

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 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

(Text av betydelse för EES)

(EUT L 289, 3.9.2020, s. 285)

Ändrad genom:

| | | Officiella tidningen | | |
|--------------------|--|----------------------|------|-----------|
| | | nr | sida | datum |
| ► <u>M1</u> | Kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1301 av den 31 mars 2022 | L 197 | 10 | 26.7.2022 |

▼B**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

(Text av betydelse för EES)

*Artikel 1***Information som ska ingå i STS-anmälan**

1. Den information som ska ingå i STS-anmälan enligt artikel 27 i förordning (EU) 2017/2402 ska vara följande:

- a) För värdepapperiseringar som inte är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i bilaga I till denna förordning.
- b) För värdepapperiseringar som är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i bilaga II till denna förordning.
- c) För ABCP-program: den information som anges i bilaga III till denna förordning.

▼M1

d) För värdepapperiseringar som är syntetiska värdepapperiseringar i balansräkningen: den information som anges i bilaga IV till denna förordning.

▼B

2. För värdepapperiseringar där inget prospekt måste upprättas i enlighet med förordning (EU) 2017/1129 ska den information som ska ingå i STS-anmälan enligt punkt 1 åtföljas av följande:

- a) För värdepapperiseringar som inte är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i fälten STSS9 och STSS10 i bilaga I till denna förordning.
- b) För värdepapperiseringar som är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i fälten STSAT9 och STSAT10 i bilaga II till denna förordning.
- c) För ABCP-program: den information som anges i fält STSAP9 i bilaga III till denna förordning.

▼M1

d) För värdepapperiseringar som är syntetiska värdepapperiseringar i balansräkningen: den information som anges i fälten STSSY2, STSSY10, STSSY12 och STSSY13 i bilaga IV till denna förordning.

▼B

Vid tillämpning av artikel 27.1 tredje stycket i förordning (EU) 2017/2402 ska offentliggörandet av STS-anmälan för dessa värdepapperiseringar begränsas till den information som avses i denna punkt.

▼B*Artikel 2***Ytterligare information****▼M1**

Om följande dokument innehåller information som är relevant för STS-anmälan får en hänvisning till relevanta delar av dessa dokument lämnas i kolumnen ”Ytterligare information” i bilaga I, II, III eller IV till denna förordning; om sådan information ges ska dokumentationen tydligt identifieras:

▼B

- a) Prospekt som upprättats i enlighet med förordning (EU) 2017/1129.
- b) All annan underliggande dokumentation enligt artikel 7.1 b i förordning (EU) 2017/2402.

▼M1

- c) Alla andra dokument med information som är relevant för STS-anmälan, inbegripet – vad gäller syntetiska värdepapperiseringar i balansräkningen – dokument avseende originator, investerare, kredit-skyddsavtalet, den tredjepartskontrollant som avses i artikel 26e.4 i förordning (EU) 2017/2402 och, om tillgänglig, styrkande dokumentation avseende de kreditlänkade obligationer som avses i artikel 26e.10 femte stycket i förordning (EU) 2017/2402.

▼B*Artikel 3***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

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artiklarna 19–22 i förordning (EU) 2017/2402 avseende värdepapperisering som inte är ABCP

Allmän information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|-------------|-------------------------------------|--|--|---|
| STSS0 | Artikel 27.1 | Första kontaktpunkt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten, och namnet på den relevanta behöriga myndigheten | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 (2) |
| STSS1 | Ej tillämpligt | Instrumentets identifieringskod | Om tillgängligt, ISIN-kod(er) (internationellt standardnummer för värdepapper) Om det inte finns någon ISIN-kod, ange annat unikt värdepappersnummer som har tilldelats denna värdepapperisering. | Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |
| STSS2 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för originator(er), medverkande institut och, om tillgängligt, ursprunglig(a) långgivare. | Punkt 4.2 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS3 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för anmälan | Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan. | Ej tillämpligt |
| ▼ M1 | | | | |
| STSS4 | Ej tillämpligt | Unik identifieringskod | Den unika identifieringskod som tilldelats av det rapporterande företaget i enlighet med artikel 11.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224 (3). Om mer än en STS-anmälan görs med hjälp av denna unika identifieringskod för värdepapperiseringar ska en förklaring lämnas om skälen till detta. | Ej tillämpligt |
| ▼ B | | | | |
| STSS5 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för prospektet | Om tillgänglig, den identifieringskod för prospektet som tillhandahålls av den relevanta behöriga myndigheten. | Ej tillämpligt |
| STSS6 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringsregister | Om tillgängligt, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret. | Ej tillämpligt |
| STSS7 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringens beteckning | Värdepapperiseringens beteckning. | Avsnitt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼ B

| Fältnum- mer | Artikel i för- ordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|-----------------|---|---|--|-------------------------|
| STSS8 | Artiklarna 18 och 27.3 | Etableringsland | Om tillgängligt, etableringsland för originator(er), medverkande institut, specialföretag för värdepapperisering och ursprunglig(a) långivare. | Ej tillämpligt |
| STSS9 | Ej tillämpligt | Klassificering av värdepapperiseringen | Typ av värdepapperisering: — värdepapperisering som inte är ABCP — ABCP-värdepapperisering — ABCP-program | Ej tillämpligt |
| STSS10 | Ej tillämpligt | Klassificering av underliggande exponeringar | Typ av underliggande exponeringar, inklusive 1) bostadslån som antingen har ett eller flera pantbrev på bostadsfastigheter som säkerhet eller som garanteras fullt ut av en sådan godtagbar utfärdare av kreditskydd som avses i artikel 201.1 i förordning (EU) nr 575/2013 och som uppfyller kraven för kreditkvalitetssteg 2 eller högre i enlighet med del tre avdelning II kapitel 2 i den förordningen, 2) kommersiella lån med ett eller flera pantbrev på kommersiella fastigheter som säkerhet, inbegripet kontor eller andra kommersiella lokaler, 3) kreditfaciliteter till privatpersoner för den personens, familjens eller hushållets konsumtion, 4) kreditfaciliteter, inklusive lån och leasingavtal, som ges till alla typer av företag eller bolag, 5) billån och billeasing, 6) kreditkortsfordringar, 7) kundfordringar, 8) andra underliggande exponeringar som originatorn eller det medverkande institutet på grundval av interna metoder och parametrar anser utgöra en specifik tillgångstyp. | Ej tillämpligt |
| STSS11 | Ej tillämpligt | Emissionsdatum | Om ett prospekt har upprättats i enlighet med förordning (EU) 2017/1129 (4), dagen för godkännande av prospektet. I alla övriga fall, avslutsdag för den senaste transaktionen. | Ej tillämpligt |
| STSS12 | Ej tillämpligt | Datum för anmälan | Dag för anmälan till Esma | Ej tillämpligt |

▼ **B**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|-------------|-------------------------------------|--|---|-------------------------|
| STSS13 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten. | Ej tillämpligt |
| STSS14 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsland. | Ej tillämpligt |
| STSS15 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet. | Ej tillämpligt |
| STSS16 | Artikel 27.5 | STS-status | En motiverad anmälan från originatorn och det medverkande institutet om att värdepapperiseringen inte längre är att anse som STS. | Ej tillämpligt |
| ▼ M1 | | | | |
| STSS17 | Artikel 27.3 | Originatorn (eller den ursprungliga långgivaren) är ett kreditinstitut | Angivelse av ”ja” eller ”nej” gällande huruvida originatorn eller den ursprungliga långgivaren är ett kreditinstitut eller ett värdepappersföretag som är etablerat i unionen. | Ej tillämpligt |
| ▼ B | | | | |
| STSS18 | Artikel 27.3 | Bekräftelse avseende kriterierna för kreditgivning | Om svaret i fält STSS17 är ”nej”, bekräftelse på att originatorns eller den ursprungliga långgivarens kriterier, förfaranden och system för kreditgivning tillämpas i enlighet med artikel 9 i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSS19 | Artikel 27.3 | Bekräftelse på att kreditgivningen inte är föremål för tillsyn. | Om svaret i fält STSS17 är ”nej”, bekräftelse på att kreditgivningen enligt artikel 27.3 a i förordning (EU) 2017/2402 är föremål för tillsyn. | Ej tillämpligt |

⁽¹⁾ Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

⁽²⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 av den 14 mars 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1129 vad gäller formatet på, innehållet i och granskningen och godkännandet av de prospekt som ska offentliggöras när värdepapper erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel på en reglerad marknad, och om upphävande av kommissionens förordning (EG) nr 809/2004 (EUT L 166, 21.6.2019, s. 26).

⁽³⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224 av den 16 oktober 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 vad gäller tekniska tillsynsstandarder om information och detaljerade uppgifter om en värdepapperisering som ska tillgängliggöras av originatorn, det medverkande institutet och specialföretaget för värdepapperisering (EUT L 289, 3.9.2020, s. 1).

⁽⁴⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1129 av den 14 juni 2017 om prospekt som ska offentliggöras när värdepapper erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel på en reglerad marknad, och om upphävande av direktiv 2003/71/EG (EUT L 168, 30.6.2017, s. 12).

▼ B

Specifik information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSS20 | Artikel 20.1 | Överföring av de underliggande exponeringarna genom äkta värdepapperisering (true sale) eller överlåtelse | | √ | | En kortfattad beskrivning av hur överföringen av de underliggande exponeringarna görs genom äkta värdepapperisering eller överföring med samma rättsverkan på ett sätt som är verkställbart mot säljaren eller någon annan tredje part. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS21 | Artikel 20.2 | Omfattas av stränga clawbackbestämmelser | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida någon av de stränga clawbackbestämmelser som avses i artikel 20.2 a eller b i förordning (EU) 2017/2402 är del i värdepapperiseringen. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSS22 | Artikel 20.3 | Undantag för clawbackbestämmelser i nationell insolvenslagstiftning | √ | | | En bekräftelse av om de clawbackbestämmelser som avses i artikel 20.3 i förordning (EU) 2017/2402 är tillämpliga. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSS23 | Artikel 20.4 | Överföring om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren | √ | | | Om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren, en förklaring som bekräftar att värdepapperiseringen uppfyller kraven i artikel 20.1–20.3 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS24 | Artikel 20.5 | Överföring som sker genom en överlåtelse och fullgörs i ett senare skede. | | √ | | Om överföringen av de underliggande exponeringarna sker genom en överlåtelse och fullgörs på ett senare stadium än vid avslutandet av värdepapperiseringen, en kortfattad beskrivning av hur och huruvida fullgörelsen sker åtminstone vid de förutbestämda utlösande händelser för vilka minimikrav anges i artikel 20.5 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼ B

