/2009;

⁽¹⁾ PB L 302 van 17.11.2009, blz. 1.

⁽²⁾ PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84.

- b) afdeling E, deel II, punt 1, van bijlage I bij Verordening (EG) nr. 1060/2009.

HOOFDSTUK II

RAPPORTAGESTRUCTUUR

Artikel 2

Rapportagebeginselen

1. Een ratingbureau verstrekt de volgende typen verslagen aan de centrale databank die door de ESMA is opgezet:
 - a) verslagen met kwalitatieve gegevens als omschreven in de artikelen 7 en 9, en
 - b) verslagen met ratinggegevens als omschreven in de artikelen 8 en 10.
2. Een ratingbureau is verantwoordelijk voor de juistheid, volledigheid en beschikbaarheid van zijn gerapporteerde gegevens. Het zorgt ervoor dat de verslagen tijdig, via de in artikel 11 beschreven rapportagekanalen en volgens de rapportageprocedure van artikel 13 worden verstrekt.
3. Indien een ratingbureau van een groep van ratingbureaus deel uitmaakt, kunnen de leden van de groep een van hen machtigen om de vereiste informatie namens de groep te rapporteren. Wanneer het gemachtigde groepslid informatie namens de groep rapporteert, identificeert het zichzelf en de groepsleden namens wie het de informatie rapporteert.

Artikel 3

Te rapporteren ratings

1. Een ratingbureau rapporteert voor elke rapportageperiode gegevens over een rating totdat deze rating wordt ingetrokken.
2. Een ratingbureau rapporteert zowel gevraagde als ongevroegde ratings. Het geeft aan of een rating gevraagd of ongevroegd is.
3. Een ratingbureau dat namens een groep van ratingbureaus rapporteert, mag ook gegevens rapporteren die afkomstig zijn van ratingbureaus van derde landen welke tot dezelfde groep behoren en die niet door middel van bekrachtiging in de Unie worden gebruikt. Indien een ratingbureau dergelijke gegevens niet rapporteert, legt het in zijn verslag met kwalitatieve gegevens uit waarom.
4. Een ratingbureau rapporteert ratinggegevens die tot ten minste tien jaar vóór de inwerkingtreding van Verordening (EG) nr. 1060/2009 teruggaan. Een ratingbureau dat vóór 7 december 1999 geen ratings heeft afgegeven, rapporteert gegevens voor de rapportageperioden die volgen op de eerste datum waarop het een rating heeft afgegeven. Een ratingbureau is

niet verplicht te rapporteren over rapportageperioden die van vóór zijn registratie of certificatie overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1060/2009 dateren indien het kan aantonen dat de rapportage van dergelijke gegevens onevenredig is in het licht van de omvang en complexiteit van die gegevens.

5. Een ratingbureau rapporteert de volgende ratingtypen:

- a) ratings van ondernemingen;
- b) ratings van gestructureerde financieringen;
- c) ratings van overheden en overheidsfinancieringen.

Artikel 4

Ratings van ondernemingen

1. Een ratingbureau rapporteert gegevens over ratings van ondernemingen op emittentbasis.
2. Een ratingbureau mag ratings van een dochteronderneming van een onderneming al dan niet als een individuele rating behandelen. Het ratingbureau geeft uitleg over de gekozen gedragslijn.
3. Bij de rapportage van ratings van ondernemingen classificeert een ratingbureau de ratings in een van de in veld 18 van tabel 1 van bijlage II gespecificeerde bedrijfstakken.
4. De gegevens over zowel kortetermijn- als langetermijnratings van ondernemingen worden gerapporteerd, voor zover deze beschikbaar zijn. Voor langetermijnratings wordt de rating van de emittent gerapporteerd. Als er geen rating van de emittent beschikbaar is, wordt de rating van de ongedekte schuld op lange termijn gerapporteerd. Als een rating voor een vreemde valuta en een rating voor de nationale valuta beschikbaar zijn, wordt alleen de rating voor de vreemde valuta gerapporteerd.

Artikel 5

Ratings van gestructureerde financieringen

1. Behoudens de in de leden 2 en 3 beschreven specifieke kenmerken, rapporteert een ratingbureau langetermijnratings van gestructureerde financieringsinstrumenten op emissiebasis.
2. Een ratingbureau rapporteert langetermijnratings van gestructureerde beleggingsvehikels en soortgelijke structuren op emittentbasis.
3. Een ratingbureau rapporteert kortetermijnratings van door activa gedekt commercial paper op emissiebasis.
4. Bij de rapportage van ratings van gestructureerde financieringen classificeert het ratingbureau de ratings in een van de volgende activaklassen:

