

Den här texten är endast avsedd som ett dokumentationshjälpmedel och har ingen rättslig verkan. EU-institutionerna tar inget ansvar för innehållet. De autentiska versionerna av motsvarande rättsakter, inklusive ingresserna, publiceras i Europeiska unionens officiella tidning och finns i EUR-Lex. De officiella texterna är direkt tillgängliga via länkarna i det här dokumentet

► **B** KOMMISSIONENS GENOMFÖRANDEFÖRORDNING (EU) 2020/1227

av den 12 november 2019

om fastställande av tekniska genomförandestandarder vad gäller mallar för tillhandahållande av information i enlighet med kraven för STS-anmälan

(Text av betydelse för EES)

(EUT L 289, 3.9.2020, s. 315)

Ändrad genom:

Officiella tidningen

nr sida datum

► **M1** Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2022/1929 av den L 266 1 13.10.2022  
31 mars 2022

**▼B****KOMMISSIONENS GENOMFÖRANDEFÖRORDNING (EU)  
2020/1227**

av den 12 november 2019

**om fastställande av tekniska genomförandestandarder vad gäller  
mallar för tillhandahållande av information i enlighet med kraven  
för STS-anmälan**

(Text av betydelse för EES)

*Artikel 1***Mallar för STS-anmälan**

1. Den information som avses i artikel 1.1 a och 1.2 a i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1226 <sup>(1)</sup> ska lämnas med användning av de mallar som återfinns i bilaga I till denna förordning.

2. Den information som avses i artikel 1.1 b och 1.2 b i delegerad förordning (EU) 2020/1226 ska lämnas med användning av de mallar som återfinns i bilaga II till denna förordning.

3. Den information som avses i artikel 1.1 c och 1.2 c i delegerad förordning (EU) 2020/1226 ska lämnas med användning av de mallar som återfinns i bilaga III till denna förordning.

**▼M1**

3a. Den information som avses i artikel 1.1 d och 1.2 d i delegerad förordning (EU) 2020/1226 ska lämnas med användning av den mall som återfinns i bilaga IV till denna förordning.

4. Om den information som ska lämnas enligt denna artikel inte är tillgänglig eller obligatorisk på grund av att övergångsbestämmelserna i artikel 43 och 43a i förordning (EU) 2017/2402 tillämpas, ska det i anmälan anges ”Ej tillämpligt på grund av tillämpning av övergångsbestämmelser” i det eller de relevanta fälten i bilagorna till denna förordning.

**▼B**

5. Den information som avses i denna artikel ska lämnas i elektronisk och maskinläsbar form.

**▼M1**

6. Den ”ytterligare information” som avses i artikel 2 i delegerad förordning (EU) 2020/1226 ska lämnas i fältet ”Fält som ska fyllas i” i bilagorna I–IV till denna förordning.

<sup>(1)</sup> Kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1226 av den 12 november 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 med fastställande av tekniska tillsynsstandarder för att specificera den information som ska lämnas i enlighet med kraven för STS-anmälan (se sidan 285 i detta nummer av EUT).

**▼B**

*Artikel 2*

**Ikraftträdande**

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

**▼B***BILAGA I***Fältformat som ska användas i mallen för STS-anmälan**

SYMBOL	DATATYP	BESKRIVNING
{ALPHANUM-n}	Högst n alfanumeriska tecken	Fritextfält. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumeriska tecken	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166-1 alfa-2 landskod. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum ska formateras enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{Y/N}	1 siffra eller bokstav	”sant” – Y ”falskt” – N
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeriska tecken	LEI-kod enligt ISO 17442

**Mall för STS-anmälan för värdepapperisering som inte är ABCP**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA FYLLAS I	FÄLTFORMAT
STSS0	Första kontaktpunkt		{ALPHANUM-1000}
STSS1	Instrumentets identifieringskod		{ISIN}
STSS2	Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för originator, medverkande institut eller ursprunglig långgivare.		{LEI}
STSS3	Identifieringskod för anmälan		{ALPHANUM-100}
STSS4	Unik identifieringskod		{ALPHANUM-1000}
STSS5	Identifieringskod för prospektet		{ALPHANUM-100}
STSS6	Värdepapper-iseringens register		{ALPHANUM-1000}
STSS7	Värdepapper-iseringens beteckning		{ALPHANUM-100}
STSS8	Etableringsland		{COUNTRYCODE_2}
STSS9	Klassificering av värdepapper-iseringen		{LIST}
STSS10	Underliggande exponeringars förpliktelser		{LIST}

**▼M1****▼B**

**▼B**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSS11	Emissionsdatum		{DATEFORMAT}
STSS12	Datum för anmälan		{DATEFORMAT}
STSS13	Tredje part med tillstånd		{ALPHANUM-100}
STSS14	Tredje part med tillstånd (namn och etableringsland)		{ALPHANUM-1000} {COUNTRYCODE_2}
STSS15	Behörig myndighet som har utfärdat tillstånd till den tredje parten		{ALPHANUM-100}
STSS16	STS-status		{ALPHANUM-1000}

**▼M1**

STSS17	Originatorn (eller den ursprungliga långgivaren) är ett kreditinstitut		{Y/N}
--------	--	--	-------