▼
B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| | | | | | | Om alternativa överföringsmekanismer används, en bekräftelse på att originatorns insolvens inte skulle skada eller hindra specialföretaget för värdepapperisering från att verkställa sina rättigheter. | |
| STSS25 | Artikel 20.6 | Utfästelser och garantier | | √ | | En kortfattad beskrivning av om och hur det finns utfästelser och garantier från säljarens sida om att värdepapperiseringens underliggande exponeringar inte är belastade eller på annat sätt är i ett tillstånd som skulle kunna inverka negativt på möjligheterna att verkställa den äkta värdepapperiseringen eller överlåtelsen eller överföringen med samma rättsverkan. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS26 | Artikel 20.7 | Godtagbarhetskriterier som inte medger diskretionär aktiv portföljförvaltning av de underliggande exponeringarna. | | √ | | En kortfattad beskrivning av hur — de underliggande exponeringar som överförs från eller överläts av säljaren till specialföretaget för värdepapperisering uppfyller på förhand fastställda, tydliga och dokumenterade godtagbarhetskriterier som inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa exponeringar, — urval och överföring av de underliggande exponeringarna i värdepapperiseringen grundas på tydliga processer som gör det lättare att identifiera vilka exponeringar som väljs ut för eller överförs till värdepapperiseringen, och att de inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |
| STSS27 | Artikel 20.8 | Tillgångarnas homogenitet | | | √ | En detaljerad beskrivning av homogeniteten i gruppen av underliggande exponeringar som ligger bakom värdepapperiseringen. För detta ändamål ska hänvisning göras till Europeiska bankmyndighetens tekniska tillsynsstandarder om homogenitet (kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/1851 ⁽²⁾), och en detaljerad förklaring ska ges för hur vart och ett av de villkor som anges i artikel 1 i den delegerade förordningen är uppfyllda. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSS28 | Artikel 20.9 | Underliggande exponeringars förpliktelser: ej återvärdepapperisering | √ | | | En bekräftelse på att de underliggande exponeringarna inte omfattar några värdepapperiseringspositioner och att den anmälda värdepapperiseringen därför inte är en återvärdepapperisering. | Punkt 2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS29 | Artikel 20.10 | Sunda kreditgivningsprinciper | | | √ | En detaljerad beskrivning — av huruvida de underliggande exponeringarna har sitt ursprung i långivarens normala verksamhet och om de tillämpade kreditgivningsprinciperna inte är mindre strikta än de som vid ursprungstidpunkten tillämpades på exponeringar som inte gjordes föremål för värdepapperisering, — av huruvida kreditgivningsprinciperna och alla väsentliga ändringar av tidigare kreditgivningsprinciper utan onödigt dröjsmål har redovisats eller kommer att redovisas fullt ut för potentiella investerare, — om hur, för värdepapperiseringar där de underliggande exponeringarna är bostadslån, gruppen av underliggande tillgångar uppfyller kravet i artikel 20.10 andra stycket i förordning (EU) 2017/2402, — av huruvida bedömningen av låntagarens kreditvärdighet uppfyller kraven i artikel 8 i direktiv 2008/48/EG ⁽³⁾ eller i artikel 18.1–18.4, 18.5 a och 18.6 i direktiv 2014/17/EU ⁽⁴⁾ eller, där så är tillämpligt, likvärdiga krav i tredjeländer. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS30 | Artikel 20.10 | Originators/långivares sakkunskap | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur originatorn eller den ursprungliga långivaren har sakkunskaper när det gäller att initiera exponeringar som till sin art liknar de exponeringar som värdepapperiseras. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSS31 | Artikel 20.11 | Överförda underliggande exponeringar utan fallerande exponeringar | | | √ | En detaljerad beskrivning av huruvida — de överförda underliggande exponeringarna vid tidpunkten för urvalet inte omfattar fallerade exponeringar (eller omstrukturerade exponeringar) enligt definitionen i artikel 20.11 i förordning (EU) 2017/2402, — de krav som avses i artikel 20.11 a i och ii i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda, — de krav som avses i artikel 20.11 b i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda, — de krav som avses i artikel 20.11 c i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS32 | Artikel 20.12 | Minst en betalning vid tidpunkten för överföringen | √ | | | En bekräftelse avseende huruvida gäldenärerna vid tidpunkten för överföringen av exponeringarna har gjort minst en betalning. En bekräftelse avseende huruvida undantaget enligt artikel 20.12 i förordning (EU) 2017/2402 är tillämpligt. | Punkterna 3.3 och 3.4.6 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS33 | Artikel 20.13 | Återbetalning till innehavarna får inte ha strukturerats för att främst vara beroende av försäljningen av tillgångar | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur beroende återbetalning till innehavarna av värdepapperiseringspositionen är av försäljning av tillgångar som utgör säkerhet för de underliggande exponeringarna. | Punkt 3.4.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS34 | Artikel 21.1 | Uppfyllande av kravet på bibehållande av risk | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida originatorn, det medverkande institutet eller den ursprungliga långivaren för en icke-ABCP-värdepapperisering uppfyller kravet på bibehållande av risk som fastställs i artikel 6 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.1 i bilaga 9 och 3.4.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| | | | | | | <p>Uppgift om vilken enhet som bibehåller ett väsentligt ekonomiskt intresse netto och vilket alternativ som används för att bibehålla risken:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) vertikal andel i enlighet med artikel 6.3 a i förordning (EU) 2017/2402 2) säljares andel i enlighet med artikel 6.3 b i förordning (EU) 2017/2402 3) slumpvis utvalda exponeringar som står kvar i balansräkningen i enlighet med artikel 6.3 c i förordning (EU) 2017/2402 4) tranche i första-förlustläge i enlighet med artikel 6.3 d i förordning (EU) 2017/2402 5) exponering i första-förlustläge för varje tillgång i enlighet med artikel 6.3 e i förordning (EU) 2017/2402 6) ej uppfyllda krav på bibehållande av risk enligt artikel 6.3 i förordning (EU) 2017/2402 7) andra alternativ som används | |
| STSS35 | Artikel 21.2 | Riskreducering – ränte- och valutarisker | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida ränte- och valutariskerna minskas på lämpligt sätt och att åtgärder vidtas för att minska sådana risker och bekräftelse på att sådana åtgärder är tillgängliga för investerare. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS36 | Artikel 21.2 | Derivat som köps/säljs av specialföretag för värdepapperisering | | √ | | En kortfattad angivelse av att specialföretaget för värdepapperisering inte har ingått derivatkontrakt utom i de fall som avses i artikel 21.2 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS37 | Artikel 21.2 | Derivat baserade på allmänt accepterade normer | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida de säkringsinstrument som används tecknas och dokumenteras i enlighet med allmänt accepterade normer. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|---|
| STSS38 | Artikel 21.3 | Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor | ✓ | | | En kortfattad beskrivning av hurvida och hur eventuella referensräntebetalningar för värdepapperiseringens tillgångar och skulder beräknas på grundval av normalt sett tillämpade marknadsräntor eller normalt sett tillämpade sektorsräntor som återspeglar finansieringskostnaderna. | Punkterna 2.2.2 och 2.2.13 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS39 | Artikel 21.4 | Inget kvarhållande av kontanter efter beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning | ✓ | | | En allmän angivelse om att vart och ett av kraven i artikel 21.4 i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllt. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS40 | Artikel 21.4 | a) Inga kontantbelopp ska kvarhållas | ✓ | | | Bekräftelse på att inga kontantbelopp skulle kvarhållas efter ett beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS41 | Artikel 21.4 | b) Inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet ska överföras till investerarna | ✓ | | | Bekräftelse på att inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet av de underliggande exponeringarna överförs till investerarna via sekventiell amortering av värdepapperiseringspositionerna, i enlighet med värdepapperiseringspositionernas prioritet. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS42 | Artikel 21.4 | c) Återbetalningen får inte kastas om vad gäller prioritet | ✓ | | | Bekräftelse på att återbetalningen av värdepapperiseringspositionerna inte kommer att kastas om vad gäller prioritet. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS43 | Artikel 21.4 | d) Inga bestämmelser får föreskriva automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde | ✓ | | | Bekräftelse på att det inte finns några bestämmelser som föreskriver automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|--|
| STSS44 | Artikel 21.5 | Värdepapperiseringar med en icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar | √ | | | Bekräftelse på att transaktioner som har en icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar inbegriper utlösande faktorer kopplade till resultaten för de underliggande exponeringarna som resulterar i att prioritetsordningen för betalningar återgår till sekventiella betalningar enligt prioritetsordning. Bekräftelse på att sådana utlösande faktorer åtminstone inbegriper försämring av de underliggande exponeringarnas kreditkvalitet till en nivå under ett på förhand fastställt tröskelvärde. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS45 | Artikel 21.6 | Revolverande värdepapperisering med händelser som utlöser förtida amortering för avslutande av den rullande perioden på grundval av på förhand fastställda utlösande faktorer | | √ | | En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna i artikel 21.6 a i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS46 | Artikel 21.6 a | a) försämring av kreditkvaliteten med avseende på de underliggande exponeringarna | | √ | | En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna i artikel 21.6 a i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS47 | Artikel 21.6 b | b) förekomst av en insolvensrelaterad händelse med avseende på originatorm eller serviceföretaget | | √ | | En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna eller de utlösande faktorerna i artikel 21.6 b i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS48 | Artikel 21.6 c | c) värdet av de underliggande exponeringar som innehas av specialföretaget för värdepapperisering sjunker under ett på förhand fastställt tröskelvärde | | √ | | En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna eller de utlösande faktorerna i artikel 21.6 c i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen, med användning av korshänvisningar till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentationen där informationen finns. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|--|
| STSS49 | Artikel 21.6 d | d) det har inte kunnat genereras tillräckligt med nya underliggande exponeringar som uppfyller den förutfastställda kreditkvaliteten (utlösande händelse för avslutande av den rullande perioden) | | √ | | En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna i artikel 21.6 d i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS50 | Artikel 21.7 a | a) Information om avtalsförpliktelser för serviceföretaget, trustförvaltare och annan tillhandahållare av sidotjänster. | √ | | | Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen anger alla krav enligt artikel 21.7 a i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS51 | Artikel 21.7 b | b) Bestämmelser om servicekontinuitet | √ | | | Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen uttryckligen uppfyller alla krav i artikel 21.7 b i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS52 | Artikel 21.7 c | Bestämmelser om kontinuitet hos derivatmotparter | √ | | | Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen innehåller all den information som avses i artikel 21.7 c i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS53 | Artikel 21.7 c | c) Bestämmelser om kontinuitet hos likviditetstillhandahållare och kontoförande bank | √ | | | Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen innehåller all information enligt artikel 21.7 c i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS54 | Artikel 21.8 | Erforderlig sakkunskap hos serviceföretaget, och riktlinjer och adekvata förfaranden och kontroller för riskhantering | | | √ | Detaljerad beskrivning av hur kraven i artikel 21.8 uppfylls. I beskrivningen ska ingå hänvisningar till riktlinjer och förfaranden som är avsedda att säkerställa att kraven uppfylls. | Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|--|
| STSS55 | Artikel 21.9 | Klara och entydiga definitioner vad gäller behandlingen av problematiska lån | √ | | | En bekräftelse på att den underliggande dokumentationen klart och entydigt anger definitioner, korrigering åtgärder och andra åtgärder avseende de skuldsituationer som anges i artikel 21.9 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS56 | Artikel 21.9 | Prioritetsordningar för betalningar och utlösande händelser | √ | | | Bekräftelse på att värdepapperiseringens dokumentation fastställer prioritetsordningarna för betalningar och utlösande händelser i enlighet med artikel 21.9 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.4.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS57 | Artikel 21.10 | Snabb lösning av konflikter mellan olika kategorier av investerare och trustförvaltarens skyldigheter | √ | | | Bekräftelse på att bestämmelserna i artikel 21.10 i förordning (EU) 2017/2402 om snabb konfliktlösning är uppfyllda. | Punkterna 3.4.7 och 3.4.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS58 | Artikel 22.1 | Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster | √ | | | Bekräftelse på att de uppgifter som krävs enligt artikel 22.1 i förordning (EU) 2017/2402 finns tillgängliga, med tydlig angivelse av var informationen finns. | Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSS59 | Artikel 22.2 | Extern kontroll av ett urval av de underliggande exponeringarna | √ | | | En bekräftelse på att ett urval av de underliggande exponeringarna har varit föremål för extern kontroll av en lämplig och oberoende part innan värdepappren emitteras. | Ej tillämpligt |
| STSS60 | Artikel 22.3 | Kassaflödesmodell för skulder tillgänglig för potentiella investerare | √ | | | Bekräftelse på att en kassaflödesmodell för skulder är tillgänglig för potentiella investerare före prissättningen med tydlig angivelse av var informationen finns. Efter prissättning, bekräftelse på att sådan information har gjorts tillgänglig för potentiella investerare på begäran. | Ej tillämpligt |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSS61 | Artikel 22.4 | Offentliggörande av miljöprestandan hos underliggande exponeringar i form av bostadslån, billån eller billeasing | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida informationen om miljöprestanda för tillgångar som finansieras genom bostadslån, eller billån eller billeasing finns tillgänglig i enlighet med artikel 7.1 a i förordning (EU) 2017/2402, och uppgift om var informationen finns. | Ej tillämpligt |
| STSS62 | Artikel 22.5 | Originatorns och det medverkande institutets ansvar för efterlevnaden av artikel 7 | √ | | | Bekräftelse på att — originatorn och det medverkande institutet följer artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402, — den information som krävs enligt artikel 7.1 a på begäran har gjorts tillgänglig för potentiella investerare före prissättningen, — den information som krävs enligt artikel 7.1 b-d har gjorts tillgänglig före prissättningen, åtminstone i form av ett utkast eller i sin ursprungliga form. | Ej tillämpligt |

⁽¹⁾ Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

⁽²⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/1851 av den 28 maj 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 vad gäller tekniska tillsynsstandarder för homogenitet i de underliggande exponeringarna i värdepapperisering (EUT L 280, 6.11.2019, s. 1).

⁽³⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2008/48/EG av den 23 april 2008 om konsumentkreditavtal och om upphävande av rådets direktiv 87/102/EEG (EUT L 133, 22.5.2008, s. 66).

⁽⁴⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/17/EU av den 4 februari 2014 om konsumentkreditavtal som avser bostadsfastighet och om ändring av direktiven 2008/48/EG och 2013/36/EU och förordning (EU) nr 1093/2010 (EUT L 60, 28.2.2014, s. 34).