- a) asset-backed securities: door activa gedekte effecten. Deze activaklasse omvat de volgende subactivaklassen: auto/boot/vliegtuigleningen, studieleningen, consumentenleningen, zorgleningen, leningen voor mobiele huizen, filmleningen, renovatieleningen, leases van uitrusting, creditcardvorderingen, zekerheidsrechten ten gunste van de belastingdienst, oninbare leningen, credit-linked notes, camperleningen en handelsvorderingen;
- b) residential mortgage-backed securities: door woninghypotheken gedekte effecten. Deze activaklasse omvat de volgende subactivaklassen: door eersterangshypotheken gedekte effecten, niet door eersterangshypotheken gedekte effecten en leningen op de overwaarde van woningen;
- c) commercial mortgage-backed securities: door bedrijfshypotheken gedekte effecten. Deze activaklasse omvat de volgende subactivaklassen: leningen voor detailhandelsruimten of kantoorruimten, ziekenhuisleningen, zorgtehuizen, opslagruimten, hotelleningen, verpleegfaciliteiten, industriële leningen en meergezinswoningen;
- d) collateralised debt obligations. Deze activaklasse omvat de volgende subactivaklassen: collateralised loan obligations, collateralised bond obligations, collateralised synthetic obligations, single-tranche collateralised debt obligations, collateralised fund obligations, collateralised debt obligations van door activa gedekte effecten en collateralised debt obligations van collateralised debt obligations;
- e) asset-backed commercial paper: door activa gedekt commercial paper;
- f) overige gestructureerde financieringsinstrumenten die niet onder de bovenvermelde activaklassen vallen, met inbegrip van gestructureerde gedekte obligaties, gestructureerde beleggingsvehikels, aan verzekeringen gekoppelde effecten en derivatenbedrijven.
5. Een ratingbureau specificeert tot welke activaklasse en subactivaklasse (indien van toepassing) elk beoordeeld instrument behoort.
6. Bij het invullen van veld 17 van tabel 1 van bijlage II is de voor een instrument gebruikte landencode de code van het land waar de meerderheid van de onderliggende activa zich bevindt. Wanneer het niet mogelijk is om uit te maken waar de meerderheid van de onderliggende activa zich bevindt, wordt het beoordeelde instrument als „internationaal” geclassificeerd.
- tingbureau classificeert de ratings in een van de volgende sectoren:
- a) overheidsratings in nationale valuta;
- b) overheidsratings in vreemde valuta;
- c) ratings van gemeenten en lagere overheden, zoals deelstaten en lokale overheden;
- d) ratings van supranationale organisaties, zoals instellingen die zijn opgericht door, eigendom zijn van en onder de zeggenschap staan van meer dan één soevereine regering die aandeelhouder is, met inbegrip van organisaties die volgens de statistische classificatie van economische activiteiten in de Europese Gemeenschappen (hierna „NACE” genoemd) ⁽¹⁾ onder de code „U” (activiteiten van extraterritoriale organisaties en lichamen) vallen;
- e) ratings van overheidsentiteiten, met inbegrip van die welke onder de NACE-codes „O” (openbaar bestuur en defensie; verplichte sociale verzekeringen), „P” (onderwijs) en „Q” (menselijke gezondheidszorg en maatschappelijke dienstverlening) vallen.
2. Binnen elke sector worden de kortetermijn- en de langetermijnratings van de emittenten gerapporteerd. Als er geen rating van een emittent beschikbaar is, wordt de rating van de schuld op lange termijn gerapporteerd.
3. Bij het invullen van veld 17 van tabel 1 van bijlage II wordt de beoordeelde emittent als „internationaal” geclassificeerd wanneer in het geval van supranationale organisaties als omschreven in lid 1, onder d), geen specifiek land als het land van emissie kan worden aangewezen.

HOOFDSTUK III

RAPPORTAGEFORMAAT

Artikel 7

Kwalitatieve gegevens

1. Een ratingbureau verstrekt verslagen met kwalitatieve gegevens in de in tabel 1 van bijlage I gespecificeerde vorm. Een ratingbureau verstrekt met name kwalitatieve gegevens over zijn ratingschaal, waarbij de individuele kenmerken en de betekenis van elke rating worden toegelicht. Een ratingbureau mag ten hoogste zes ratingschalen rapporteren. Voor elke specifieke combinatie van tijdshorizon en ratingtype mag niet meer dan één ratingschaal worden gerapporteerd.

Artikel 6

Ratings van overheden en overheidsfinancieringen

1. Een ratingbureau rapporteert gegevens over ratings van overheden en overheidsfinancieringen op emittentbasis. Het ra-

⁽¹⁾ Verordening (EG) nr. 1893/2006 van het Europees Parlement en de Raad van 20 december 2006 tot vaststelling van de statistische classificatie van economische activiteiten NACE Rev. 2 en tot wijziging van Verordening (EEG) nr. 3037/90 en enkele EG-verordeningen op specifieke statistische gebieden, PB L 393 van 30.12.2006, blz. 1.

2. Wanneer een ratingbureau ratings voor een specifieke combinatie van tijdshorizon en ratingtype afgeeft en daarbij meer dan één ratingschaal gebruikt, rapporteert het in zijn verslagen met kwalitatieve gegevens alleen de ratingschaal die voor de numerieke meerderheid van dergelijke ratings wordt gebruikt. In verslagen met ratinggegevens worden geen ratings gerapporteerd waarvoor wordt gebruikgemaakt van een ratingschaal die op grond van dit lid niet is gerapporteerd.