**▼B**

STSS18	Bekräftelse avseende kreditgivningskriterier		{ALPHANUM-1000}
STSS19	Försäkran om att kreditgivningskriterier är föremål för tillsyn		{ALPHANUM-1000}
STSS20	Underliggande exponeringar som förvärvats genom äkta värdepapper-isering (true sale)		{ALPHANUM-10000}

**▼M1**

STSS21	Omfattas av stränga clawbackbestämmelser		{ALPHANUM-10000}
STSS22	Undantag för clawbackbestämmelser i nationell insolvenslagstiftning		{ALPHANUM-10000}

**▼B**

STSS23	Överföring om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren		{ALPHANUM-1000}
STSS24	Överföring som sker genom en överlåtelse och fullgörs i ett senare skede.		{ALPHANUM-10000}
STSS25	Utfästelser och garantier		{ALPHANUM-10000}
STSS26	Kriterier för aktiv portföljförvaltning		{ALPHANUM-10000}
STSS27	Tillgångarnas homogenitet		{ALPHANUM}
STSS28	Underliggande exponeringars förpliktelser/ingen återvärdepapper-isering		{ALPHANUM-1000}
STSS29	Sunda kreditgivnings-principer		{ALPHANUM}
STSS30	Originators/lån-givares sakkunskap		{ALPHANUM}
STSS31	Fallerade tillgångar		{ALPHANUM}

## ▼B

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSS32	Minst en betalning vid tidpunkten för överföringen		{ALPHANUM-1000}
STSS33	Återbetalning till innehavare/försäljning av tillgångar		{ALPHANUM}
STSS34	Uppfyllande av kraven på bibehållande av risk		{LIST}
STSS35	Riskreducering – ränte- och valutarisker		{ALPHANUM-10000}
STSS36	Derivat som köps/säljs av specialföretag för värdepapperisering		{ALPHANUM-10000}
STSS37	Derivat baserade på allmänt accepterade normer		{ALPHANUM-10000}
STSS38	Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor		{ALPHANUM-10000}
STSS39	Inget kvarhållande av kontanter efter beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning		{ALPHANUM-10000}
STSS40	Inga kontantbelopp ska kvarhållas		{ALPHANUM-1000}
STSS41	Inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet ska överföras till investerarna		{ALPHANUM-1000}
STSS42	Återbetalningen får inte kastas om vad gäller prioritet		{ALPHANUM-1000}
STSS43	Inga bestämmelser får föreskriva automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde		{ALPHANUM-1000}
STSS44	Värdepapperiseringar med en icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar		{ALPHANUM-1000}
STSS45	Revolverande värdepapperisering med händelser som utlöser förtida amortering för avslutande av den rullande perioden på grundval av på förhand fastställda utlösande faktorer		{ALPHANUM-10000}
STSS46	Försämring av kreditkvaliteten med avseende på de underliggande exponeringarna		{ALPHANUM-10000}
STSS47	Förekomst av en insolvensrelaterad händelse med avseende på originatorn eller serviceföretaget		{ALPHANUM-10000}
STSS48	Värdet av de underliggande exponeringar som innehas av specialföretaget för värdepapperisering sjunker under ett på förhand fastställt tröskelvärde		{ALPHANUM-10000}
STSS49	Det har inte kunnat genereras tillräckligt med nya underliggande exponeringar som uppfyller den förutfastställda kreditkvaliteten (utlösande händelse för avslutande av den rullande perioden)		{ALPHANUM-10000}
STSS50	Information om avtalsförpliktelser avseende serviceföretaget, trustförvaltaren och annan tillhandahållare av sidotjänster		{ALPHANUM-1000}
STSS51	Bestämmelser om servicekontinuitet		{ALPHANUM-1000}

## ▼B

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSS52	Bestämmelser om kontinuitet hos derivatmotparter		{ALPHANUM-1000}
STSS53	Bestämmelser om kontinuitet hos likviditetstillhandahållare och kontoförande bank		{ALPHANUM-1000}
STSS54	Erforderlig sakkunskap hos serviceföretaget, och riktlinjer och adekvata förfaranden och kontroller för riskhantering		{ALPHANUM}
STSS55	Tydliga och enhetliga definitioner (problematiska lån)		{ALPHANUM-1000}
STSS56	Prioritetsordningar för betalningar och utlösande händelser		{ALPHANUM-1000}
STSS57	Snabb lösning av konflikter mellan olika kategorier av investerare och trustförvaltares skyldigheter		{ALPHANUM-1000}
STSS58	Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster		{ALPHANUM-1000}
STSS59	Extern kontroll av ett urval av de underliggande exponeringarna		{ALPHANUM-1000}
STSS60	Kassaflödesmodell för skulder tillgänglig för potentiella investerare		{ALPHANUM-1000}
STSS61	Miljöprestanda/bostadslån eller billån eller billeasing		{ALPHANUM-10000}
STSS62	Originator och medverkande institut ansvariga för efterlevnad av artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}