▼ **B**

BILAGA II

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artikel 24 i förordning (EU) 2017/2402 avseende ABCP-värdepapperisering

Allmän information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|-------------|-------------------------------------|--|---|---|
| STSAT0 | Artikel 27.1 | Första kontaktpunkt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten, och namnet på den relevanta behöriga myndigheten | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT1 | Ej tillämpligt | Instrumentets identifieringskod | Om tillgängligt, ISIN-kod(er) (internationellt standardnummer för värdepapper) Om det inte finns någon ISIN-kod, anges varje annat unikt nummer värdepapper som har tilldelats denna ABCP-värdepapperisering. | Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |
| STSAT2 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) | Om tillgänglig, LEI-kod för originator(er) och/eller medverkande institut. | Punkt 4.2 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT3 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för anmälan | Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan. | Ej tillämpligt |
| ▼ M1 | | | | |
| STSAT4 | Ej tillämpligt | Unik identifieringskod | Den unika identifieringskod som tilldelats av den rapporterande enheten i enlighet med artikel 11.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224. Om mer än en STS-anmälan görs med hjälp av denna unika identifieringskod för värdepapperiseringar ska en förklaring lämnas om skälen till detta. | Ej tillämpligt |
| ▼ B | | | | |
| STSAT5 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för prospektet | Om tillgänglig, den identifieringskod för prospektet som tillhandahålls av den relevanta behöriga myndigheten. | Ej tillämpligt |
| STSAT6 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringsregister | Om tillgängligt, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret. | Ej tillämpligt |
| STSAT7 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringens beteckning | Om tillgängligt, värdepapperiseringens beteckning eller, om sådan inte finns, kodbeteckning och använt namn. | Avsnitt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|--|-------------------------|
| STSAT8 | Artiklarna 18 och 27.3 | Etableringsland | Om tillgängligt, etableringsland för originator(er), medverkande institut och specialföretag för värdepapperisering. | Ej tillämpligt |
| STSAT9 | Ej tillämpligt | Klassificering av värdepapperiseringen | Typ av värdepapperisering: — värdepapperisering som inte är ABCP — ABCP-värdepapperisering — ABCP-program | Ej tillämpligt |
| STSAT10 | Ej tillämpligt | Klassificering av underliggande exponeringar | Typ av underliggande exponeringar, inklusive 1. bostadslån som antingen har ett eller flera pantbrev på bostadsfastigheter som säkerhet eller som garanteras fullt ut av en sådan godtagbar utfärdare av kreditskydd som avses i artikel 201.1 i förordning (EU) nr 575/2013 och som uppfyller kraven för kreditkvalitetssteg 2 eller högre i enlighet med del tre avdelning II kapitel 2 i den förordningen, 2. kommersiella lån med ett eller flera pantbrev på kommersiella fastigheter som säkerhet, inbegripet kontor eller andra kommersiella lokaler, 3. kreditfaciliteter till privatpersoner för den personens, familjens eller hushållets konsumtion, 4. kreditfaciliteter, inklusive lån och leasingavtal, som ges till alla typer av företag eller bolag, 5. billån och billeasing, 6. kreditkortsfordringar, 7. kundfordringar, 8. andra underliggande exponeringar som originatorn eller det medverkande institutet på grundval av interna metoder och parametrar anser utgöra en specifik tillgångstyp. | Ej tillämpligt |
| STSAT11 | Ej tillämpligt | Emissionsdatum | Om ett prospekt har upprättats i enlighet med förordning (EU) 2017/1129, dagen för godkännande av prospektet. Om inte, emissionsdag för ABCP-värdepapperiseringen. | Ej tillämpligt |
| STSAT12 | Ej tillämpligt | Datum för anmälan | Dag för anmälan till Esma | Ej tillämpligt |

▼ **B**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|-------------|-------------------------------------|--|---|-------------------------|
| STSAT13 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten. | Ej tillämpligt |
| STSAT14 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsland. | Ej tillämpligt |
| STSAT15 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i värdepapperiseringsförordningen, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet.. | Ej tillämpligt |
| STSAT16 | Artikel 27.5 | STS-status | Om originatorn och/eller det medverkande institutet har anmält att ABCP-värdepapperiseringen inte längre är att anse som STS och skälen till detta. | Ej tillämpligt |
| ▼ M1 | | | | |
| STSAT17 | Artikel 27.3 | Originatorn (eller den ursprungliga långgivaren) är ett kreditinstitut | Angivelse av ”ja” eller ”nej” gällande huruvida originatorn eller den ursprungliga långgivaren är ett kreditinstitut eller ett värdepappersföretag som är etablerat i unionen. | Ej tillämpligt |
| ▼ B | | | | |
| STSAT18 | Artikel 27.3 | Bekräftelse avseende kriterierna för kreditgivning | Om svaret i fält STSS17 är ”nej”, bekräftelse på att originatorns eller den ursprungliga långgivarens kriterier, förfaranden och system för kreditgivning tillämpas i enlighet med artikel 9 i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSAT19 | Artikel 27.3 | Bekräftelse på att kreditgivningen inte är föremål för tillsyn. | Om svaret i fält STSS17 är ”nej”, bekräftelse på att kreditgivningen enligt artikel 27.3 a i förordning (EU) 2017/2402 är föremål för tillsyn. | Ej tillämpligt |

⁽¹⁾ Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

▼ B

Specifik information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekr <input type="checkbox"/> Ifølge | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|--------------------------------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSAT20 | Artikel 24.1 | Underliggande exponeringar som förvärvats genom äkta värdepapperisering (true sale) | | √ | | En kortfattad beskrivning av hur överföringen av de underliggande exponeringarna görs genom äkta värdepapperisering eller överföring med samma rättsverkan på ett sätt som är verkställbart mot säljaren eller någon annan tredje part. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT21 | Artikel 24.2 | Omfattas av stränga clawbackbestämmelser | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida någon av de stränga clawbackbestämmelser som avses i artikel 24.2 a eller b i förordning (EU) 2017/2402 är del i värdepapperiseringen. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT22 | Artikel 24.3 | Undantag för clawbackbestämmelser i nationell insolvenslagstiftning | √ | | | En bekräftelse av om det undantag som avses i artikel 24.3 i förordning (EU) 2017/2402 är tillämpligt. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT23 | Artikel 24.4 | Överföring om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren | √ | | | Om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren, en förklaring som bekräftar att värdepapperiseringen uppfyller kraven i artikel 24.1–24.3 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT24 | Artikel 24.5 | Överföring som sker genom en överlåtelse och fullgörs i ett senare skede. | | √ | | Om överföringen av de underliggande exponeringarna sker genom en överlåtelse och fullgörs på ett senare stadium än vid avslutandet av värdepapperiseringen, en kortfattad beskrivning av hur och huruvida fullgörelsen sker åtminstone vid de förutbestämda utlösande händelser för vilka minimikrav anges i artikel 24.5 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼ B

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSAT25 | Artikel 24.6 | Utfästelser och garantier | | √ | | En kortfattad beskrivning av om det finns utfästelser och garantier från säljarens sida om att värdepapperiseringens tillgångar inte är belastade eller på annat sätt är i ett tillstånd som skulle kunna inverka negativt på möjligheterna att verkställa den äkta värdepapperiseringen eller överlåtelsen eller överföringen med samma rättsverkan. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT26 | Artikel 24.7 | Godtagbarhets-kriterier som inte medger diskretionär aktiv portföljförvaltning av de underliggande exponeringarna. | | √ | | En kortfattad beskrivning av om — de underliggande exponeringar som överförs från eller överläts av säljaren till specialföretaget för värdepapperisering uppfyller på förhand fastställda, tydliga och dokumenterade godtagbarhetskriterier som inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa exponeringar, — urval och överföring av de underliggande exponeringarna i värdepapperiseringen grundas på tydliga processer som gör det lättare att identifiera vilka exponeringar som väljs ut för eller överförs till värdepapperiseringen, och att de inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |
| STSAT27 | Article 24.8 | Ej återvärdepapperisering | √ | | | Bekräftelse på att de underliggande exponeringarna inte omfattar några värdepapperiseringspositioner och att den anmälda värdepapperiseringen därför inte är en återvärdepapperisering. | Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT28 | Artikel 24.9 | Överförda underliggande exponeringar utan fallerade exponeringar | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur de överförda underliggande exponeringarna vid tidpunkten för urvalet inte omfattar fallerade exponeringar eller omstrukturerade exponeringar enligt vad som anges i artikel 24.9 i förordning (EU) 2017/2402, beroende på vad som är tillämpligt. Om relevant, en tydlig angivelse av huruvida värdepapperiseringen berörs | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| | | | | | | av nedsatt kreditvärdighet vid tidpunkten för värdepapperiseringen enligt vad som anges i artikel 24.9 a i i förordning (EU) 2017/2402. Bekräftelse på att — de krav som avses i artikel 24.9 b i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda vid ursprungstidpunkten, — de krav som avses i artikel 24.9 c i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda vid urvalstidpunkten. | |
| STSAT29 | Artikel 24.10 | Minst en betalning vid tidpunkten för överföringen | √ | | | Bekräftelse avseende huruvida gäldenärerna vid tidpunkten för överföringen av exponeringarna har gjort minst en betalning. Om ingen betalning har gjorts, en förklaring till detta tillsammans med en angivelse av om skälet är ett av de undantag som tillåts enligt artikel 20.12 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkterna 3.3 och 3.4.6 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT30 | Artikel 24.11 | Återbetalning till innehavarna får inte ha strukturerats för att främst vara beroende av försäljningen av tillgångar | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur beroende återbetalning till innehavarna av värdepapperiseringspositionen är av försäljning av tillgångar som utgör säkerhet för de underliggande exponeringarna. Om relevant, en detaljerad beskrivning av huruvida återbetalning till investerarna inte anses vara beroende av försäljningen av tillgångar i enlighet med artikel 24.11 andra stycket i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.4.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT31 | Artikel 24.12 | Riskreducering – ränte- och valutarisker | | | √ | En kortfattad beskrivning av huruvida och hur ränte- och valutarisker minskas på lämpligt sätt och bekräftelse på att åtgärderna offentliggörs. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|--|
| | | | | | | En kortfattad beskrivning av huruvida de säkringsinstrument som används tecknas och dokumenteras i enlighet med allmänt accepterade normer. | |
| STSAT32 | Artikel 24.12 | Derivat som köps/säljs av specialföretag för värdepapperisering | | √ | | Med undantag för syftet att säkra ränte- eller valutarisk, en kortfattad beskrivning av huruvida specialföretaget för värdepapperisering inte har ingått derivatkontrakt. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT33 | Artikel 24.12 | Derivat i underliggande exponeringar | | √ | | En kortfattad beskrivning av förekomsten av derivat i gruppen av underliggande exponeringar. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT34 | Artikel 24.12 | Derivat baserade på allmänt accepterade normer | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida derivat som är tillåtna enligt artikel 24.12 tecknas och dokumenteras i enlighet med allmänt accepterade normer i den internationella finansvärlden. | Punkterna 3.4.7 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT35 | Artikel 24.13 | Klara och entydiga definitioner vad gäller behandlingen av problematiska lån | √ | | | En bekräftelse på att den underliggande dokumentationen klart och entydigt anger definitioner, korrigerande åtgärder och andra åtgärder avseende de skuldsituationer som anges i artikel 24.13 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT36 | Artikel 24.13 | Prioritetsordningar för betalningar och utlösande händelser | √ | | | Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen fastställer prioritetsordningarna för betalningar och utlösande händelser i enlighet med artikel 24.13 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkterna 3.4.7 och 3.4.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT37 | Artikel 24.14 | Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster | √ | | | Bekräftelse på att de uppgifter som krävs enligt artikel 24.14 i förordning (EU) 2017/2402 finns tillgängliga, med tydlig angivelse av var informationen finns tillgänglig för potentiella investerare före prissättningen. | Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼ B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| | | | | | | I de fall där det medverkande institutet inte har tillgång till sådana uppgifter, en bekräftelse på att säljaren har gett tillgång till uppgifter enligt vad som anges i artikel 24.14 i förordning (EU) 2017/2402. Bekräftelse på att uppgifterna finns tillgängliga och tydligt angivelse av var informationen finns tillgänglig och att uppgifterna täcker en period på minst fem år, med undantag för uppgifter om kundfordringar och andra kortfristiga fordringar, för vilka historiken ska omfatta minst tre år. | |
| STSAT38 | Artikel 24.15 | Tillgångarnas homogenitet | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur värdepapperiseringen baseras på en grupp av underliggande exponeringar som är homogena med beaktande av kännetecknen för olika tillgångstypers kassaflöden, inbegripet kännetecknen med avseende på avtal, kreditrisk och förskottsbetalning. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT39 | Artikel 24.15 | Underliggande exponeringars förpliktelser | √ | | | Bekräftelse på att gruppen av underliggande exponeringar har en återstående vägd genomsnittlig livslängd på högst ett år och att ingen av de underliggande exponeringarna har en återstående löptid på mer än tre år. Bekräftelse av huruvida undantaget för grupper av billån, billeasing eller transaktioner avseende leasing av utrustning tillämpas, i enlighet med artikel 24.15 tredje stycket i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT40 | Artikel 24.15 | Underliggande exponeringars förpliktelser | √ | | | Om relevant, bekräftelse på att de underliggande exponeringarna | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| | | | | | | <ul style="list-style-type: none"> — inte omfattar lån som har bostadslån eller lån på kommersiella fastigheter som säkerhet eller bostadslån som garanteras fullt ut enligt artikel 129.1 första stycket i förordning (EU) nr 575/2013 ⁽²⁾, — innehåller avtalsmässigt bindande och verkställbara förpliktelser med full regressrätt mot gäldenären med fastställda betalningsflöden som hänför sig till hyra, kapitalbelopp och räntebetalningar eller till någon annan rätt till inkomst från tillgångar som berättigar till sådana betalningar, — inte omfattar överlåtbara värdepapper enligt definitionen i artikel 4.1.44 i direktiv 2014/65/EU ⁽³⁾, med undantag av företagsobligationer som inte är noterade på en handelsplats. | |
| STSAT41 | Artikel 24.16 | Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida och hur eventuella referensräntebetalningar för ABCP-värdepapperiseringens tillgångar och skulder beräknas på grundval av normalt sett tillämpade marknadsräntor eller normalt sett tillämpade sektorsräntor som återspeglar finansieringskostnaderna. | Punkterna 2.2.2 och 2.2.13 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |
| STSAT42 | Artikel 24.17 | Inget kvarhållande av kontanter efter beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida vart och ett av kraven i artikel 24.17 i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllt, inbegripet en kortfattad förklaring av situationer då kontantbelopp kan kvarhållas. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT43 | Artikel 24.17 | a) Inget kvarhållande av kontanter efter verkställighet eller påskyndad betalning | √ | | | Bekräftelse på att inga kontantbelopp skulle kvarhållas efter ett beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼ B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSAT44 | Artikel 24.17 | b) Inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet ska överföras till investerarna | √ | | | Bekräftelse på att inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet av de underliggande exponeringarna överförs till investerarna via sekventiell amortering av värdepapperiseringspositionerna, i enlighet med värdepapperiseringspositionernas prioritet. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT45 | Artikel 24.17 | c) Inga bestämmelser får föreskriva automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde | √ | | | Bekräftelse på att det inte finns några bestämmelser som föreskriver automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT46 | Artikel 24.18 | Sunda kreditgivningsprinciper | | | √ | Bekräftelse av huruvida de underliggande exponeringarna har sitt ursprung i säljarens normala verksamhet, med angivelse av huruvida kreditgivningsprinciperna inte är mindre strikta än de som tillämpades på exponeringar som inte gjordes föremål för värdepapperisering, En detaljerad beskrivning av huruvida alla väsentliga ändringar av tidigare kreditgivningsprinciper utan onödigt dröjsmål har redovisats för det medverkande institutet och andra parter som är direkt exponerade mot ABCP-värdepapperiseringen. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT47 | Artikel 24.18 | Säljarens sakkunskap | | | √ | En detaljerad beskrivning av huruvida säljaren har nödvändiga sakkunskaper när det gäller att initiera exponeringar av liknande typ som de som värdepapperiseras. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT48 | Artikel 24.19 | Revolverande ABCP-värdepapperisering/utlösande faktor för kreditkvalitet | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur bestämmelserna eller de utlösande faktorerna i artikel 24.19 i förordning (EU) 2017/2402 återfinns i värdepapperiseringsdokumentationen. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|--|
| STSAT49 | Artikel 24.20 | Uppgifter som åligger värdepappersiseringsparter | √ | | | Bekräftelse på att värdepappersiseringsdokumentationen innehåller avtalsförpliktelser, uppgifter och skyldigheter för det medverkande institutet, serviceföretaget och, i förekommande fall, trustförvaltaren och annan tillhandahållare av sidotjänster. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT50 | Artikel 24.20 | Bestämmelser om servicekontinuitet | √ | | | Bekräftelse på att värdepappersiseringsdokumentationen innehåller de processer och skyldigheter som krävs för att säkerställa att förvaltningen av exponeringarna inte upphör om serviceföretaget fallerar eller blir insolvent. | Punkt 3.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT51 | Artikel 24.20 | Bestämmelser om kontinuitet hos derivatmotpart och konförendande bank | √ | | | Bekräftelse på att värdepappersiseringsdokumentationen innehåller bestämmelser som säkerställer att derivatmotpart och konförendande bank byts ut vid fallissemang, insolvens och i tillämpliga fall vissa andra angivna händelser. | Punkt 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAT52 | Artikel 24.20 | Det medverkande institutets kvalitet | √ | | | Bekräftelse på att värdepappersiseringsdokumentationen innehåller bestämmelser om hur det medverkande institutet uppfyller kraven i artikel 25.3 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