3. Een ratingschaal bevat een onbepaald aantal brede ratingcategorieën die een onbepaald aantal gradaties als subcategorieën kunnen omvatten. Een ratingbureau rapporteert over zowel de ratingcategorieën als de eventuele gradaties.

Artikel 8

Ratinggegevens

1. Een ratingbureau verstrekt verslagen met gegevens over in artikel 3 bedoelde ratings in de in tabel 1 van bijlage II gespecificeerde vorm.

2. Bij het invullen van veld 12 van tabel 1 van bijlage II rapporteert een ratingbureau een wanbetaling met betrekking tot een rating indien zich één van de volgende gebeurtenissen heeft voorgedaan:

- a) de rating geeft aan dat er zich volgens de door het ratingbureau gehanteerde definitie van wanbetaling een wanbetaling heeft voorgedaan;
- b) de rating is ingetrokken wegens insolventie van de beoordeelde entiteit of wegens een schuldherschikking;
- c) alle andere gevallen waarin het ratingbureau van oordeel is dat er voor een beoordeelde entiteit of een beoordeeld instrument van wanbetaling, een ernstige verslechtering of een gelijkwaardige situatie sprake is.

3. Voor alle gerapporteerde ratings die tijdens een specifieke rapportageperiode zijn ingetrokken, wordt in veld 11 van tabel 1 van bijlage II een reden voor de intrekking ervan aangegeven. Ratings die vóór 7 september 2010 zijn ingetrokken, mogen in de categorie „einde van de rating om andere redenen” worden ingedeeld.

Artikel 9

Wijzigingen in en annuleringen van kwalitatieve gegevens

1. Een ratingbureau rapporteert wijzigingen in en annuleringen van gerapporteerde kwalitatieve gegevens wanneer zulks noodzakelijk is om:

- a) wijzigingen in kwalitatieve gegevens aan te geven;
- b) feitelijke fouten in de rapportage van een ratingschaal te corrigeren.

2. Om wijzigingen in kwalitatieve gegevens, met uitzondering van gegevens over de ratingschaal, aan te brengen, zendt

het ratingbureau een nieuw verslag met de bijgewerkte gegevens. Een ratingbureau zendt alleen een nieuw verslag met kwalitatieve gegevens indien er van een wijziging in bepaalde gegevens sprake is en alleen de gewijzigde gegevens worden gerapporteerd. In geval van een wijziging in de methodologie rapporteert een ratingbureau de bijgewerkte kwalitatieve gegevens en kan het verwijzen naar op zijn website verstrekte aanvullende informatie over historische methodologische wijzigingen.

3. Ingeval er zich een wijziging in een ratingschaal voordoet die beperkt blijft tot de aanduidingen van de categorieën of gradaties, zendt een ratingbureau een verslag met kwalitatieve gegevens dat een bijgewerkte versie van de vorige ratingschaal (geïdentificeerd aan de hand van de unieke identificatiecode ervan) bevat waarin, al naargelang het geval, de aanduidingen of beschrijvingen zijn gewijzigd. De overige velden die op de ratingschaal betrekking hebben, worden ongewijzigd in het verslag overgenomen. Een ratingbureau maakt gebruik van de in tabel 1 van bijlage I gespecificeerde velden.

4. Ingeval er zich een wezenlijke wijziging in een ratingschaal voordoet, meldt het ratingbureau een nieuwe ratingschaal en onderneemt het de volgende stappen:

- a) er wordt een kwalitatief bestand met een bijgesteld record van de vorige ratingschaal gezonden, waarbij de einddatum van de geldigheid ervan wordt gewijzigd in de einddatum van de vorige rapportageperiode. Het ratingbureau maakt gebruik van de in tabel 1 van bijlage I gespecificeerde velden;
- b) het ratingbureau rapporteert de nieuwe ratingschaal met een nieuwe unieke identificatiecode en met de datum van de eerste rapportageperiode waarin de nieuwe ratingschaal geldig is als aanvangsdatum van de geldigheid ervan;
- c) pas nadat het ratingbureau het feedbackbestand van de centrale databank heeft ontvangen waarin wordt bevestigd dat de nieuwe ratingschaal is aanvaard, zendt het de bestanden met ratinggegevens van de eerste rapportageperiode waarop de nieuwe ratingschaal van toepassing is en waarin de nieuwe ratingschaal wordt gebruikt.

5. Ingeval een ratingschaal wordt geannuleerd, onderneemt een ratingbureau de volgende stappen:

- a) de annulering vindt plaats voordat het ratingbureau ratinggegevens met betrekking tot de ratingschaal in kwestie aan de centrale databank rapporteert. Ingeval er reeds ratinggegevens zijn gerapporteerd, annuleert het ratingbureau alle ratinggegevens waarbij van de vorige ratingschaal werd gebruikgemaakt;
- b) het ratingbureau zendt het bestand met kwalitatieve gegevens met de annulering van de ratingschaal. Het ratingbureau maakt gebruik van het in tabel 2 van bijlage I gespecificeerde veld.