**▼B***BILAGA II***Fältformat som ska användas i mallen för STS-anmälan**

SYMBOL	DATATYP	BESKRIVNING
{ALPHANUM-n}	Högst n alfanumeriska tecken	Fritextfält. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumeriska tecken	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166-1 alfa-2 landskod. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum ska formateras enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{Y/N}	1 siffra eller bokstav	”sant” – Y ”falskt” – N
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeriska tecken	LEI-kod enligt ISO 17442

**Mall för STS-anmälan för ABCP-värdepapperisering**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSAT0	Första kontaktpunkt		{ALPHANUM-1000}
STSAT1	Instrumentets identifierings-kod		{ISIN}
STSAT2	Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för originator, medverkande institut eller ursprunglig långgivare.		{LEI}
STSAT3	Identifieringskod för anmälan		{ALPHANUM-100}
STSAT4	Unik identifieringskod		{ALPHANUM-1000}
STSAT5	Identifieringskod för prospektet		{ALPHANUM-100}
STSAT6	Värdepapper-iseringsregister		{ALPHANUM-1000}
STSAT7	Värdepapper-iseringens beteckning		{ALPHANUM-100}
STSAT8	Etableringsort		{ALPHANUM-1000}
STSAT9	Typ av värdepapper-isering		{LIST}
STSAT10	Underliggande exponeringars förpliktelser		{LIST}

**▼M1****▼B**



**▼B**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSAT11	Emissions-datum		{DATEFORMAT}
STSAT12	Datum för anmälan		{DATEFORMAT}
STSAT13	Tredje part med tillstånd		{ALPHANUM-100}
STSAT14	Tredje part med tillstånd (namn och etableringsland)		{ALPHANUM-1000} {COUNTRYCODE_2}
STSAT15	Behörig myndighet som har utfärdat tillstånd till den tredje parten		{ALPHANUM-100}
STSAT16	STS-status		{ALPHANUM-1000}
<b>▼M1</b>			
STSAT17	Originatören (eller den ursprungliga långgivaren) är ett kreditinstitut		{Y/N}
<b>▼B</b>			
STSAT18	Bekräftelse avseende kreditgivningskriterier		{ALPHANUM-1000}
STSAT19	Försäkran om att kreditgivningskriterier är föremål för tillsyn		{ALPHANUM-1000}
STSAT20	Underliggande exponeringar som förvärvats genom äkta värdepapperisering (true sale)		{ALPHANUM-10000}
<b>▼M1</b>			
STSAT21	Omfattas av stränga clawbackbestämmelser		{ALPHANUM-10000}
STSAT22	Undantag för clawbackbestämmelser i nationell insolvenslagstiftning		{ALPHANUM-10000}
<b>▼B</b>			
STSAT23	Överföring om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren		{ALPHANUM-1000}
STSAT24	Överföring som sker genom en överlåtelse och fullgörs i ett senare skede.		{ALPHANUM-10000}
STSAT25	Utfästelser och garantier		{ALPHANUM-10000}
STSAT26	Kriterier för aktiv portföljförvaltning		{ALPHANUM-10000}
STSAT27	Ej återvärde-papperisering		{ALPHANUM-1000}
STSAT28	Överförda underliggande exponeringar utan fallerade exponeringar		{ALPHANUM}
STSAT29	Minst en betalning gjord vid tidpunkten för överföringen		{ALPHANUM-1000}
STSAT30	Återbetalning till innehavare/försäljning av tillgångar		{ALPHANUM}

## ▼B

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSAT31	Riskreducering – ränte- och valutarisker		{ALPHANUM-10000}
STSAT32	Derivat som köps/säljs av specialföretag för värdepapper-isering		{ALPHANUM-10000}
STSAT33	Derivat i underliggande exponeringar		{ALPHANUM-10000}
STSAT34	Derivat baserade på allmänt accepterade normer		{ALPHANUM-10000}
STSAT35	Klara och entydiga definitioner vad gäller behandlingen av problematiska lån		{ALPHANUM-1000}
STSAT36	Prioritetsordningar för betalningar och utlösande händelser		{ALPHANUM-1000}
STSAT37	Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster		{ALPHANUM-1000}
STSAT38	Tillgångarnas homogenitet		{ALPHANUM}
STSAT39	Underliggande exponeringars förpliktelser		{ALPHANUM-1000}
STSAT40	Underliggande exponeringars förpliktelser		{ALPHANUM-1000}
STSAT41	Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor		{ALPHANUM-10000}
STSAT42	Inget kvarhållande av kontanter efter beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning		{ALPHANUM-10000}
STSAT43	Inget kvarhållande av kontanter efter verkställighet eller påskyndad betalning		{ALPHANUM-1000}
STSAT44	Inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet ska överföras till investerarna		{ALPHANUM-1000}
STSAT45	Inga bestämmelser får föreskriva automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde		{ALPHANUM-1000}
STSAT46	Sunda kreditgivnings-principer		{ALPHANUM}
STSAT47	Säljarens sakkunskap		{ALPHANUM}
STSAT48	Revolverande ABCP-transaktion/utlösande faktor för kreditkvalitet		{ALPHANUM}
STSAT49	Uppgifter som åligger värdepapper-iseringens parter		{ALPHANUM-1000}
STSAT50	Bestämmelser om servicekontinuitet		{ALPHANUM-1000}
STSAT51	Bestämmelser om kontinuitet hos derivatmotpart och kontoförande bank		{ALPHANUM-1000}
STSAT52	Det medverkande institutets kvalitet		{ALPHANUM-1000}