⁽¹⁾ Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

⁽²⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 av den 26 juni 2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 (EUT L 176, 27.6.2013, s. 1).

⁽³⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

▼ **B**

BILAGA III

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artikel 25 och 26 i förordning (EU) 2017/2402 avseende ABCP-program

Allmän information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|-----------------------|-------------------------------------|--|--|---|
| STSAP0 | Artikel 27.1 | Första kontaktpunkt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten, och namnet på den relevanta behöriga myndigheten | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAP1 | Ej tillämpligt | Instrumentets identifieringskod | Om relevant, ISIN-koder (internationellt standardnummer för värdepapper) som tilldelats ABCP-programmen. | Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980. |
| STSAP2 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) | Om tillgänglig, LEI-kod för medverkande institut och/eller ABCP-program. | Punkt 4.2 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAP3 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för anmälan | Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan. | Ej tillämpligt |
| ▼ M1 STSAP4 | Ej tillämpligt | Unik identifieringskod | Den unika identifieringskod som tilldelats av den rapporterade enheten i enlighet med artikel 11.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224. Om mer än en STS-anmälan görs med hjälp av denna unika identifieringskod för värdepapperiseringar ska en förklaring lämnas om skälen till detta. | Ej tillämpligt |
| ▼ B STSAP5 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för prospektet | Om tillgänglig, den identifieringskod för prospektet som tillhandahålls av den relevanta behöriga myndigheten. | Ej tillämpligt |
| STSAP6 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringsregister | Om tillgängligt, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret. | Ej tillämpligt |
| STSAP7 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringens beteckning | ABCP-programmets beteckning | Avsnitt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAP8 | Artiklarna 18 och 27.3 | Etableringsland | Det medverkande institutets etableringsland | Punkt 4.3 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|---|---|
| STSAP9 | Ej tillämpligt | Klassificering av värdepapperiseringen | Typ av värdepapperisering (icke-ABCP, ABCP, ABCP-program) | Ej tillämpligt |
| STSAP10 | Ej tillämpligt | Emissionsdag | Datum för den första emissionen av ABCP-programmet | Punkt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |
| STSAP11 | Ej tillämpligt | Datum för anmälan | Dag för STS-anmälan till Esma | Ej tillämpligt |
| STSAP12 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlits för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten. | Ej tillämpligt |
| STSAP13 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlits för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsort. | Ej tillämpligt |
| STSAP14 | Artikel 27.2 | Tredje part med tillstånd | Om en tredje part med tillstånd har anlits för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet.. | Ej tillämpligt |
| STSAP15 | Artikel 27.5 | STS-status | Anmälan från det medverkande institutet att ABCP-programmet inte längre är att anse som STS och skälen till denna ändring. | Ej tillämpligt |

⁽¹⁾ Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSAP16 | Artikel 25.1 | Medverkande institut ska vara ett kreditinstitut under tillsyn | √ | | | Bekräftelse på att det medverkande institutet för programmet är ett kreditinstitut som står under tillsyn, och en länk till en handling som styrker denna status. | Ej tillämpligt |

▼ B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|--|
| STSAP17 | Artikel 25.2 | Stöd från det medverkande institutet genom tillhandahållande av likviditets-faciliteter | √ | | | Bekräftelse på att det medverkande institutet för ABCP-programmet tillhandahåller en likviditetsfacilitet och att det stöder alla värdepapperiseringspositioner i ABCP-programmet, inbegripet en beskrivning av likviditetsfaciliteten och länk till en handling som styrker detta tillhandahållande. | Ej tillämpligt |
| STSAP18 | Artikel 25.3 | Uppvisande för kreditinstitutets behöriga myndighet | √ | | | Bekräftelse på att kreditinstitutets roll som medverkande institut inte äventyrar dess solvens och likviditet, och en länk, om tillgänglig, till den handling som styrker att det har visat upp sin ställning för sin behöriga myndighet. | Ej tillämpligt |
| STSAP19 | Artikel 25.4 | Det medverkande institutets efterlevnad av kraven på due diligence | √ | | | Bekräftelse på att det medverkande institutet efterlever de krav på due diligence som anges i artikel 5.1 och 5.3 i förordning (EU) 2017/2402, beroende på vad som är tillämpligt. Bekräftelse på att det medverkande institutet har kontrollerat att säljaren har nödvändig förmåga att förvalta lånebetalning och förfaranden för indrivning som uppfyller kraven i artikel 265.2 i-p i förordning (EU) nr 575/2013 eller likvärdiga krav i tredjeländer. | Ej tillämpligt |
| STSAP20 | Artikel 25.5 | Säljaren – på transaktionsnivå – eller det medverkande institutet – på ABCP-programnivå – ska uppfylla kravet på bibehållande av risk i artikel 6. | | √ | | En kortfattad beskrivning av hur säljaren – på transaktionsnivå – och det medverkande institutet – på ABCP-programnivå – uppfyller kravet på bibehållande av risk i artikel 6 i förordning (EU) 2017/2402 med uppgift om vilket alternativ som används för att behålla risken, inklusive 1) vertikal andel i enlighet med artikel 6.3 a i förordning (EU) 2017/2402, 2) säljares andel i enlighet med artikel 6.3 b i förordning (EU) 2017/2402, | Punkt 3.4.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

▼ B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| | | | | | | 3) slumpvis utvalda exponeringar som står kvar i balansräkningen i enlighet med artikel 6.3 c i förordning (EU) 2017/2402, 4) tranche i första-förlustläge i enlighet med artikel 6.3 d i förordning (EU) 2017/2402, 5) exponering i första-förlustläge för varje tillgång i enlighet med artikel 6.3 e i förordning (EU) 2017/2402, 6) ej uppfyllda krav på bibehållande av risk enligt förordning (EU) 2017/2402, 7) andra. | |
| STSAP21 | Artikel 25.6 | Efterlevnad på ABCP-programnivå av artikel 7 (transparenskrav) | √ | | | Bekräftelse på att — det medverkande institutet följer artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402, — det medverkande institutet följer artikel 7 på ABCP-programnivå, — det medverkande institutet har, på begäran och före prissättning, gjort följande tillgängligt för potentiella investerare: de samlade uppgifter som krävs i enlighet med artikel 7.1 a första stycket i förordning (EU) 2017/2402 och de uppgifter som krävs i enlighet med artikel 7.1 första stycket b–e, åtminstone i form av ett utkast eller i sin ursprungliga form. | Ej tillämpligt |
| STSAP22 | Artikel 25.7 | Utnyttjade av likviditetsfaciliteten, där finansieringsåtagandena för likviditetsfaciliteten inte förnyas av sponsorn | | √ | | En kortfattad beskrivning från det medverkande institutet av huruvida likviditetsfaciliteten kommer att utnyttjas och värdepapper som förfaller återbetalas om det medverkande institutet inte förnyar finansieringsåtagandet för likviditetsfaciliteten innan det löper ut. | Ej tillämpligt |



| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|--|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSAP23 | Artikel 26.1 | Efterlevnad av kraven i artikel 24.1–24.8 och 24.12–24.20 för ABCP-värdepapperiseringar inom ramen för ett ABCP-program | √ | | | Bekräftelse av huruvida alla ABCP-värdepapperiseringar inom programmet uppfyller följande krav: — Artikel 24.1–24.8 i förordning (EU) 2017/2402. — Artikel 24.12–24.20 i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSAP24 | Artikel 26.1 andra och tredje styckena | Högst 5 % av det sammanlagda beloppet för ABCP-värdepapperiseringarnas underliggande exponeringar får tillfälligt vara oförenligt med vissa krav | | | √ | En detaljerad beskrivning av vilket, om så är fallet, av kraven i artikel 24.9, 24.10 eller 24.11 i förordning (EU) 2017/2402 som tillfälligt inte efterlevs, vilken procentandel av det sammanlagda beloppet av de underliggande exponeringarna för ABCP-värdepapperiseringarna det rör sig om och varför programmet tillfälligt inte efterlever kraven. En bekräftelse på att ett urval av de underliggande exponeringarna har varit föremål för regelbunden extern efterlevnadskontroll av en lämplig och oberoende part. | Ej tillämpligt |
| STSAP25 | Artikel 26.2 | Den återstående vägda genomsnittliga livslängden (WAL) för de underliggande exponeringarna för ett ABCP-program ska vara högst två år | √ | | | Bekräftelse på att den återstående vägda genomsnittliga livslängden för de underliggande exponeringarna för ett ABCP-program är högst två år. | Ej tillämpligt |
| STSAP26 | Artikel 26.3 | Fullt stöd till ABCP-program (stöd av medverkande institut) | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida ABCP-programmet fullt ut stöds av ett medverkande institut i enlighet med artikel 25.2 i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSAP27 | Artikel 26.4 | Ingen återvärdepapperisering och ingen kreditförstärkning som inför ett andra skikt med trancher på ABCP-programnivå | √ | | | Bekräftelse på att ABCP-programmet inte innehåller någon återvärdepapperisering och att kreditförstärkningen inte inför något andra skikt med trancher på programnivå. | Ej tillämpligt |