*Artikel 10***Annulering van ratinggegevens en historische rapportage van ratinggegevens**

1. Ingeval er feitelijke fouten in de gerapporteerde ratinggegevens worden aangetroffen, rapporteert een ratingbureau de annulering van de ratinggegevens in kwestie en vervangt het de geannuleerde ratinggegevens.
2. Bij de annulering van ratinggegevens neemt een ratingbureau een van de volgende maatregelen:
 - a) ingeval het een ratingrecord van de lopende rapportageperiode betreft, maakt een ratingbureau gebruik van de in tabel 2 van bijlage II gespecificeerde velden. Zodra het oorspronkelijke record is geannuleerd, zendt het een nieuwe versie van het record;
 - b) ingeval het een ratingrecord uit vorige rapportageperiodes betreft, mag een ratingbureau de oorspronkelijke ratinggegevens voor alle rapportageperiodes annuleren met gebruikmaking van het in tabel 2 van bijlage II gespecificeerde veld onder vermelding van de reden van de annulering, en vervolgens de oorspronkelijke versie van het record in alle periodes vervangen volgens de in artikel 3, lid 4, beschreven procedure.
3. Bij retroactieve rapportage van ratinggegevens vult een ratingbureau de ratingvelden aan met de historische rapportageperiode van de rating en de reden voor de rapportage van historische ratinggegevens, zoals gespecificeerd in de velden 24 en 25 van tabel 1 van bijlage II.

HOOFDSTUK IV

RAPPORTAGEMETHODE*Artikel 11***Rapportagekanalen en doorgifte van gegevens**

1. Bij de rapportage van gegevens aan de centrale databank maakt een ratingbureau gebruik van de rapportagefaciliteiten van het systeem van de centrale databank.
2. Alle bestanden die naar de centrale databank worden gezonden en van de centrale databank worden ontvangen, hebben een XML-formaat dat strookt met de XSD-schema's van de ESMA.
3. Een ratingbureau benoemt de bestanden volgens de naamgevingsconventie van de ESMA.
4. Een ratingbureau houdt de bestanden die naar de centrale databank zijn gezonden en van de centrale databank zijn ontvangen ten minste vijf jaar bij. Zij worden op verzoek aan de ESMA ter beschikking gesteld.

*Artikel 12***Beginselen voor de uitwisseling van bestanden en rapportageperiodes**

1. Een ratingbureau zendt alle bestanden die op een specifieke rapportageperiode betrekking hebben binnen de daar-

opvolgende prepublicatieperiode naar de centrale databank. Dit vereiste geldt zowel voor bestanden met kwalitatieve gegevens als voor bestanden met ratinggegevens.

2. De rapportageperiode bestrijkt zes maanden en loopt van 1 januari tot en met 30 juni of van 1 juli tot en met 31 december. De prepublicatieperiode is een periode van drie maanden na het einde van de desbetreffende rapportageperiode en loopt van 1 januari tot en met 31 maart en van 1 juli tot en met 30 september. Zowel het begin als het einde van een prepublicatieperiode en een rapportageperiode wordt bepaald op basis van de Midden-Europese tijd.
3. Een ratingbureau geeft eerst de kwalitatieve gegevens door. Het zendt de bestanden met ratinggegevens pas nadat het van de centrale databank een feedbackbestand heeft ontvangen waarin de kwalitatieve gegevens zijn geverifieerd.
4. Tijdens de prepublicatieperiode verstrekt een ratingbureau aan de centrale databank bestanden met ratinggegevens welke alle informatie bevatten die in de tabellen 1, 2 en 3 van bijlage II is gespecificeerd. Annuleringen van ratinggegevens worden gerapporteerd overeenkomstig artikel 10.

5. Wanneer een ratingbureau voor het eerst aan de centrale databank rapporteert, zendt het een bestand met kwalitatieve gegevens dat alle in de tabellen 1, 2 en 3 van bijlage I gespecificeerde kwalitatieve gegevens bevat. Daarna rapporteert het ratingbureau alleen nieuwe ratingschalen en bijwerkingen en annuleringen van kwalitatieve gegevens overeenkomstig artikel 9.

6. Naast het eerste verslag aan de centrale databank rapporteert een ratingbureau ook de historische gegevens overeenkomstig artikel 3, lid 4. De rapportage vindt plaats in chronologische volgorde van de rapportageperiodes, beginnend bij de eerste.