▼ B

## BILAGA III

## Fältformat som ska användas i mallen för STS-anmälan

SYMBOL	DATATYP	BESKRIVNING
{ALPHANUM-n}	Högst n alfanumeriska tecken	Fritextfält. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumeriska tecken	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166-1 alfa-2 landskod. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum ska formateras enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{Y/N}	1 siffra eller bokstav	”sant” – Y ”falskt” – N
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeriska tecken	LEI-kod enligt ISO 17442

## Mall för STS-anmälan för ABCP-program

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA FYLLAS I	FÄLTFORMAT
STSAP0	Första kontaktpunkt		{ALPHANUM-1000}
STSAP1	Instrumentets identifieringskod		{ISIN}
STSAP2	Sponsors LEI-kod		{LEI}
STSAP3	Identifieringskod för anmälan		{ALPHANUM-100}
▼ <u>M1</u> STSAP4	Unik identifieringskod		{ALPHANUM-1000}
▼ <u>B</u> STSAP5	Identifieringskod för prospektet		{ALPHANUM-100}
STSAP6	Värdepapper-iseringsregister		{ALPHANUM-1000}
STSAP7	ABCP-programmet beteckning		{ALPHANUM-100}
STSAP8	Etableringsland		{ALPHANUM-1000}
STSAP9	Instrumentets klassificering		{LIST}
STSAP10	Emissionsdatum		{DATEFORMAT}
STSAP11	Datum för anmälan		{DATEFORMAT}

▼ B

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSAP12	Tredje part med tillstånd		{ALPHANUM-100}
STSAP13	Tredje part med tillstånd (namn och etableringsland)		{ALPHANUM-1000} {COUNTRYCODE_2}
STSAP14	Behörig myndighet som har utfärdat tillstånd till den tredje parten		{ALPHANUM-100}
STSAP15	STS-status		{ALPHANUM-1000}
STSAP16	Medverkande institut ska vara ett kreditinstitut under tillsyn		{ALPHANUM-1000}
STSAP17	Stöd från det medverkande institutet genom tillhandahållande av likviditet		{ALPHANUM-1000}
STSAP18	Uppvisande för kreditinstitutets behöriga myndighet		{ALPHANUM-1000}
STSAP19	Det medverkande institutets efterlevnad av kraven på due diligence		{ALPHANUM-1000}
STSAP20	Efterlevnad av kraven på bibehållande av risk (transaktionsnivå/programnivå)		{LIST}
STSAP21	Efterlevnad på ABCP-programnivå av artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}
STSAP22	Utnyttjade av likviditet där likviditetsfaciliteten inte förnyas		{ALPHANUM-10000}
STSAP23	Efterlevnad av kraven i artikel 24.1–24.8 och 24.12–24.20 i förordning (EU) 2017/2402 för ABCP-transaktioner inom ramen för ett ABCP-program		{ALPHANUM-1000}
STSAP24	Högst 5 % av det sammanlagda beloppet för underliggande exponeringar tillfälligt oförenligt med vissa krav		{ALPHANUM}
STSAP25	Vägd genomsnittlig livslängd (WAL) högst två år		{ALPHANUM-1000}
STSAP26	Fullt stöd till ABCP-program (stöd av medverkande institut)		{ALPHANUM-10000}
STSAP27	Ingen återvärde-papperisering och ingen kreditförstärkning som inför ett andra skikt med trancher på ABCP-programnivå		{ALPHANUM-1000}
STSAP28	Inga köpoptioner		{ALPHANUM-1000}
STSAP29	Ränte- och valutarisker på ABCP-programnivå lämpligt minskade och dokumenterade		{ALPHANUM}
STSAP30	Krav på ABCP-programmets dokumentation (trustförvaltarens ansvar gentemot investerarna)		{ALPHANUM-1000}

**▼B**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSAP31	Krav på ABCP-programmets dokumentation (det medverkande institutets avtalsförpliktelser)		{ALPHANUM-1000}
STSAP32	Krav på ABCP-programmets dokumentation (processer och skyldigheter vid serviceföretagets fallissemang)		{ALPHANUM-1000}
STSAP33	Krav på ABCP-programmets dokumentation (bestämmelser om utbyte av derivatmotparter och kontoförande bank)		{ALPHANUM-1000}
STSAP34	Krav på ABCP-programmets dokumentation (förfaranden för att säkerställa säkring av finansieringsåtagandet)		{ALPHANUM-1000}
STSAP35	Krav på ABCP-programmets dokumentation (likviditetsfacilitet och värdepapper som förfaller ska återbetalas om det medverkande institutet inte förnyar finansieringsåtagandet för likviditetsfaciliteten innan det löper ut)		{ALPHANUM-1000}
STSAP36	Serviceföretagets sakkunskap		{ALPHANUM}