▼B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSAP28 | Artikel 26.5 | Inga köpoptioner | √ | | | En bekräftelse på att ABCP-programmet inte omfattar köpoptioner eller klausuler som påverkar värdepapprenas sista förfallodag om det står säljaren, det medverkande institutet eller specialföretaget för värdepapperisering fritt att utnyttja sådana. | Ej tillämpligt |
| STSAP29 | Artikel 26.6 | Ränte- och valutarisker på ABCP-programnivå lämpligt minskade och dokumenterade | | | √ | En detaljerad beskrivning av huruvida och hur de ränte- och valutarisker som finns på ABCP-programnivå minskas på lämpligt sätt och av vilka åtgärder som vidtagits för att minska dessa risker, inklusive om specialföretaget för värdepapperisering ingår derivatkontrakt i andra syften än vad som anges i artikel 26.6 i förordning (EU) 2017/2402, och en beskrivning av hur dessa derivat tecknas och dokumenteras, särskilt huruvida det sker i enlighet med allmänt accepterade normer i den internationella finansvärlden. | Ej tillämpligt |
| STSAP30 | Artikel 26.7 a | Krav på ABCP-programmets dokumentation (trustförvaltarens ansvar gentemot investerarna) | √ | | | Bekräftelse på att de skyldigheter som trustförvaltaren och andra enheter med förvaltaruppdrag, i förekommande fall, har gentemot investeraren anges i ABCP-programmets dokumentation. | Ej tillämpligt |
| STSAP31 | Artikel 26.7 b | Krav på ABCP-programmets dokumentation (det medverkande institutets avtalsförpliktelser) | √ | | | Bekräftelse på att avtalsförpliktelser, uppgifter och skyldigheter för det medverkande institutet, trustförvaltaren och andra tillhandahållare av sidotjänster, i förekommande fall, anges i ABCP-programmets dokumentation. | Ej tillämpligt |
| STSAP32 | Artikel 26.7 c | Krav på ABCP-programmets dokumentation (processer och skyldigheter vid serviceföretagets fallissemang) | √ | | | Bekräftelse på att ABCP-programmets dokumentation innehåller processer och skyldigheter om serviceföretaget fallerar eller blir insolvent, för att säkerställa servicekontinuitet. | Ej tillämpligt |

▼ B

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (1) | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSAP33 | Artikel 26.7 d | Krav på ABCP-programmets dokumentation (bestämmelser om utbyte av derivatmotparter och konstoförande bank) | √ | | | Bekräftelse på att kraven enligt artikel 26.7 d i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda vad gäller bestämmelserna om att derivatmotparter och konstoförande bank på ABCP-programnivå byts ut vid fallissemang, insolvens och vissa andra angivna händelser om likviditetsfaciliteten inte täcker dessa händelser. | Ej tillämpligt |
| STSAP34 | Artikel 26.7 e | Krav på ABCP-programmets dokumentation (förfaranden för att säkerställa säkring av finansieringsåtagandet) | √ | | | Bekräftelse på att ABCP-programmets dokumentation innehåller förfaranden som säkerställer att avhjäljande åtgärder vidtas om vissa angivna händelser inträffar eller om det medverkande institutet fallerar eller blir insolvent, för att på lämpligt sätt antingen säkra finansieringsåtagandet eller ersätta tillhandahållaren av likviditetsfaciliteten. Angivelse av de relevanta sidorna i prospektet eller annan underliggande dokumentation som innehåller information avseende kraven i artikel 26.7 e i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSAP35 | Artikel 26.7 f | 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) | √ | | | Bekräftelse på att ABCP-programmets dokumentation innehåller bestämmelser som säkerställer att likviditetsfaciliteten ska utnyttjas och värdepapper som förfaller ska återbetalas om det medverkande institutet inte förnyar finansieringsåtagandet för likviditetsfaciliteten innan det löper ut. Angivelse av de relevanta sidorna i prospektet eller annan underliggande dokumentation som innehåller information avseende kraven i artikel 26.7 f i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |

▼ **B**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | FÄLTETS BETECKNING | Bekr <input type="checkbox"/> ftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾ | YTTERLIGARE INFORMATION |
|------------|-------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|------------------------|------------------------|--|--|
| STSAP36 | Artikel 26.8 | Serviceföretagets sakkunskap | | | √ | Detaljerad beskrivning av hur kraven i artikel 26.8 i förordning (EU) 2017/2402 uppfylls, inbegripet hänvisningar till riktlinjer och förfaranden som ska säkerställa att kraven uppfylls. Angivelse av de relevanta sidorna i prospektet eller annan underliggande dokumentation som innehåller tillämpliga beskrivningar för uppfyllandet av kraven i artikel 26.8 i förordning (EU) 2017/2402 (om tillämpligt) (serviceföretagets sakkunskap, riktlinjer, förfaranden och riskhantering). | Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 |

⁽¹⁾ Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.



BILAGA IV

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artiklarna 26b–26e i förordning (EU) 2017/2402 avseende värdepapperisering i balansräkningen

Allmän information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|---|--|---|--|
| STSSY1 | Artikel 27.1 tredje stycket | Första kontaktpunkt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten och namnet på den relevanta behöriga myndigheten | Punkt 3.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY2 | Ej tillämpligt | Datum för anmälan | Datum för anmälan till Esma | Ej tillämpligt |
| STSSY3 | Ej tillämpligt | Instrumentets identifieringskod | Om tillgängligt, ISIN-kod(er) (internationellt standardnummer för värdepapper). Om det inte finns någon ISIN-kod, ange annat unikt värdepappersnummer (inklusive kreditlänkade obligationer), om ett sådant finns tillgängligt. | Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980. |
| STSSY4 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) | Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för originator(er), medverkande institut och, om tillgängligt, ursprunglig(a) långgivare och specialföretag för värdepapperisering. | Punkt 4.2 i bilaga 9 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY5 | Artikel 31.3 | Säljare av skydd | Identifieringskod för juridiska personer (LEI), namn, etableringsland för den ursprungliga säljaren/de ursprungliga säljarna av skydd och namnet på den behöriga myndigheten. | Ej tillämpligt |
| STSSY6 | Ej tillämpligt | Identifieringskod för anmälan | Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan. | Ej tillämpligt |
| STSSY7 | Ej tillämpligt | Unik identifieringskod | Den unika identifieringskoden som tilldelats av den rapporterade enheten i enlighet med artikel 11.1 i kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224 | Ej tillämpligt |
| STSSY8 | Ej tillämpligt | Värdepapperiseringsregister | I förekommande fall, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret. | Ej tillämpligt |
| STSSY9 | Artikel 18 andra stycket och artikel 27.3 | Etableringsland | Etableringsland för originator(er), medverkande institut, ursprunglig(a) långgivare och specialföretag för värdepapperisering. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|---|-------------------------|
| STSSY10 | Ej tillämpligt | Klassificering av syntetisk värdepapperisering | Typ av syntetisk värdepapperisering: — Syntetisk värdepapperisering med förbetalt kreditriskskydd. — Syntetisk värdepapperisering med icke förbetalt kreditriskskydd. | Ej tillämpligt |
| STSSY11 | Ej tillämpligt | Syntetisk värdepapperisering med icke förbetalt kreditriskskydd. | Namn på säljaren av skyddsinstrument (statlig eller överstatlig institution med en riskvikt på 0 %) | Ej tillämpligt |
| STSSY12 | Ej tillämpligt | Kreditriskskyddsavtal som används | Typ av kreditriskskyddsavtal som används: — Kreditderivat. — Finansiella garantier. | Ej tillämpligt |
| STSSY13 | Ej tillämpligt | Klassificering av underliggande exponeringar | Typ av underliggande exponeringar, inklusive 1) Handelsfinansieringsexponeringar, 2) lån till små eller medelstora företag, 3) utlåning till konsumenter, 4) lån till stora företag, 5) blandning av lån till små och medelstora företag samt till stora företag, 6) exponeringar mot kommersiella fastigheter, 7) övriga. | Ej tillämpligt |
| STSSY14 | Ej tillämpligt | Emissionsdatum | Avslutsdag för transaktionen och, om annan, den dag skyddsavtalet träder i kraft. | Ej tillämpligt |
| STSSY15 | Artikel 27.2 andra stycket | Tredje part med tillstånd som utför kontroll – förklaring | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten. | Ej tillämpligt |
| STSSY16 | Artikel 27.2 andra stycket | Tredje part med tillstånd som utför kontroll – etableringsland | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsland. | Ej tillämpligt |
| STSSY17 | Artikel 27.2 andra stycket | Tredje part med tillstånd som utför kontroll – behörig myndighet | Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--------------------|--|-------------------------|
| STSSY18 | Artikel 27.5 | STS-status | I förekommande fall, en motiverad anmälan från originatorn om att den syntetiska värdepapperiseringen inte längre är att betrakta som en STS-värdepapperisering. | Ej tillämpligt |

Specifik information

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY19 | Artikel 26b.1 första stycket, | Originatorn är en enhet under tillsyn i unionen | √ | | | En bekräftelse av att originatorn är en enhet som är godkänd eller har tillstånd i unionen. | Ej tillämpligt |
| STSSY20 | Artikel 26b.1 andra stycket | Originatorns tillämpning av riktlinjer på exponeringar som köpts av tredje part | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de riktlinjer vad gäller kredit, indrivning, skulduppökelse och skuldbetalning som originatorn tillämpar på de exponeringar som originatorn köpt av tredje part för egen räkning och sedan värdepapperiserat inte är mindre strikta än de originatorn tillämpar på jämförbara exponeringar som inte är köpta. | Ej tillämpligt |
| STSSY21 | Artikel 26b.2 | Ursprung för underliggande exponeringar | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de underliggande exponeringarna har sitt ursprung i en del av originatorns kärnverksamhet. | Ej tillämpligt |
| STSSY22 | Artikel 26b.3 första stycket | Tillgångar i originatorns balansräkning vid transaktionens avslut | √ | | | En bekräftelse av att de underliggande exponeringarna, vid en transaktions avslut, finns i balansräkningen för originatorn eller för en enhet som ingår i samma grupp som originatorn. | Ej tillämpligt |
| STSSY23 | Artikel 26b.3 andra stycket | Gruppkategori | √ | | | Med avseende på STSSY22, fastställande av vilken av följande två grupper som är den relevanta: a) En grupp av rättsliga enheter som är föremål för konsolidering under tillsyn i enlighet med del ett avdelning II kapitel 2 i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| | | | | | | b) b) En grupp enligt definitionen i artikel 212.1 c i direktiv 2009/138/EG ⁽¹⁾ . | |
| STSSY24 | Artikel 26b.4 | Ingen ytterligare säkring av originatorns exponering | √ | | | En bekräftelse av att originatorn inte säkrar sin exponering mot kreditrisken i värdepapperiseringens underliggande exponeringar utöver det skydd som erhållits genom kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |
| STSSY25 | Artikel 26b.5 | Kreditriskskyddsavtalet uppfyller villkoren i artikel 249 i förordning (EU) nr 575/2013 | √ | | | En bekräftelse av att kreditriskskyddsavtalet följer reglerna för kreditriskreducering i artikel 249 i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |
| STSSY26 | Artikel 26b.5 | Kreditriskskyddsavtalet följer andra regler för kreditriskreducering | | √ | | Om artikel 249 i förordning (EU) nr 575/2013 inte är tillämplig, en kortfattad beskrivning av att efterlevnad av krav som inte är mindre strikta än kraven i den artikeln säkerställs. | Ej tillämpligt |
| STSSY27 | Artikel 26b.6 a | Utfästelser och garantier – äganderätt till de underliggande exponeringarna | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att originatorn eller en enhet i den grupp som originatorn ingår i har fullständig laglig och giltig äganderätt till de underliggande exponeringarna och deras anknutna rättigheter. | Ej tillämpligt |
| STSSY28 | Artikel 26b.6 b | Utfästelser och garantier – originatorn behåller kreditrisken i de underliggande tillgångarna | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier som, om originatorn är ett kreditinstitut enligt definitionen i artikel 4.1.1 i förordning (EU) nr 575/2013 eller ett försäkringsföretag enligt definitionen i artikel 13.1 i direktiv 2009/138/EG, visar att originatorn eller en enhet som omfattas av tillsynen på gruppnivå behåller kreditrisken för de underliggande exponeringarna i sin balansräkning. | Ej tillämpligt |

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2009/138/EG av den 25 november 2009 om upptagande och utövande av försäkrings- och återförsäkringsverksamhet (EUT L 335, 17.12.2009, s. 1).