*Artikel 13***Rapportageprocedure**

1. Een ratingbureau zorgt ervoor dat de informatie die aan de centrale databank wordt toegezonden, strookt met zijn interne gegevens. Binnen elke prepublicatieperiode worden alle relevante bestanden in chronologische volgorde toegezonden en alle fouten gecorrigeerd.
2. De centrale databank zendt het ratingbureau een feedbackbestand voor elk gerapporteerd gegevensbestand. In het feedbackbestand wordt ofwel bevestigd dat het gegevensbestand is ontvangen en correct is geladen, ofwel aan het ratingbureau medegedeeld welke fouten erin zijn gedetecteerd. Ingeval de centrale databank fouten heeft gedetecteerd, zendt het ratingbureau tijdig op de volgende wijze de correcties:

- a) bij bestandsfouten corrigeert het ratingbureau de fout zoals in het feedbackbestand is aangegeven en zendt het het gehele bestand opnieuw;

- b) bij inhoudelijke fouten corrigeert het ratingbureau de fout zoals in het feedbackbestand is aangegeven en zendt het alleen de gecorrigeerde records opnieuw.

HOOFDSTUK V

SLOTBEPALINGEN

Artikel 14

Inwerkingtreding

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 21 maart 2012.

Voor de Commissie
De voorzitter
José Manuel BARROSO

BIJLAGE I

Lijst van velden voor een bestand met kwalitatieve gegevens

Tabel 1: Lijst van administratieve velden voor de eerste rapportage en voor de bijwerking van een bestand met kwalitatieve gegevens

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
1	CRA Name	Naam die wordt gebruikt om het ratingbureau in de webinterface van de CEREP te identificeren. Deze naam stemt overeen met de naam die het ratingbureau gebruikt tijdens het registratieproces en alle andere toezichtprocedures binnen de ESMA. Ingeval een lid van een groep van ratingbureaus namens de gehele groep rapporteert, is het de naam die naar de groep van ratingbureaus verwijst.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen.	—
2	CRA Description	Beknopte beschrijving van het ratingbureau.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen.	—
3	CRA Methodology	Beschrijving van de ratingmethodologie van het ratingbureau. Het ratingbureau heeft de mogelijkheid de unieke kenmerken van zijn ratingmethodologie te beschrijven.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen.	—
4	Solicited and unsolicited ratings policies	Beschrijving van de gedragslijnen van het ratingbureau ten aanzien van gevraagde en ongevraagde ratings. Indien er meer dan een gedragslijn bestaat, wordt gespecificeerd voor welke ratingtypen elke gedragslijn geldt.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen.	—
5	Subsidiary ratings policy	Beschrijving van de gevolgde gedragslijn ten aanzien van de rapportage van de rating van dochterondernemingen.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen. Alleen toepasselijk voor ratingbureaus die ratings van ondernemingen afgeven.	—
6	Geographical reporting scope	Vermelding of er van mondiale reikwijdte sprake is. Als er niet van mondiale reikwijdte sprake is, legt het ratingbureau uit waarom dat niet het geval is.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen.	Er dient van een XML-tagselectie „Global/Non global” te worden gebruikgemaakt om aan te geven of er al dan niet van mondiale reikwijdte sprake is. Ingeval niet-mondiale reikwijdte wordt geselecteerd, is het verplicht in een subveld de reden daarvoor uit te leggen.
7	Definition of default	Beschrijft de door het ratingbureau gehanteerde definitie van wanbetaling.	Verplicht bij eerste rapportage of in geval van wijzigingen.	—
8	Rating scale identifier	Unieke identificatiecode van een specifieke ratingschaal van het ratingbureau.	Verplicht indien een ratingschaal moet worden gerapporteerd of bijgewerkt.	—

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
9	Rating scale validity start date	De datum vanaf wanneer de ratingschaal geldig is (BOP). Deze datum stemt overeen met een geldige begindatum van een rapportageperiode in het systeem. De datum overlapt niet met een reeds gerapporteerde ratingschaal met dezelfde reikwijdte.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	Datumformaat volgens ISO 8601 (jjjj-mm-dd).
10	Rating scale validity end date	De laatste datum waarop een ratingschaal geldig is (EOP). Deze datum stemt overeen met een geldige einddatum van een rapportageperiode in het systeem. Indien er geen specifieke einddatum bekend is of deze datum in de toekomst ligt, wordt deze vermeld als 9999-01-01. De datum overlapt niet met een reeds gerapporteerde ratingschaal met dezelfde reikwijdte.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	Datumformaat volgens ISO 8601 (jjjj-mm-dd).
11	Time horizon	Geeft de toepasselijkheid van de ratingschaal aan op basis van de tijdshorizon. De combinatie „Rating type” en „Time horizon” is geldig.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	— „L” indien de ratingschaal op langetermijnratings van toepassing is; — „S” indien de ratingschaal op kortetermijnratings van toepassing is;
12	Rating type	Geeft de toepasselijkheid van de ratingschaal aan op basis van het ratingtype. De combinatie „Rating type” en „Time horizon” is geldig.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	— „C” indien de ratingschaal op ratings van ondernemingen van toepassing is; — „S” indien de ratingschaal op ratings van overheden en overheidsfinancieringen van toepassing is; — „T” indien de ratingschaal op ratings van gestructureerde financieringen van toepassing is.
13	Rating category label	Identificeert een specifieke ratingcategorie binnen de ratingschaal.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	—
14	Rating category description	Definitie van de ratingcategorie in de ratingschaal.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	—
15	Rating category value	Rangorde van de ratingcategorie in de ratingschaal, waarbij gradaties als subcategorieën worden beschouwd.	Verplicht indien een „rating scale identifier” wordt gerapporteerd.	Het volgnummer is een geheel getal met als minimumwaarde 1 en als maximumwaarde 20. De ratingcategorieën moeten op volgorde worden vermeld. Voor elke rating moet er ten minste één ratingcategorie bestaan.
16	Notch label	Identificeert een specifieke gradatie binnen de ratingschaal. Gradaties zorgen voor een grotere mate van detail in de ratingcategorie.	Verplicht indien een gradatie in een ratingschaal wordt gerapporteerd.	—