▼ **M1***BILAGA IV***Fältformat som ska användas i mallen för STS-anmälan**

SYMBOL	DATATYP	BESKRIVNING
{ALPHANUM-n}	Högst n alfanumeriska tecken	Fritextfält. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{COUNTRYCODE_2}	2 alfanumeriska tecken	Landskod med 2 tecken enligt ISO 3166-1 alfa-2 landskod. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{CURRENCYCODE_3}	3 alfanumeriska tecken	Valutakod med 3 bokstäver enligt ISO 4217 valutakoder. Ska anges i ASCII-format (inga tecken med accent).
{DATEFORMAT}	Datumformat enligt ISO 8601	Datum ska formateras enligt följande format: ÅÅÅÅ-MM-DD
{Y/N}	1 siffra eller bokstav	”sant” – Y ”falskt” – N
{ISIN}	12 alfanumeriska tecken	ISIN-kod enligt ISO 6166
{LEI}	20 alfanumeriska tecken	LEI-kod enligt ISO 17442

**Mall för STS-anmälan för värdepapperiseringar i balansräkningen**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY 1	Första kontaktpunkt		{LEI}
STSSY 2	Datum för anmälan		{DATEFORMAT}
STSSY 3	Instrumentets identifieringskod		{ISIN}
STSSY 4	Identifieringskod för juridiska personer (LEI)		{LEI}
STSSY 5	Säljare av skydd		{ALPHANUM-100}
STSSY 6	Identifieringskod för anmälan		{ALPHANUM-100}
STSSY 7	Unik identifieringskod		{ALPHANUM-1000}
STSSY 8	Värdepapperiseringsregister		{ALPHANUM-100}
STSSY 9	Etableringsland		{COUNTRYCODE_2}
STSSY 10	Klassificering av syntetisk värdepapperisering		{LIST}
STSSY 11	Syntetisk värdepapperisering med obetalt kreditriskskydd		{LIST}
STSSY 12	Kreditriskskyddsavtal som används		{LIST}

▼ M1

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY 13	Klassificering av underliggande exponeringar		{LIST}
STSSY 14	Emissionsdatum		{DATEFORMAT}
STSSY 15	Tredje part med tillstånd som utför kontroll – förklaring		{ALPHANUM-100}
STSSY 16	Tredje part med tillstånd som utför kontroll – etableringsland		{COUNTRYCODE_2}
STSSY 17	Tredje part med tillstånd som utför kontroll – behörig myndighet		{ALPHANUM-100}
STSSY 18	STS-status		{ALPHANUM-1000}
STSSY 19	Originatorn är en enhet under tillsyn i unionen		{ALPHANUM-1000}
STSSY 20	Originatorn tillämpar riktlinjer på exponeringar som köpts av tredje part		{ALPHANUM-10000}
STSSY 21	Ursprung för underliggande exponeringar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 22	Tillgångar hålls i originatorns balansräkning vid transaktionens avslut		{ALPHANUM-1000}
STSSY 23	Gruppkategori		{ALPHANUM-1000}
STSSY 24	Ingen ytterligare säkring av originatorns exponering		{ALPHANUM-1000}
STSSY 25	Kreditriskskyddsavtalet uppfyller villkoren i artikel 249 i förordning (EU) nr 575/2013		{ALPHANUM-1000}
STSSY 26	Kreditriskskyddsavtalet följer andra regler för kreditriskreducering		{ALPHANUM-10000}
STSSY27	Utfästelser och garantier – äganderätt till de underliggande exponeringarna		{ALPHANUM-10000}
STSSY28	Utfästelser och garantier – originatorn behåller kreditrisken i de underliggande tillgångarna		{ALPHANUM-10000}
STSSY29	Utfästelser och garantier – exponerings uppfyllande av godtagbarhetskriterier		{ALPHANUM-10000}
STSSY30	Utfästelser och garantier – laglig och verkställbar förpliktelse för gäldenären		{ALPHANUM-10000}
STSSY31	Utfästelser och garantier – kreditgivningskriterier		{ALPHANUM-10000}
STSSY32	Utfästelser och garantier – inga gäldenärer har väsentligt åsidosatt eller fallerat i fråga om sina förpliktelser		{ALPHANUM-10000}