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY29 | Artikel 26b.6 c | Utfästelser och garantier – exponeringars uppfyllande av godtagbarhetskriterier | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att varje underliggande exponering, vid den tidpunkt då den tas in i den värdepapperiserade portföljen, uppfyller godtagbarhetskriterierna och samtliga villkor, utom inträffandet av en sådan kredit händelse som avses i artikel 26e.1 i förordning (EU) 2017/2402, för en kreditriskskyddsbetalning, i enlighet med kreditriskskyddsavtalet i värdepapperiseringsdokumentationen. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY30 | Artikel 26b.6 d | Utfästelser och garantier – laglig och verkställbar förpliktelse för gäldenären | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att kontraktet för varje underliggande exponering, såvitt originatorn känner till, är en laglig, giltig, bindande och verkställbar förpliktelse för gäldenären att betala de belopp som är angivna i det kontraktet. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY31 | Artikel 26b.6 e | Utfästelser och garantier – kreditgivningskriterier | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att de underliggande exponeringarna överensstämmer med kreditgivningskriterier som inte är mindre strikta än de standardkreditgivningskriterier som originatorn tillämpar på liknande exponeringar som inte är värdepapperiserade. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY32 | Artikel 26b.6 f | Utfästelser och garantier – inga gäldenärer har väsentligt åsidosatt eller fallerat i fråga om sina förpliktelser | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att ingen av gäldenärerna, såvitt originatorn känner till, väsentligt har åsidosatt eller fallerat i fråga om någon av sina förpliktelser avseende en underliggande exponering vid den tidpunkt då den underliggande tillgången tas in i den värdepapperiserade portföljens exponeringar. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|---|
| STSSY33 | Artikel 26b.6 g | Utfästelser och garantier – ingen oriktig information i transaktionsdokumentationen | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att transaktionsdokumentationen, såvitt originatorn känner till, inte innehåller någon oriktig information om de underliggande exponeringarna. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY34 | Artikel 26b.6 h | Utfästelser och garantier – verkställbarhet eller möjlighet att driva in underliggande exponeringar | | √ | | En kortfattad beskrivning av originatorns utfästelser och garantier om att kontraktet mellan gäldenären och den ursprungliga långivaren avseende den underliggande exponeringen, när transaktionen avslutas eller när en underliggande exponering tas in i den värdepapperiserade portföljen, inte har ändrats på sådant sätt att det har påverkat den underliggande exponeringens verkställbarhet eller möjligheten att driva in den. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY35 | Artikel 26b.7 första stycket | Godtagbarhetskriterier som inte medger diskretionär aktiv portföljförvaltning av de underliggande exponeringarna. | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de underliggande exponeringarna uppfyller på förhand fastställda, tydliga och dokumenterade godtagbarhetskriterier som inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa exponeringar. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY36 | Artikel 26b.7 andra stycket | Undantag från förbudet mot aktiv portföljförvaltning | | √ | | I fält STSSY35, en kortfattad beskrivning av att substitution av exponeringar som inte är förenliga med gällande utfästelser eller garantier eller, om värdepapperiseringen omfattar en påfyllningsperiod, tillägg av exponeringar som uppfyller de angivna påfyllnadsvillkoren, inte ska betraktas som aktiv portföljförvaltning. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY37 | Artikel 26b.7 tredje stycket | Exponering som lagts till efter transaktionens avslutsdag uppfyller godtagbarhetskriterierna | | √ | | En kortfattad beskrivning av att varje exponering som lagts till efter transaktionens avslutsdag uppfyller godtagbarhetskriterier som inte är mindre strikta än de som tillämpades vid det ursprungliga urvalet av de underliggande exponeringarna. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY38 | Artikel 26b.7 fjärde stycket led a | Exponering är till fullo återbetalad | | √ | | Om de underliggande exponeringarna ska tas bort från transaktionen, en kortfattad beskrivning av att den till fullo har återbetalats eller på annat sätt löpt ut. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY39 | Artikel 26b.7 fjärde stycket led b | Underliggande exponeringar har avyttrats | | √ | | Om den underliggande exponeringen ska tas bort från transaktionen, en kortfattad beskrivning av att den har avyttrats inom originatorns normala affärsverksamhet, förutsatt att en sådan avyttring inte utgör ett sådant implicit stöd som avses i artikel 250 i förordning (EU) nr 575/2013, | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY40 | Artikel 26b.7 fjärde stycket led c | Ingen kreditberoende ändring | | √ | | Om den underliggande exponeringen ska tas bort från transaktionen, en kortfattad beskrivning av att den är föremål för en ändring som inte är kreditberoende, t.ex. refinansiering eller omstrukturering av skuld, och som inträffar under den normala förvaltningen av den underliggande exponeringen. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY41 | Artikel 26b.7 fjärde stycket led d | Godtagbarhetskriterierna är inte uppfyllda | | √ | | Om den underliggande exponeringen ska tas bort från transaktionen, en kortfattad beskrivning av att den inte uppfyllde godtagbarhetskriterierna när den togs in i transaktionen. | Avsnitt 2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY42 | Artikel 26b.8 första stycket | Tillgångarnas homogenitet | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur värdepapperiseringen baseras på en grupp av underliggande exponeringar som är homogena i fråga om tillgångstyp. För detta ändamål ska hänvisning göras till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/1851 ⁽²⁾ . | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY43 | Artikel 26b.8 första stycket | Bara en tillgångstyp | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur gruppen av underliggande exponeringar bara omfattar en tillgångstyp. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

⁽²⁾ Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/1851 av den 28 maj 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 vad gäller tekniska tillsynsstandarder för homogenitet i de underliggande exponeringarna i värdepapperisering (EUT L 285, 6.11.2019, s. 1).

▼ **M1**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY44 | Artikel 26b.8 andra stycket | Förpliktelser som är avtalsmässigt bindande och verkställbara | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de underliggande exponeringar som avses i fält STSSY42 innehåller förpliktelser som är avtalsmässigt bindande och verkställbara, med full regressrätt mot gäldenärerna och, i tillämpliga fall, garantivarna. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY45 | Artikel 26b.8 tredje stycket | Fastställd periodisk betalning | | | √ | En detaljerad beskrivning av att de underliggande exponeringar som avses i fält STSSY42 har fastställda periodiska betalningsflöden, för vilka avbetalningsbeloppen kan komma att variera, som hänför sig till hyra, kapitalbelopp eller räntebetalningar eller till någon annan rätt till inkomst från tillgångar som utgör säkerhet för sådana betalningar. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY46 | Artikel 26b.8 tredje stycket | Inkomster från försäljning av tillgångar | | | √ | En detaljerad beskrivning av huruvida och hur de underliggande exponeringar som avses i fält STSSY42 även får generera inkomster från försäljningen av finansierade eller leasade tillgångar. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY47 | Artikel 26b.8 fjärde stycket | Inga överlåtbara värdepapper | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur de underliggande exponeringarna inte omfattar överlåtbara värdepapper enligt definitionen i artikel 4.1.44 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU ⁽³⁾ , med undantag av företagsobligationer som inte är noterade på en handelsplats. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY48 | Artikel 26b.9 | Ingen återvärdepapperisering | √ | | | En bekräftelse av att de underliggande exponeringarna inte omfattar några värdepapperiseringspositioner. | Punkt 2.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

⁽³⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY49 | Artikel 26b.10 första stycket | Kreditgivningsprinciper redovisas för potentiella investerare | √ | | | En bekräftelse av att de kreditgivningsprinciper enligt vilka de underliggande exponeringarna initieras samt alla väsentliga ändringar av tidigare kreditgivningsprinciper utan onödigt dröjsmål redovisas fullt ut för potentiella investerare. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY50 | Artikel 26b.10 första stycket | Full regressrätt mot gäldenär | √ | | | En bekräftelse av att de underliggande exponeringarna tecknas med full regressrätt mot en gäldenär som inte är ett specialföretag för värdepapperisering. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY51 | Artikel 26b.10 första stycket | Kreditgivningsprinciper – inga tredje parter | √ | | | En bekräftelse av att ingen tredje part är involverad i kredit- eller garantibeslut rörande de underliggande exponeringarna. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY52 | Artikel 26b.10 andra stycket | Kreditgivningsprinciper – bostadslån | √ | | | När det gäller värdepapperiseringar vars underliggande exponeringar är bostadslån, en bekräftelse av att gruppen av lån inte innefattar lån som marknadsförts och tecknats på premissen att lånesökanden, eller i tillämpliga fall intermediärerna, fått kännedom om att de lämnade uppgifterna eventuellt inte kontrolleras av långgivaren. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY53 | Artikel 26b.10 tredje stycket | Kreditgivningsprinciper – bedömning av låntagaren | √ | | | En bekräftelse av att bedömningen av låntagarens kreditvärdighet uppfyller kraven i artikel 8 i Europaparlamentets och rådets direktiv 2008/48/EG ⁽⁴⁾ eller i artikel 18.1–18.4, artikel 18.5 a och artikel 18.6, i Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/17/EU ⁽⁵⁾ eller, där så är tillämpligt, likvärdiga krav i tredjeländer. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

⁽⁴⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2008/48/EG av den 23 april 2008 om konsumentkreditavtal och om upphävande av rådets direktiv 87/102/EEG (EUT L 133, 22.5.2008, s. 66).

⁽⁵⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/17/EU av den 4 februari 2014 om konsumentkreditavtal som avser bostadsfastighet och om ändring av direktiven 2008/48/EG och 2013/36/EU och förordning (EU) nr 1093/2010 (EUT L 60, 28.2.2014, s. 34).