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
17	Notch description	Definitie van de gradatie in de ratingschaal.	Verplicht indien een gradatie in een ratingschaal wordt gerapporteerd.	—
18	Notch value	Rangorde van de gradatie in de ratingschaal. De gradatiewaarde is de waarde die aan elke rating is toegewezen om de rating aan het begin en aan het einde van elke periode te identificeren.	Verplicht indien een gradatie in een ratingschaal wordt gerapporteerd.	De gradatiewaarde is een geheel getal met als minimumwaarde 1 en als maximumwaarde 99. De waarden moeten op volgorde worden verstrekt. Elke specifieke ratingcategorie kan een onbepaald aantal gradaties hebben.

Tabel 2: Veld voor de annulering van ratingschalen

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
1	Rating scale identifier	De identificatiecode van de te annuleren ratingschaal.	Verplicht	—

Tabel 3: Lijst van technische velden voor een bestand met kwalitatieve gegevens

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
1	Language	Geeft de taal van het bestand aan.	Verplicht.	ISO 639-1.
2	CRA unique identifier	Intern door het systeem gehanteerde code om het ratingbureau te identificeren. Moet de Business Identifier Code (BIC) zijn van het ratingbureau dat het bestand zendt.	Verplicht.	ISO 9362.
3	Version	De versie van de gebruikte XML-schemadefinitie (XSD) om het bestand te genereren.	Verplicht.	Moet het exacte versienummer zijn.
4	Creation date	De datum waarop het bestand is aangemaakt.	Verplicht.	Datumformaat volgens ISO 8601 (jjjj-mm-dd).
5	Creation time	Het tijdstip waarop het bestand is aangemaakt. Dit wordt gerapporteerd in de plaatselijke tijd van het ratingbureau dat het bestand genereert en uitgedrukt in gecoördineerde universele tijd (UTC) +/- aantal uren.	Verplicht.	Tijdformaat volgens ISO 8601 (hh:mm:ss).
6	Creation time offset	Geeft aan dat er bij het aanmaken van het bestand sprake is van een plaatselijk tijdsverschil van hh vóór of na UTC. Apart subveld met waarden (+/-) hh, dat voor de zomertijd wordt aangepast.	Verplicht.	—

BIJLAGE II

Lijst van velden voor een bestand met ratinggegevens

Tabel 1: Lijst van administratieve velden voor een bestand met ratinggegevens

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
1	Rating identifier	Unieke identificatiecode van de rating, die ongewijzigd blijft in de tijd.	Verplicht.	—
2	Rating name	Naam of beschrijving van de rating. Identificeert de rating, het beoordeelde instrument of de beoordeelde emit-tent.	Facultatief.	—
3	Internal instrument identifier	Unieke code voor de identificatie van het beoordeelde financiële instrument. Blijft ongewijzigd in de tijd.	Verplicht. Alleen toepasselijk voor ratings van ge-structureerde finan-cieringen (niet van gestructureerde be-leggingsvehikels).	—
4	Standard instrument identifier	International Securities Identifying Number (ISIN) van het beoordeelde instrument. Blijft ongewijzigd in de tijd.	Facultatief. Alleen toepasselijk voor ratings van ge-structureerde finan-cieringen (niet van gestructureerde be-leggingsvehikels).	ISO-code 6166.
5	Internal issuer identifier	Unieke identificatiecode van de emit-tent (of de moederonderneming van de emittent). Blijft ongewijzigd in de tijd.	Verplicht. Alleen toepasselijk voor ratings van on-dernemingen, over-heden en overheids-financieringen en gestructureerde be-leggingsvehikels.	—
6	Standard issuer identifier	Unieke Business Identifier Code (BIC) van de emittent. Blijft ongewijzigd in de tijd.	Facultatief. Alleen toepasselijk voor ratings van on-dernemingen, over-heden en overheids-financieringen en gestructureerde be-leggingsvehikels.	ISO-code 9362.
7	Rating BOP	Gradatiewaarde aan het begin van de rapportageperiode. Identiek aan de EOPrating van de vorige periode, behalve in geval van wijzigingen in de ratingschaal.	Verplicht. Alleen toepasselijk voor ratings die aan het begin van de rapportageperiode bestonden.	—
8	Rating EOP	Gradatiewaarde aan het einde van de rapportageperiode.	Verplicht. Alleen toepasselijk voor ratings die aan het einde van de rapportageperiode bestonden.	—
9	New rating	Geeft aan dat de rating tijdens de rap-portageperiode voor het eerst is ge-geneerd.	Verplicht.	—
10	Withdra-wal	Geeft aan dat de rating tijdens de rap-portageperiode is ingetrokken. Zodra een rating is ingetrokken, wordt deze specifieke rating in de volgende rap-portageperiodes niet meer gerappor-teerd.	Verplicht indien de rating tijdens de rapportageperiode is ingetrokken.	—