▼ **M1**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY33	Utfästelser och garantier – ingen oriktig information i transaktionsdokumentationen		{ALPHANUM-10000}
STSSY34	Utfästelser och garantier – verkställbarhet eller möjlighet att driva in underliggande exponeringar		{ALPHANUM-10000}
STSSY35	Godtagbarhetskriterier som inte medger diskretionär aktiv portföljförvaltning av de underliggande exponeringarna.		{ALPHANUM-10000}
STSSY36	Undantag från förbudet mot aktiv portföljförvaltning		{ALPHANUM-10000}
STSSY37	Exponering som lagts till efter transaktionens avslutsdag uppfyller godtagbarhetskriterierna		{ALPHANUM-10000}
STSSY 38	Exponering till fullo återbetald		{ALPHANUM-10000}
STSSY 39	Underliggande exponeringar har avyttrats		{ALPHANUM-10000}
STSSY 40	Ingen kreditberoende ändring		{ALPHANUM-10000}
STSSY 41	Godtagbarhetskriterierna uppfylls inte		{ALPHANUM-10000}
STSSY 42	Tillgångarnas homogenitet		{ALPHANUM}
STSSY 43	Bara en tillgångstyp		{ALPHANUM}
STSSY 44	Förpliktelser som är avtalsmässigt bindande och verkställbara		{ALPHANUM-10000}
STSSY 45	Fastställd periodisk betalning		{ALPHANUM}
STSSY 46	Inkomster från försäljning av tillgångar		{ALPHANUM}
STSSY 47	Inga överlåtbara värdepapper		{ALPHANUM}
STSSY 48	Ingen återvärde-papperisering		{ALPHANUM-1000}
STSSY 49	Kreditgivningsprinciper redovisas för potentiella investerare		{ALPHANUM-1000}
STSSY 50	Full regressrätt mot gäldenär		{ALPHANUM-1000}
STSSY 51	Kreditgivningsprinciper – inga tredje parter		{ALPHANUM-1000}
STSSY 52	Kreditgivningsprinciper – bostadslån		{ALPHANUM-1000}
STSSY 53	Kreditgivningsprinciper – bedömning av låntagaren		{ALPHANUM-1000}
STSSY 54	Sakkunskaper hos originator eller ursprunglig långgivare		{ALPHANUM-1000}
STSSY 55	Inga fallerande exponeringar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 56	Ingen negativ kredithistorik		{ALPHANUM-10000}



▼ **M1**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY 57	Risken för uteblivna betalningar är inte högre än för exponeringar som inte är värdepapperiserade		{ALPHANUM-1000}
STSSY 58	Minst en betalning har gjorts vid tidpunkten då de underliggande exponeringarna inkluderas		{ALPHANUM-1000}
STSSY 59	Uppfyllande av kravet på bibehållande av risk		{ALPHANUM}
STSSY 60	Riskreducering – ränte- och valutarisker		{ALPHANUM-1000}
STSSY 61	Säkerhet enligt kreditriskskyddsavtalet och kreditriskskyddsbetalningen är noterade i samma valuta		{ALPHANUM-1000}
STSSY 62	Specialföretagets skulder är lika med eller mindre än specialföretagets intäkter		{ALPHANUM-10000}
STSSY 63	Inga derivat används, utom för att säkra ränte- eller valutarisker		{ALPHANUM-1000}
STSSY 64	Användning av derivat baserat på allmänt accepterade normer		{ALPHANUM-10000}
STSSY 65	Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor utan komplicerade formler eller derivat		{ALPHANUM-10000}
STSSY 66	Verkställighetshändelse utan inverkan på investerarens verkställighetsåtgärder		{ALPHANUM-10000}
STSSY 67	Verkställighet av kreditriskskyddsavtalet – Inga kontantbelopp får kvarhållas i specialföretaget för värdepapperisering		{ALPHANUM-10000}
STSSY 68	Förluster fördelade utifrån tranchernas prioritet		{ALPHANUM-10000}
STSSY 69	Sekventiell amortering		{ALPHANUM-10000}
STSSY 70	Icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 71	Resultatrelaterade utlösande faktorer		{ALPHANUM}
STSSY 72	Resultatrelaterade utlösande faktorer		{ALPHANUM}
STSSY 73	Resultatrelaterade utlösande faktorer		{ALPHANUM}
STSSY 74	Belopp avseende säkerhet som motsvarar beloppet för amorteringen av trancherna		{ALPHANUM-10000}
STSSY 75	Kredithändelse och tillgängligt kreditriskskyddsbelopp per givet betalningsdatum		{ALPHANUM-10000}
STSSY 76	Bestämmelser om förtida amortering eller utlösande faktorer – Kreditkvalitet		{ALPHANUM-10000}

▼ **M1**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY 77	Bestämmelser om förtida amortering eller utlösande faktorer – Förluster		{ALPHANUM-10000}
STSSY 78	Bestämmelser om förtida amortering eller utlösande faktorer – Nya exponeringar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 79	Avtalade förpliktelser, skyldigheter och ansvarsområden – Serviceföretag		{ALPHANUM-10000}
STSSY 80	Avtalade förpliktelser, skyldigheter och ansvarsområden – Trustförvaltare		{ALPHANUM-10000}
STSSY 81	Avtalade förpliktelser, skyldigheter och ansvarsområden – Tredjepartskontrollant		{ALPHANUM-10000}
STSSY 82	Avtalade förpliktelser, skyldigheter och ansvarsområden – fallissemang eller insolvens		{ALPHANUM-10000}
STSSY 83	Avtalade förpliktelser, skyldigheter och ansvarsområden – förvaltningsförfaranden		{ALPHANUM-10000}
STSSY 84	Administrationsstandarder		{ALPHANUM-10000}
STSSY 85	Erforderliga sakkunskaper hos serviceföretaget		{ALPHANUM-1000}
STSSY 86	Väldokumenterade och adekvata riktlinjer, förfaranden och kontroller för riskhantering		{ALPHANUM-1000}
STSSY 87	Förvaltningsförfaranden som inte är mindre strikta än de som tillämpas på liknande exponeringar som inte är värdepapperiserade		{ALPHANUM-1000}
STSSY 88	Referensregister		{ALPHANUM}
STSSY 89	Referensregister – Innehåll		{ALPHANUM-10000}
STSSY 90	Snabb lösning av konflikter mellan olika kategorier av investerare		{ALPHANUM-1000}
STSSY 91	Specialföretag för värdepapperisering – tydligt fastställda rösträtter		{ALPHANUM-1000}
STSSY 92	Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster		{ALPHANUM-1000}
STSSY 93	Extern kontroll av ett urval av de underliggande exponeringarna		{ALPHANUM-1000}
STSSY 94	Kassaflödesmodell för skulder tillgänglig för potentiella investerare		{ALPHANUM-1000}
STSSY 95	Offentliggörande av miljöprestandan hos underliggande exponeringar i form av bostadslån, billån eller billeasing		{ALPHANUM-10000}

