

BUNDESGESETZBLATT

FÜR DIE REPUBLIK ÖSTERREICH

Jahrgang 2013

Ausgegeben am 28. November 2013

Teil II

382. Verordnung: CRR-Mappingverordnung – CRR-MappingV

382. Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Zuordnung von Ratings anerkannter Rating-Agenturen zu Bonitätsstufen (CRR-Mappingverordnung – CRR-MappingV)

Auf Grund des § 103q Z 5 des Bankwesengesetzes – BWG, BGBl. Nr. 532/1993, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. I Nr. 184/2013, wird verordnet:

Zuordnung von Ratings zu Bonitätsstufen

§ 1. Die Zuordnung der von anerkannten Rating-Agenturen vergebenen und gemäß Art. 4 und 5 der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 über Rating-Agenturen, ABl. Nr. L 302 vom 17.11.2009 S. 1, verwendbaren Ratings zu Bonitätsstufen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 109 und 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 646/2012, ABl. L 176 vom 27.06.2013 S. 1, ist anhand der Tabellen in §§ 2 bis 5 vorzunehmen.

Fitch Ratings

§ 2. Die von Fitch Ratings vergebenen Ratings sind den Bonitätsstufen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 109 und 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 wie folgt zuzuordnen:

1. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	AAA bis AA-	A+ bis A-	BBB+ bis BBB-	BB+ bis BB-	B+ bis B-	CCC+ und niedriger

2. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	F1+ bis F1	F2	F3	Niedriger als F3	---	---

3. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	F1+ bis F1	F2	F3	Niedriger als F3

4. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5 und darunter
Rating	AAA bis AA-	A+ bis A-	BBB+ bis BBB-	BB+ bis BB-	B+ und niedriger

5. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	Unter 11
---------------	---	---	---	---	---	---	---	---	---	----	----	----------

Rating	AAA	AA	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	BB+	BB	BB-	Niedriger als BB-
--------	-----	----	----	---	----	------	-----	------	-----	----	-----	-------------------

6. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz)

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	F1+ bis F1	F2	F3	Niedriger als F3

7. Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	AAA bis AA-	A+ bis A-	BBB+ bis BBB-	BB+ bis BB-	B+ bis B-	CCC+ und niedriger

Moody's Investors Service Ltd

§ 3. Die von Moody's Investors Service Ltd. vergebenen Ratings sind den Bonitätsstufen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 109 und 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 wie folgt zuzuordnen:

1. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	Aaa bis Aa3	A1 bis A3	Baa1 bis Baa3	Ba1 bis Ba3	B1 bis B3	Caa1 und niedriger

2. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	P-1	P-2	P-3	NP	---	---

3. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	P-1	P-2	P-3	NP

4. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5 und darunter
Rating	Aaa bis Aa3	A1 bis A3	Baa1 bis Baa3	Ba1 bis Ba3	B1 und niedriger

5. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	Unter 11
Rating	Aaa	Aa	A1	A2	A3	Baa1	Baa2	Baa3	Ba1	Ba2	Ba3	Niedriger als Ba3

6. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	P-1	P-2	P-3	Alle kurzfristigen Ratings, die niedriger sind als

				A3, P3 und F3
--	--	--	--	---------------

7. Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	Aaa bis Aa3	A1 bis A3	Baa1 bis Baa3	Ba1 bis Ba3	B1 bis B3	Caa1 und niedriger

Standard & Poor's

§ 4. Die von Standard & Poor's vergebenen Ratings sind den Bonitätsstufen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 109 und 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 wie folgt zuzuordnen:

1. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	AAA bis AA-	A+ bis A-	BBB+ bis BBB-	BB+ bis BB-	B+ bis B-	CCC+ und niedriger

2. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	A-1+, A-1	A-2	A-3	Alle kurzfristigen Ratings, die niedriger als A-3 sind	---	---

3. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	A-1+, A-1	A-2	A-3	Alle kurzfristigen Ratings, die niedriger sind als A-3

4. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5 und darunter
Rating	AAA bis AA-	A+ bis A-	BBB+ bis BBB-	BB+ bis BB-	B+ und niedriger

5. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	Unter 11
Rating	AAA	AA	A+	A	A-	BBB+	BBB	BBB-	BB+	BB	BB-	Niedriger als BB-

6. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	A-1+, A-1	A-2	A-3	Alle kurzfristigen Ratings, die niedriger sind als A-3

7. Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. o der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 BWG:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
S&P Principal Stability Fund	AAA m bis AA-m	A+m bis A-m	BBB+m bis BBB-m	BB+m bis BB-m	B+m bis B-m	CCC+m und niedriger
S&P Fund Credit Quality	AAA f bis AA-f	A+f bis A-f	BBB+f bis BBB-f	BB+f bis BB-f	B+f bis B-f	CCC+f und niedriger

Dominion Bond Ratings Services

§ 5. Die von Dominion Bond Ratings Services vergebenen Ratings sind den Bonitätsstufen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 109 und 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 wie folgt zuzuordnen:

1. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	AAA bis AAL	AH bis AL	BBBH bis BBBL	BBH bis BBL	BH bis BL	CCCH und niedriger

2. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklassen gemäß Art. 112 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6
Rating	R-1 (high), R-1 (middle), R-1 (low)	R-2 (high), R-2 (middle) und R-2 (low)	R-3	R-4, R-5	---	---

3. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	R-1 (high), R-1 (middle), R1 (low)	R-2 (high), R-2 (middle), R-2 (low)	R-3	Alle kurzfristigen Ratings, die niedriger sind als R-3

4. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 112 lit. m der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Kreditrisiko-Standardansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5 und darunter
Rating	AAA bis AAL	AH bis AL	BBBH bis BBBL	BBH bis BBL	BH und niedriger

5. Langfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	Unter 11
Rating	AAA	AA	AH	A	AL	BBBH	BBB	BBBL	BBH	BB	BBL	Niedriger als BBL

6. Kurzfristige Ratings für Forderungen innerhalb der Forderungsklasse gemäß Art. 147 Abs. 2 lit. f der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (Ratingbasierter Ansatz):

Bonitätsstufe	1	2	3	Alle anderen Kreditbewertungen
Rating	R-1 (high), R-1 (middle), R1 (low)	R-2 (high), R-2 (middle), R-2 (low)	R-3	Alle kurzfristigen Ratings, die niedriger sind als R-3

§ 6. (1) Diese Verordnung tritt mit 1. Jänner 2014 in Kraft.

(2) Die Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) über die Zuordnung von Ratings anerkannter Rating-Agenturen zu Bonitätsstufen (Mappingverordnung), BGBl. II Nr. 113/2007, zuletzt geändert durch das Bundesgesetz BGBl. II Nr. 461/2011, tritt mit Ablauf des 31. Dezember 2013 außer Kraft.

Ettl Kumpfmüller