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
11	Withdrawal reason	Reden waarom het veld „withdrawal” is ingevuld.	Verplicht indien het veld „withdrawal” is ingevuld.	<ul style="list-style-type: none"> — „1” in geval van incorrecte of onvoldoende informatie over de emittent/emissie; — „2” in geval van faillissement van de beoordeelde entiteit of schuldherschikking; — „3” in geval van reorganisatie van de beoordeelde entiteit, met inbegrip van de fusie of overname van de beoordeelde entiteit; — „4” in geval van het einde van de looptijd van de schuldverplichting; — „5” in geval van automatische ongeldigheid van de rating wegens het bedrijfsmodel van een ratingbureau; — „6” in geval van het einde van de rating om andere redenen.
12	Default	Geeft aan of er voor de beoordeelde emittent of het beoordeelde instrument van wanbetaling sprake is, zoals in artikel 9, lid 2, is gespecificeerd.	Verplicht.	—
13	Solicited/Unsolicited	Een rating wordt als ongevraagd beschouwd indien de rating niet op verzoek van de emittent of de beoordeelde entiteit is geïnitieerd. Een rating wordt als gevraagd beschouwd indien de rating door de emittent, de beoordeelde entiteit of de agent ervan is geïnitieerd.	Verplicht.	<ul style="list-style-type: none"> — „S” in geval van een gevraagde rating; — „U” in geval van een ongevraagde rating; — „N” ingeval deze informatie niet beschikbaar is voor rapportageperiodes van vóór 7 september 2010.
14	Location of the issuance of the rating	Geeft aan door wie de rating is afgegeven.	Verplicht.	<ul style="list-style-type: none"> — „I” wanneer de rating in de EU is afgegeven door een ratingbureau dat overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1060/2009 is geregistreerd; — „E” wanneer de rating overeenkomstig artikel 4, lid 3, van Verordening (EG) nr. 1060/2009 is bekrachtigd; — „T” wanneer de rating overeenkomstig artikel 5, lid 2, van Verordening (EG) nr. 1060/2009, als gewijzigd, door een gecertificeerd ratingbureau is afgegeven; — „N” ingeval deze informatie niet beschikbaar is voor rapportageperiodes van vóór 7 september 2010. — „O” in ieder ander geval.
15	Time horizon	Geeft aan of het een kortetermijn- of een langetermijnrating betreft. Blijft ongewijzigd in de tijd.	Verplicht.	— „S” als het een kortetermijnrating betreft;

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
				— „L” als het een langetermijnrating betreft.
16	Rating type	Geeft aan of de rating een rating van een onderneming, een rating van een overheid en een overheidsfinanciering of een rating van een gestructureerde financiering is. Blijft ongewijzigd in de tijd.	Verplicht.	— „C” voor een rating van een onderneming; — „S” voor een rating van een overheid en een overheidsfinanciering; — „T” voor een rating van een gestructureerde financiering.
17	Country	Landencode van de beoordeelde emitent/het beoordeelde instrument.	Verplicht.	ISO 3166-1. Om de categorie „internationaal” te identificeren, wordt de code „ZZ” gebruikt.
18	Industry	Bedrijfstak van de emittent.	Verplicht. Toepasselijk voor ratings van ondernemingen.	— „FI” ingeval het een financiële instelling, met inbegrip van kredietinstellingen en beleggingsondernemingen, betreft; — „IN” ingeval het een verzekeringsonderneming betreft; — „CO” ingeval het een particuliere emittent betreft die niet als een financiële instelling of een verzekeringsonderneming wordt beschouwd.
19	Sector	Specificeert subcategorieën voor ratings van overheden en overheidsfinancieringen.	Verplicht. Toepasselijk voor ratings van overheden en overheidsfinancieringen.	— „FC” voor een overheidsrating in vreemde valuta; — „SL” voor een overheidsrating in nationale valuta; — „SM” voor een rating voor gemeenten of lagere overheden; — „SO” voor een rating van een supranationale organisatie; — „PE” voor een rating van een overheidsentiteit.
20	Asset class	Definieert de belangrijkste activaklassen voor ratings van gestructureerde financieringen.	Verplicht. Toepasselijk voor ratings van gestructureerde financieringen.	— „ABS” voor een door activa gedekt effect; — „RMBS” voor een door woninghypotheken gedekt effect; — „CMBS” voor een door bedrijfshypotheken gedekt effect; — „CDO” voor een collateralised debt obligation; — „ABCP” voor door activa gedekt commercial paper; — „OTH” in alle andere gevallen.