▼ **M1**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY 96	Undantag från kravet på offentliggörande av miljöprestandan hos underliggande exponeringar i form av bostadslån, billån eller bil-leasing		{ALPHANUM-10000}
STSSY97	Originator ansvarig för efterlevnad av artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}
STSSY 98	Information om artikel 7.1 a i förordning (EU) 2017/2402 tillgänglig för potentiella investerare		{ALPHANUM-1000}
STSSY 99	Information enligt artikel 7.1 b, c och d i förordning (EU) 2017/2402 är tillgänglig för potentiella investerare, åtminstone i form av ett utkast eller i sin ursprungliga form		{ALPHANUM-1000}
STSSY 100	Kredithändelser och användning av garantier		{ALPHANUM-10000}
STSSY 101	Kredithändelser och användning av kreditderivat		{ALPHANUM-10000}
STSSY 102	Kreditriskskyddsavtal dokumenteras		{ALPHANUM-10000}
STSSY 103	Anståndsåtgärder utesluter inte att godtagbara kredithändelser utlöses		{ALPHANUM-10000}
STSSY 104	Kreditriskskyddsbetalningen baseras på den faktiska realiserade förlusten och standardprinciper och -förfaranden för återvinning		{ALPHANUM-10000}
STSSY 105	Kreditriskskyddsbetalningen ska betalas inom en angiven tidsperiod		{ALPHANUM-10000}
STSSY 106	En mellanliggande kreditriskskyddsbetalning görs senast sex månader efter en kredithändelse		{ALPHANUM-10000}
STSSY 107	Mellanliggande kreditriskskyddsbetalning är högre än det förväntade förlustbeloppet		{ALPHANUM-10000}
STSSY 108	Villkor för den mellanliggande kreditriskskyddsbetalningen		{ALPHANUM-10000}
STSSY 109	Metod för beräkning av mellanliggande och slutliga kreditriskskyddsbetalningar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 110	Kreditriskskyddsbetalningen står i proportion till andelen av det utestående nominella beloppet		{ALPHANUM-10000}
STSSY 111	Kreditriskskyddsbetalningens verkställbarhet		{ALPHANUM-10000}
STSSY 112	Det belopp som ska betalas av investerare enligt kreditriskskyddsavtalet fastställs tydligt i kreditriskskyddsavtalet.		{ALPHANUM-10000}

▼ **M1**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA FYLLAS I	FÄLTFORMAT
STSSY 113	Beräkning av beloppen under alla omständigheter		{ALPHANUM-10000}
STSSY 114	De omständigheter under vilka investerare är skyldiga att göra betalningar fastställs i kreditriskskyddsavtalet.		{ALPHANUM-10000}
STSSY 115	Tredjepartskontrollantens bedömning av omständigheter som utlöser investerares betalningar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 116	Kreditriskskyddsbetalningen beräknas på nivå för den enskilda underliggande exponeringen.		{ALPHANUM-10000}
STSSY 117	Angivelse av den längsta förlängningsperioden för skulduppställningsprocessen		{ALPHANUM-10000}
STSSY 118	Förlängningsperioden är inte längre än två år		{ALPHANUM-10000}
STSSY 119	Slutlig kreditriskskyddsbetalning baserad på originators slutliga förlustberäkning		{ALPHANUM-10000}
STSSY 120	Uppsägning av kreditriskskyddsavtalet		{ALPHANUM-10000}
STSSY 121	Kreditriskskyddspremierna är beroende av utestående nominella belopp		{ALPHANUM-10000}
STSSY 122	Kreditriskskyddsavtalet stipulerar inte föreskriver mekanismer som kan leda till att den faktiska fördelningen av förluster på investerarna undviks eller minskas		{ALPHANUM-10000}
STSSY 123	Undantag för förskottsbetalningar av premier		{ALPHANUM-10000}
STSSY 124	Beskrivning av kreditriskskyddspremien i transaktionsdokumentationen		{ALPHANUM-10000}
STSSY 125	Investerarnas rätt är verkställbar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 126	Utseende av en tredjepartskontrollant före transaktionens avslutsdag.		{ALPHANUM-1000}
STSSY 127	Tredjepartskontrollantens kontroll – Kreditändelse enligt vad som anges i villkoren i kreditriskskyddsavtalet		{ALPHANUM-1000}
STSSY 128	Tredjepartskontrollantens kontroll – Underliggande exponering ingår i referensportföljen		{ALPHANUM-1000}
STSSY 129	Tredjepartskontrollantens kontroll – Godtagbarhetskriterierna var uppfyllda när den underliggande exponeringen togs in i referensportföljen		{ALPHANUM-1000}
STSSY 130	Tredjepartskontrollantens kontroll – Efterlevnad av villkoren för påfyllning		{{ALPHANUM-1000}}