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY54 | Artikel 26b.10 fjärde stycket | Sakkunskaper hos originator eller ursprunglig långgivare | √ | | | En bekräftelse av att originatorn eller den ursprungliga långgivaren har sakkunskaper när det gäller att initiera exponeringar som till sin art liknar de exponeringar som värdepapperiseras. | Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY55 | Artikel 26b.11 a | Inga fallerande exponeringar | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de underliggande exponeringarna, vid tidpunkten för urvalet, inte inkluderar fallerande exponeringar i den mening som avses i artikel 178.1 i förordning (EU) nr 575/2013 eller exponeringar mot en gäldenär eller garantigivare med nedsatt kreditvärdighet som, såvitt originatorn eller den ursprungliga långgivaren känner till, har förklarats insolvent eller har fordringsägare som av en domstol beviljats slutgiltig verkställighetsrätt som inte kan överklagas eller skadestånd till följd av en utebliven betalning inom tre år före ursprungstidpunkten eller som under de tre år som föregår dagen för urvalet av de underliggande exponeringarna har genomgått en process för omstrukturering av skuld avseende dennes nödlidande exponeringar, med undantag för fall där i) en omstrukturerad underliggande exponering inte har gett upphov till nya utestående fordringar efter dagen för omstruktureringen, som ska ha ägt rum minst ett år före dagen för urvalet av de underliggande exponeringarna, eller ii) den information som tillhandahålls av originatorn i enlighet med artikel 7.1 första stycket a och e i) i förordning (EU) 2017/2402 uttryckligen anger andelen omstrukturerade underliggande exponeringar, tidpunkten för och närmare uppgifter om omstruktureringen samt exponeringarnas resultat sedan dagen för omstruktureringen. Om något av dessa undantag är tillämpligt, lämna en kortfattad beskrivning av detta. | Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY56 | Artikel 26b.11 b | Ingen negativ kredithistorik | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de underliggande exponeringarna, vid tidpunkten för urvalet, inte omfattade fallerande exponeringar i den mening som avses i artikel 178.1 i förordning (EU) nr 575/2013 eller exponeringar mot en gäldenär eller garantigivare med nedsatt kreditvärdighet som, såvitt originatorn eller den ursprungliga långivaren känner till, vid ursprungstidpunkten för den underliggande exponeringen, i förekommande fall fanns i ett kreditregister över personer med negativ kredithistorik som är tillgängligt för allmänheten eller, vid avsaknad av ett sådant register som är tillgängligt för allmänheten, ett annat kreditregister som är tillgängligt för originatorn eller den ursprungliga långivaren. | Ej tillämpligt |
| STSSY57 | Artikel 26b.11 c | Risken för uteblivna betalningar är inte högre än för exponeringar som inte är värdepapperiserade | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de underliggande exponeringarna, vid tidpunkten för urvalet, inte omfattade fallerande exponeringar i den mening som avses i artikel 178.1 i förordning (EU) nr 575/2013 eller exponeringar mot en gäldenär eller garantigivare med nedsatt kreditvärdighet som, såvitt originatorn eller den ursprungliga långivaren känner till har en kreditvärdering eller ett kreditomdöme som tyder på att risken för att avtalsenliga betalningar inte kommer att betalas är betydligt högre än för jämförbara exponeringar, som inte är värdepapperiserade, som originatorn har. | Ej tillämpligt |
| STSSY58 | Artikel 26b.12 | Minst en betalning har gjorts vid tidpunkten då de underliggande exponeringarna inkluderas | √ | | | En bekräftelse av att gäldenärerna vid den tidpunkt då de underliggande exponeringarna inkluderas har gjort minst en betalning, förutom i fall där | Punkterna 3.3 och 3.4.6 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|--|
| | | | | | | <p>a) värdepapperiseringen är en revolverande värdepapperisering som baseras på exponeringar som ska betalas som ett engångsbelopp eller som har en löptid på mindre än ett år, inklusive, utan begränsning, månadsbetalningar på revolverande krediter, eller</p> <p>b) exponeringen motsvarar refinansieringen av en exponering som redan ingår i transaktionen.</p> <p>Om något av dessa undantag är tillämpligt, lämna en kortfattad beskrivning av detta.</p> | |
| STSSY59 | Artikel 26c.1 | Uppfyllande av kravet på bibehållande av risk | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur originatorn eller den ursprungliga långgivaren uppfyller kraven på bibehållande av risk i enlighet med artikel 6 i förordning (EU) 2017/2402. | Punkt 3.1 i bilaga 9 och 3.4.3 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY60 | Artikel 26c.2 första stycket | Riskreducering – ränte- och valutarisker | √ | | | <p>En bekräftelse av att</p> <p>a) de ränte- och valutarisker som härrör från en värdepapperisering och deras möjliga effekter på betalningarna till originatorn och investerarna beskrivs i transaktionsdokumentationen,</p> <p>b) dessa risker har minskats på lämpligt sätt och att alla åtgärder som vidtagits i detta avseende har offentliggjorts för investerarna.</p> | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY61 | Artikel 26c.2 första stycket | Säkerhet enligt kreditriskskyddsavtalet och kreditriskskyddsbetalningen är noterade i samma valuta | √ | | | En bekräftelse av att varje säkerhet som ställts för investerarens förpliktelser enligt kreditriskskyddsavtalet är noterad i samma valuta som kreditriskskyddsbetalningen. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|--|--|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY62 | Artikel 26c.2 andra stycket | Specialföretags skulder är lika med eller mindre än specialföretagets intäkter | | √ | | En kortfattad beskrivning som, när det gäller värdepapperisering genom ett specialföretag för värdepapperisering, visar att specialföretagets skulder avseende räntebetalningarna till investerarna vid varje betalningsdatum är lika med eller mindre än beloppet för specialföretagets intäkter från originatorn och eventuella säkerhetsarrangemang. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY63 | Artikel 26c.2 tredje stycket | Inga derivat används, utom för att säkra ränte- eller valutarisker | √ | | | En bekräftelse på att gruppen av underliggande exponeringar inte omfattar derivat, utom i syfte att säkra ränte- eller valutarisker för de underliggande exponeringarna. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY64 | Artikel 26c.2 tredje stycket | Användning av derivat baserat på allmänt accepterade normer | | √ | | En kortfattad beskrivning av att, om det undantag som avses i fält STSSY63 är tillämpligt, alla derivat som används garanteras och dokumenteras i enlighet med allmänt vedertagna standarder. | Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY65 | Artikel 26c.3 första och andra stycket | Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämplade räntor utan komplicerade formler eller derivat | | √ | | <p>En kortfattad beskrivning, när det gäller eventuella referensräntebetalningar avseende transaktionen, av att referensräntebetalningarna grundar sig på något av följande:</p> <p>a) Normalt sett tillämplade marknadsräntor eller normalt sett tillämplade sektorsräntor som återspeglar finansieringskostnaderna och inte på komplicerade formler eller derivat.</p> <p>b) Intäkter som genererats av den säkerhet som ställts för investerarens förpliktelser enligt skyddsavtalet.</p> <p>En kortfattad beskrivning av att eventuella referensräntebetalningar som ska göras för de underliggande exponeringarna grundar sig på normalt sett tillämplade marknadsräntor eller normalt sett tillämplade sektorsräntor som speglar finansieringskostnaderna och inte på komplicerade formler eller derivat.</p> | Punkterna 2.2.2 och 2.2.13 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980. |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY66 | Artikel 26c.4 första stycket | Verkställighetshändelse utan inverkan på investerarens verkställighetsåtgärder | | √ | | En kortfattad beskrivning av att investeraren har rätt att vidta verkställighetsåtgärder efter det att en verkställighetshändelse inträffat med avseende på originatorn. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY67 | Artikel 26c.4 andra stycket | Verkställighet av kreditrisk-skyddsavtalet – Inga kontantbelopp får kvarhållas i specialföretaget för värdepapperisering | | √ | | När det gäller en värdepapperisering genom ett specialföretag för värdepapperisering, en kortfattad beskrivning av att, när en underrättelse om verkställighet eller uppsägning av kreditrisk-skyddsavtalet har levererats, inga kontanta medel kvarhålls i specialföretaget för värdepapperisering utöver vad som krävs för att säkerställa att specialföretaget för värdepapperisering kan bedriva sin verksamhet, att betalningar avseende de skyddsbelopp för fallerade exponeringar som fortfarande omfattas av en skulduppställningsprocess vid tidpunkten för uppsägning kan göras eller att investerare under ordnade former återbetalas i enlighet med avtalsvillkoren för värdepapperiseringen. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY68 | Artikel 26c.5 första stycket | Förluster fördelade utifrån tranchernas prioritet | | √ | | En kortfattad beskrivning av att förluster fördelas mellan innehavarna av värdepapperiseringspositionen utifrån tranchernas prioritet, och att fördelningen börjar med tranchen med lägst prioritet. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY69 | Artikel 26c.5 andra stycket | Sekventiell amortering | | √ | | En kortfattad beskrivning av att sekventiell amortering tillämpas på alla trancher för att fastställa utestående belopp för trancherna per varje betalningsdatum, och börjar med tranchen med högst prioritet. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY70 | Artikel 26c.5 tredje stycket | Icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar | | √ | | Genom undantag från fält STSSY69, en kortfattad beskrivning av att transaktioner som har en icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar inbegriper utlösande faktorer kopplade till resultaten för de underliggande exponeringarna som resulterar i att prioritetsordningen för betalningar återgår till sekventiella betalningar enligt prioritetsordning. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|---|
| STSSY71 | Artikel 26c.5 tredje stycket led a | Resultatrelaterade utlösande faktorer | | | √ | En detaljerad beskrivning av den obligatoriska resultatrelaterade utlösande faktor som avses i STSSY70, som antingen är ökningen av det kumulativa värdet av fallerade exponeringar eller ökningen av de kumulativa förlusterna över en viss procentandel av det utestående beloppet för den underliggande portföljen. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY72 | Artikel 26c.5 tredje stycket led b | Resultatrelaterade utlösande faktorer | | | √ | Detaljerad beskrivning av den ytterligare bakåtblickande resultatrelaterade utlösande faktor som avses i fält STSSY70. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY73 | Artikel 26c.5 tredje stycket led c | Resultatrelaterade utlösande faktorer | | | √ | En detaljerad beskrivning av den framåtblickande resultatrelaterade utlösande faktor som avses i fält STSSY70. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY74 | Artikel 26c.5 sjunde stycket | Belopp avseende säkerhet som motsvarar beloppet för amorteringen av trancherna | | √ | | En kortfattad beskrivning av att när trancher amorteras betalas beloppet avseende säkerheten motsvarande beloppet för amorteringen av dessa trancher tillbaka till investerarna, förutsatt att investerarna har ställt säkerhet för dessa trancher. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY75 | Artikel 26c.5 åttonde stycket | Kredithändelse och tillgängligt kreditriskskyddsbelopp per givet betalningsdatum | | √ | | En kortfattad beskrivning av, att om en sådan kredithändelse som avses i fälten STSSY100 och STSSY101 har inträffat avseende underliggande exponeringar och skulduppörelsen för dessa exponeringar inte är slutförd, ska det belopp för kreditriskskydd som är kvarstående per ett givet betalningsdatum minst motsvara det utestående nominella beloppet för dessa underliggande exponeringar, minus beloppet för eventuella mellanliggande betalningar som gjorts med avseende på de underliggande exponeringarna. | Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|---|
| STSSY76 | Artikel 26c.6 a | Bestämmelser om förtida amortering eller utlösande faktorer – Kreditkvalitet | | √ | | Om en värdepapperisering är en revolverande värdepapperisering, en kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen innehåller lämpliga bestämmelser om förtida amortering eller faktorer som utlöser ett avslutande av den rullande perioden i händelse av en försämring av de underliggande exponeringarnas kreditkvalitet till, eller under, ett på förhand fastställt tröskelvärde. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY77 | Artikel 26c.6 b | Bestämmelser om förtida amortering eller utlösande faktorer – Förluster | | √ | | Om en värdepapperisering är en revolverande värdepapperisering, en kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen innehåller lämpliga bestämmelser om förtida amortering eller faktorer som utlöser ett avslutande av den rullande perioden i händelse av en ökning av förluster över ett på förhand fastställt tröskelvärde. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY78 | Artikel 26c.6 c | Bestämmelser om förtida amortering eller utlösande faktorer – Nya exponeringar | | √ | | Om en värdepapperisering är en revolverande värdepapperisering, en kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen innehåller lämpliga bestämmelser om förtida amortering eller faktorer som utlöser ett avslutande av den rullande perioden i händelse av att det inte har gått att generera tillräckligt med nya underliggande exponeringar som uppfyller den på förhand fastställda kreditkvaliteten under en angiven period. | Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY79 | Artikel 26c.7 a | Avtalade förpliktelser, uppgifter och ansvarsområden – Serviceföretag | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen tydligt anger avtalade förpliktelser, uppgifter och ansvarsområden för serviceföretaget. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY80 | Artikel 26c.7 a | Avtalade förpliktelser, uppgifter och ansvarsområden – Trustförvaltare | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen tydligt anger avtalade förpliktelser, uppgifter och ansvarsområden för trustförvaltaren och leverantörer av andra anknutna tjänster, enligt vad som är tillämpligt. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY81 | Artikel 26c.7 a | Avtalade förpliktelser, uppgifter och ansvarsområden – Tredjeparts-kontrollant | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen tydligt anger avtalade förpliktelser, uppgifter och ansvarsområden för den tredjepartskontrollant som avses i fält STSSY126. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY82 | Artikel 26c.7 b | Ersättning av serviceföretag i händelse av fallissemang eller insolvens | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumenten tydligt anger bestämmelser som säkerställer ersättning av serviceföretag, trustförvaltare, leverantörer av andra anknutna tjänster eller den tredjepartskontrollant som avses i fält STSSY126 i händelse av fallissemang eller insolvens för någon av dessa tjänsteleverantörer, om dessa tjänsteleverantörer inte sammanfaller med originatorn, på ett sätt som inte leder till att tillhandahållandet av dessa tjänster upphör. | Punkt 3.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY83 | Artikel 26c.7 c | Förvaltningsförfaranden | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumenten tydligt anger de förvaltningsförfaranden som gäller de underliggande exponeringarna på transaktionens avslutsdag och efteråt och under vilka omständigheter dessa förfaranden får ändras. | Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY84 | Artikel 26c.7 d | Administrationsstandarder | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumenten tydligt anger de förvaltningsstandarder som serviceföretaget är skyldigt att följa i förvaltningen av de underliggande exponeringarna under hela värdepapperiseringslöptid. | Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY85 | Artikel 26c.8 första stycket | Erforderliga sakkunskaper hos serviceföretaget | | √ | | En kortfattad beskrivning av att serviceföretaget har sakkunskaper när det gäller att förvalta exponeringar som till sin art liknar de värdepapperiserade exponeringarna. | Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|---|
| STSSY86 | Artikel 26c.8 första stycket | Väldokumenterade och adekvata riktlinjer, förfaranden och kontroller för riskhantering | √ | | | En bekräftelse på att serviceföretaget har väldokumenterade och lämpliga riktlinjer, förfaranden och kontroller för riskhantering avseende förvaltning av exponeringar. | Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY87 | Artikel 26c.8 andra stycket | Förvaltningsförfaranden som inte är mindre strikta än de som tillämpas på liknande exponeringar som inte är värdepapperiserade | √ | | | En kortfattad beskrivning av att serviceföretaget tillämpar förvaltningsförfaranden på de underliggande tillgångarna som inte är mindre strikta än de som originatorn tillämpar på liknande exponeringar som inte är värdepapperiserade. | Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY88 | Artikel 26c.9 | Referensregister | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur originatorn upprätthåller ett uppdaterat referensregister för identifiering av de underliggande exponeringarna vid varje given tidpunkt. | Ej tillämpligt |
| STSSY89 | Artikel 26c.9 | Referensregister – Innehåll | | √ | | En kortfattad beskrivning av att det referensregister som avses i fält STSSY88 innehåller referensgäldenärer, referensförpliktelser från vilka de underliggande exponeringarna härrör och, för varje underliggande exponering, det nominella belopp som skyddas och som är utestående. | Ej tillämpligt |
| STSSY90 | Artikel 26c.10 | Snabb lösning av konflikter mellan olika kategorier av investerare | √ | | | En bekräftelse av att transaktionsdokumentationen innehåller tydliga bestämmelser som gör det lättare att snabbt lösa konflikter mellan olika kategorier av investerare. | Punkterna 3.4.7 och 3.4.8 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY91 | Artikel 26c.10 | Specialföretag för värdepapperisering – tydligt fastställda rösträtter | √ | | | En bekräftelse av att rösträtterna, vid en värdepapperisering genom ett specialföretag för värdepapperisering, är tydligt fastställda och fördelade mellan obligationsinnehavare och att det finns en tydlig beskrivning av de skyldigheter som trustförvaltaren och andra enheter med förvaltaruppdrag har gentemot investerarna. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|---|
| STSSY92 | Artikel 26d.1 | Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster | √ | | | En bekräftelse av att potentiella investerare före prissättningen fått tillgång till statiska och dynamiska uppgifter om historiken vad gäller fallissemang och förluster, t.ex. uppgifter om misskötsel och fallissemang (som omfattar en period av minst fem år), för exponeringar som väsentligen liknar de exponeringar som värdepapperiseras, och till källorna till dessa uppgifter samt på vilken grund exponeringarna bedömts vara likartade. | Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till delegerad förordning (EU) 2019/980 |
| STSSY93 | Artikel 26d.2 | Extern kontroll av ett urval av de underliggande exponeringarna | √ | | | En bekräftelse av att ett urval av de underliggande exponeringarna omfattas av en extern kontroll av en lämplig och oberoende part innan transaktionen avslutas, inbegripet en kontroll av att de underliggande exponeringarna är godtagbara för kreditriskskydd enligt kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |
| STSSY94 | Artikel 26d.3 | Kassaflödesmodell för skulder tillgänglig för potentiella investerare | √ | | | En bekräftelse av att originatorn, före prissättningen av värdepapperiseringen, gör en kassaflödesmodell för skulder tillgänglig för potentiella investerare som exakt representerar avtalsförhållandet mellan de underliggande exponeringarna och betalningarna mellan originatorn, investerarna, andra tredje parter och, i tillämpliga fall, specialföretaget för värdepapperisering, och efter prissättningen fortlöpande gör den modellen tillgänglig för investerarna och för potentiella investerare på begäran. | Ej tillämpligt |
| STSSY95 | Artikel 26d.4 första stycket | Offentliggörande av miljöprestandan hos underliggande exponeringar i form av bostadslån, billån eller billeasing | | √ | | När det gäller värdepapperiseringar där de underliggande exponeringarna är bostadslån, billån eller billeasing, och såvida inte undantaget i fält STSSY96 tillämpas, en kortfattad beskrivning av att originatorn gör tillgänglig information om miljöprestandan för de tillgångar som finansieras genom lånen, som en del av den information som redovisas enligt artikel 7.1 första stycket led a i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSSY96 | Artikel 26d.4 andra stycket | Undantag från kravet på offentliggörande av miljöprestandan hos underliggande exponeringar i form av bostadslån, billån eller billeasing | | √ | | Om originatorn beslutar sig för att avvika från kravet i fält STSSY95, en kortfattad beskrivning av att originatorn offentliggör tillgänglig information om de viktigaste negativa konsekvenserna som de tillgångar som finansieras av underliggande exponeringar har med avseende på hållbarhetsfaktorer. | Ej tillämpligt |
| STSSY97 | Artikel 26d.5 | Originator ansvarig för efterlevnad av artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402 | √ | | | En bekräftelse av att originatorn är ansvarig för efterlevnad av artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSSY98 | Artikel 26d.5 | Information om artikel 7.1 a i förordning (EU) 2017/2402 tillgänglig för potentiella investerare | √ | | | En bekräftelse av att den information som krävs enligt artikel 7.1 första stycket led a i förordning (EU) 2017/2402 på begäran tillhandahålls potentiella investerare före prissättningen. | Ej tillämpligt |
| STSSY99 | Artikel 26d.5 | 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 | √ | | | En bekräftelse av att den information som krävs enligt artikel 7.1 första stycket leden b, c och d i förordning (EU) 2017/2402 görs tillgänglig före prissättningen, åtminstone i form av ett utkast eller i sin ursprungliga form, och att den slutliga dokumentationen därefter görs tillgänglig för investerarna senast 15 dagar efter transaktionen avslutande. | Ej tillämpligt |
| STSSY100 | Artikel 26e.1 första stycket led a | Kredithändelser och användning av garantier | | √ | | När risköverföringen uppnås genom användning av garantier, en kortfattad beskrivning av att kreditkyddsavtalet åtminstone omfattar de kredithändelser som avses i artikel 215.1 a i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |