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
21	Sub-asset	Definieert de subactivaklassen voor ABS-, RMBS- en CDO-ratings.	Verplicht. Toepasselijk voor de gedefinieerde activa-klassen voor ratings van gestructureerde financieringen.	<p>Voor ABS:</p> <ul style="list-style-type: none"> — „CCS” voor een door creditcard-vorderingen gedekt effect; — „ALB” voor een door autoleningen gedekt effect; — „OTH” voor een ander ABS-type. <p>Voor RMBS:</p> <ul style="list-style-type: none"> — „HEL” voor een lening op de over-waarde van een woning; — „PRR” voor een eersterangs RMBS; — „NPR” voor een nieteersterangs RMBS. <p>Voor CDO:</p> <ul style="list-style-type: none"> — „CFH” voor een kasstroom of hybride CDO/CLO; — „SDO” voor een synthetische CDO/CLO; — „MVO” voor een CDO tegen marktwaarde.
22	Vintage year	Specificeert het emissiejaar van het beoordeelde instrument. Blijft ongewijzigd in de tijd.	Verplicht. Toepasselijk voor ratings van gestructureerde financieringen.	—
23	Responsible CRA unique identifier	<p>Business Identifier Code (BIC) van de voor de rating verantwoordelijke entiteit, d.i. in geval van:</p> <ul style="list-style-type: none"> — een in de EU afgegeven rating, het ratingbureau dat de rating heeft afgegeven en overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1060/2009 is geregistreerd; — een bekrachtigde rating, het ratingbureau dat de rating heeft bekrachtigd en overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1060/2009 is geregistreerd; — een rating die is afgegeven door een ratingbureau dat overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1060/2009 is gecertificeerd, de gecertificeerde entiteit; — een rating die in een derde land is afgegeven maar niet is bekrachtigd door een ratingbureau dat overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1060/2009 is geregistreerd, het ratingbureau van het derde land dat de rating heeft afgegeven. 	Verplicht.	ISO 9362.
24	Historical reporting period of the rating	Identificeert de rapportageperiode van de rating, indien in het verleden. Wordt gebruikt indien de rating voor een gepubliceerde periode wordt gerapporteerd voor de correctie van feitelijke fouten.	Facultatief.	Datumformaat volgens ISO 8601 (jjjj-mm-dd).

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
25	Reason for historical rating reporting	De reden waarom de rating voor een eerder gerapporteerde periode wordt gerapporteerd.	Verplicht indien het veld „Historic reporting period of the rating” is ingevuld.	—

Tabel 2: Lijst van velden voor de annulering van ratinggegevens

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
1	Rating identifier	Mededeling van een bestaande ratingcode die moet worden geannuleerd.	Verplicht.	—
2	Reason for Historic Cancellation	De reden waarom de rating voor alle eerder gerapporteerde perioden wordt geannuleerd.	Facultatief. Verplicht in geval van volledige annulering (annulering van de rating voor alle perioden).	—

Tabel 3: Lijst van technische velden voor een bestand met ratinggegevens

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
1	Language	Geeft de taal van het bestand aan.	Verplicht	ISO 639-1
2	CRA unique identifier	Intern door het systeem gehanteerde code om het ratingbureau te identificeren. Moet de Business Identifier Code (BIC) zijn van het ratingbureau dat het bestand zendt.	Verplicht	ISO 9362
3	Version	De versie van de gebruikte XML-schemadefinitie (XSD) om het bestand te genereren.	Verplicht	Moet het exacte versienummer zijn.
4	Creation date	De datum waarop het bestand is aangemaakt.	Verplicht	Datumformaat volgens ISO 8601 (jjjj-mm-dd).
5	Creation time	Het tijdstip waarop het bestand is aangemaakt. Dit wordt gerapporteerd in de plaatselijke tijd van het ratingbureau dat het bestand genereert en uitgedrukt in gecoördineerde universele tijd (UTC) +/- aantal uren.	Verplicht	Tijdformaat volgens ISO 8601 (hh:mm:ss).
6	Creation time offset	Geeft aan dat er bij het aanmaken van het bestand sprake is van een plaatselijk tijdsverschil van hh vóór of na UTC. Apart subveld met waarden (+/-) hh dat voor de zomertijd wordt aangepast.	Verplicht	—

Nr.	Veldnaam	Beschrijving	Type	Norm
7	Reporting period	Geeft de rapportageperiode van het bestand aan. Stemt overeen met de begindatum van de periode.	Verplicht	Datumformaat volgens ISO 8601 (jjjj-mm-dd) van de BOP.
8	Number of records	Totaal aantal ratingrecords in het bestand, met inbegrip van gemelde en ingetrokken ratings.	Verplicht	—