▼ **M1**

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA FYLLAS I	FÄLTFORMAT
STSSY 131	Tredjepartskontrollantens kontroll – Förluster förenliga med förluster redovisade i originatorns resultaträkning		{ALPHANUM-1000}
STSSY 132	Tredjepartskontrollantens kontroll – Förlusterna har fördelats på investerarna på ett riktigt sätt		{ALPHANUM-1000}
STSSY 133	Tredjepartskontrollanten är oberoende av originatorer, investerare och, i tillämpliga fall, specialföretaget för värdepapperisering		{ALPHANUM-10000}
STSSY 134	Tredjepartskontrollanten har utsetts senast på transaktionens avslutsdag.		{ALPHANUM-10000}
STSSY 135	Tredjepartskontrollantens kontroll utförs på urvalsbasis		{ALPHANUM-10000}
STSSY 136	Möjlighet för investerare att begära att tredjepartskontrollanten kontrollerar underliggande exponeringar		{ALPHANUM-10000}
STSSY 137	Möjlighet för tredjepartskontrollanten att få tillgång till all relevant information		{ALPHANUM-10000}
STSS 138	Händelser som möjliggör uppsägning		{ALPHANUM-10000}
STSS 139	Transaktionsdokumentation – rätt till uppsägning		{ALPHANUM-10000}
STSS 140	Transaktionsdokumentation – Tidsoptionen inte utformad för att undvika fördelning av förluster på kreditförstärkningspositioner		{ALPHANUM-10000}
STSS 141	Tidsoption		{ALPHANUM-10000}
STSS 142	Förbetalt kreditriskskydd – Återlämnande av säkerheter till investerarna i prioritetsordning för trancherna		{ALPHANUM-10000}
STSS 143	Investerares uppsägning av en transaktion på grund av underlåtenhet att betala kreditriskskyddspremien		{ALPHANUM-10000}
STSSY 144	Syntetisk överskottsmarginal till investerare anges i transaktionsdokumentationen och uttrycks som en fast procentsats av det totala utestående portföljsaldot		{ALPHANUM-10000}
STSSY 145	Outnyttjad syntetisk överskottsmarginal betalas tillbaka till originatorn		{ALPHANUM-10000}
STSSY 146	Originatorer som använder internmetoden – Totalt belopp för åtaganden per år överstiger inte beloppen för förväntade förluster för ett år beräknade enligt förordningen		{ALPHANUM-10000}

▼ M1

FÄLTETS NUMMER	FÄLTETS BETECKNING	FÄLT SOM SKA Fyllas I	FÄLTFORMAT
STSSY 147	Originatorer som inte använder intermetoden – Beräkningen av de förväntade förlusterna i den underliggande portföljen för ett år fastställs tydligt i transaktionsdokumentationen		{ALPHANUM-10000}
STSSY 148	Villkor för syntetisk överskottsmarginal anges i transaktionsdokumentationen		{ALPHANUM-10000}
STSS 149	Kreditriskskydd som används		{ALPHANUM-10000}
STSSY 150	Originatorns rätt att använda säkerheten för att fullgöra investerarnas skyddsbetalningsförpliktelser är verkställbar genom lämpliga säkerhetsarrangemang		{ALPHANUM}
STSSY 151	Investerarnas rätt att, när värdepapperiseringen avvecklas eller när trancherna amorteras, få tillbaka säkerhet som inte har använts		{ALPHANUM-10000}
STSSY 152	Säkerhet placerad i värdepapper – Godtagbarhetskriterier och förvaringsarrangemang anges i transaktionsdokumentationen		{ALPHANUM}
STSSY 153	Investerare exponerade för originatorns kreditrisk		{ALPHANUM-10000}
STSSY 154	Juridiskt utlåtande som bekräftar att kreditriskskyddet är verkställbart inom alla territorier		{ALPHANUM-1000}
STSSY 155	Säkerhet av hög kvalitet – Räntebärande värdepapper med en riskvikt på 0 %		{ALPHANUM-10000}
STSSY 156	Säkerhet av hög kvalitet – Kontanta medel som innehas av ett utomstående kreditinstitut med kreditkvalitetssteg 3 eller högre		{ALPHANUM-10000}
STSSY 157	Undantag – Säkerhet i form av kontanta medel som inlåning hos originatorn		{ALPHANUM}
STSSY 158	Säkerhet i form av kontanta medel som inlåning hos originatorn – Tillstånd från behörig myndighet		{ALPHANUM}
STSSY 159	Överföring av säkerhet om det utomstående kreditinstitutet eller originatorn inte längre uppfyller kraven för det lägsta kreditkvalitetssteget		{ALPHANUM}
STSSY 160	Uppfyllande av kraven på säkerheter vid investeringar i kreditlänkade obligationer som emitterats av originatorn		{ALPHANUM-1000}