▼ **M1**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY101 | Artikel 26e.1 första stycket led b | Kredithändelser och användning av kreditderivat | | √ | | När risköverföringen uppnås genom användning av kreditderivat, en kortfattad beskrivning av att kreditavtalet åtminstone omfattar de kredithändelser som avses i artikel 216.1 a i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |
| STSSY102 | Artikel 26e.1 andra stycket | Kreditrisk-skyddsavtal dokumenteras | | √ | | En kortfattad beskrivning av att alla kredithändelser dokumenteras. | Ej tillämpligt |
| STSSY103 | Artikel 26e.1 tredje stycket | Anståndsåtgärder utesluter inte att godtagbara kredithändelser utlöses | | √ | | En kortfattad beskrivning av att anståndsåtgärder i den mening som avses i artikel 47b i förordning (EU) nr 575/2013 som tillämpas på de underliggande exponeringarna inte utesluter att godtagbara kredithändelser utlöses. | Ej tillämpligt |
| STSSY104 | Artikel 26e.2 första stycket | Kreditrisk-skyddsbetalningen baseras på den faktiska realiserade förlusten och standardprinciper och -förfaranden för återvinning | | √ | | En kortfattad beskrivning av att kreditriskskyddsbetalningen, efter att en kredithändelse inträffat, beräknas baserat på originatorns eller den ursprungliga långivarens faktiska realiserade förlust, beräknad i enlighet med deras standardprinciper och -förfaranden för återvinning för de berörda exponeringstyperna och bokförs i deras finansiella rapporter vid den tidpunkt betalningen görs. | Ej tillämpligt |
| STSSY105 | Artikel 26e.2 första stycket | Kreditrisk-skyddsbetalningen ska betalas inom en angiven tidsperiod | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den slutliga kreditriskskyddsbetalningen betalas inom en angiven tidsperiod efter att skulduppgörelsen avslutats för den berörda underliggande exponeringen, om skulduppgörelsen avslutats före utgången av den planerade lagenliga löptiden eller före uppsägning i förtid av kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|---|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY106 | Artikel 26e.2 första stycket | En mellanliggande kreditriskskyddsbetalning görs senast sex månader efter en kredithändelse | | √ | | Om skulduppgörelsen för förlusterna för den berörda underliggande exponeringen inte har slutförts inom den sexmånadersperiod som avses i artikel 26e.2 andra stycket i förordning (EU) 2017/2402, en kortfattad beskrivning av att en mellanliggande kreditriskskyddsbetalning görs senast sex månader efter det att en sådan kredithändelse som avses i fälten STSSY100 och STSSY101 har inträffat. | Ej tillämpligt |
| STSSY107 | Artikel 26e.2 andra stycket leden a och b | Mellanliggande kreditriskskyddsbetalning är högre än det förväntade förlustbeloppet | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den mellanliggande kreditriskskyddsbetalningen är minst det högsta av följande: a) Det förväntade förlustbeloppet som motsvarar den nedskrivning som har bokförts av originatorn i dennes finansiella rapporter i enlighet med de tillämpliga redovisningsreglerna vid den tidpunkt då den mellanliggande betalningen görs med antagandet att kreditriskskyddsavtalet inte finns och inte täcker några förluster. b) I tillämpliga fall det förväntade förlustbeloppet enligt vad som fastställs i enlighet med del tre avdelning II kapitel 3 i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |
| STSSY108 | Artikel 26e.2 tredje stycket | Villkor för den mellanliggande kreditriskskyddsbetalningen | | √ | | Om en mellanliggande kreditriskskyddsbetalning görs, en kortfattad beskrivning av att den slutliga kreditriskskyddsbetalning som avses i fält STSSY106 görs för att justera den mellanliggande avräkningen av förluster mot den faktiska realiserade förlusten. | Ej tillämpligt |
| STSSY109 | Artikel 26e.2 fjärde stycket | Metod för beräkning av mellanliggande och slutliga kreditriskskyddsbetalningar | | √ | | En kortfattad beskrivning av att metoden för beräkning av mellanliggande och slutliga kreditriskskyddsbetalningar anges i kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY110 | Artikel 26e.2 femte stycket | Kreditrisk-skyddsbetalningen står i proportion till andelen av det utestående nominella beloppet | | √ | | En kortfattad beskrivning av att kreditriskskyddsbetalningen står i proportion till andelen av det utestående nominella beloppet för den motsvarande underliggande exponering som täcks av kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |
| STSSY111 | Artikel 26e.2 sjätte stycket | Kreditrisk-skyddsbetalningens verkställbarhet | | √ | | En kortfattad beskrivning av att originatorns rätt att erhålla kreditriskskyddsbetalningen är verkställbar. | Ej tillämpligt |
| STSSY112 | Artikel 26e.2 sjätte stycket | Det belopp som ska betalas av investerare enligt kreditriskskyddsavtalet fastställs tydligt i kreditrisk-skyddsavtalet | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de belopp som ska betalas av investerare enligt kreditriskskyddsavtalet är tydligt fastställda i kreditriskskyddsavtalet och är begränsade. | Ej tillämpligt |
| STSSY113 | Artikel 26e.2 sjätte stycket | Beräkning av beloppen under alla omständigheter | | √ | | En kortfattad beskrivning av att det är möjligt under alla omständigheter att beräkna de belopp som ska betalas av investerarna enligt kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |
| STSSY114 | Artikel 26e.2 sjätte stycket | De omständigheter under vilka investerare är skyldiga att göra betalningar fastställs i kreditriskskyddsavtalet. | | √ | | En kortfattad beskrivning av att kreditriskskyddsavtalet tydligt fastställer under vilka omständigheter investerare ska vara skyldiga att göra betalningar. | Ej tillämpligt |
| STSSY115 | Artikel 26e.2 sjätte stycket | Tredjeparts-kontrollantens bedömning av omständigheter som utlöser investerares betalningar | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den tredjepartskontrollant som avses i fält STSSY126 bedömer huruvida de omständigheter som anges i kreditriskskyddsavtalet, enligt vilka investerare är skyldiga att göra betalningar, föreligger. | Ej tillämpligt |
| STSSY116 | Artikel 26e.2 sjunde stycket | Kreditrisk-skyddsbetalningen beräknas på nivån för den enskilda underliggande exponeringen | | √ | | En kortfattad beskrivning av att beloppet för kreditriskskyddsbetalningen beräknas på nivån för den enskilda underliggande exponering för vilken en kredit-händelse har inträffat. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY117 | Artikel 26e.3 första stycket | Angivelse av den längsta förlängningsperioden för skulduppställningsprocessen | | √ | | En kortfattad beskrivning av att kreditriskskyddsavtalet anger den längsta förlängningsperiod som gäller för skulduppställningsprocessen för de underliggande exponeringarna avseende vilken en sådan kredithändelse som avses i artikel 26e.1 i förordning (EU) 2017/2402 har inträffat, om skulduppställningsprocessen inte är slutförd vid utgången av den planerade lagenliga löptiden eller vid uppsägning i förtid av kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |
| STSSY118 | Artikel 26e.3 första stycket | Förlängningsperioden är inte längre än två år | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den förlängningsperiod som avses i fält STSSY117 inte är längre än två år. | Ej tillämpligt |
| STSSY119 | Artikel 26e.3 första stycket | Slutlig kreditriskskydds betalning baserad på originatorns slutliga förlustberäkning | | √ | | En kortfattad beskrivning av att kreditriskskyddsavtalet föreskriver att en slutlig kreditriskskydds betalning ska göras innan den förlängningsperiod som avses i fält STSSY117 löper ut baserat på originatorns slutliga förlustberäkning som bokförs av originatorn i dennes finansiella rapporter vid denna tidpunkt med antagandet att kreditriskskyddsavtalet inte finns och inte täcker några förluster. | Ej tillämpligt |
| STSSY120 | Artikel 26e.3 andra stycket | Uppsägning av kreditriskskyddsavtalet | | √ | | I det fall kreditriskskyddsavtalet sägs upp, en kortfattad beskrivning av att skulduppställningen fortsätter med avseende på varje utestående kredithändelse som har inträffat före den uppsägningen, på samma sätt som enligt beskrivningen i artikel 26e.3 första stycket i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSSY121 | Artikel 26e.3 tredje stycket | Kreditriskskyddspremierna är beroende av utestående nominella belopp | | √ | | En kortfattad beskrivning av att de kreditriskskyddspremier som ska betalas enligt kreditriskskyddsavtalet är strukturerade så att de är beroende av de presterande värdepapperiserade exponeringarnas utestående nominella belopp vid tidpunkten för betalningen och återspeglar den skyddade tranchens risk. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY122 | Artikel 26e.3 tredje stycket | Kreditrisk-skyddsavtalet stipulerar inte mekanismer som kan leda till att den faktiska fördelningen av förluster på investerarna undviks eller minskas | | √ | | En kortfattad beskrivning som, när det gäller fält STSSY117, visar att kreditriskskyddsavtalet inte stipulerar garanterade premier, förskottsbetalning av premier, rabattmekanismer eller andra mekanismer som kan leda till att den faktiska fördelningen av förluster på investerarna undviks eller minskas eller att en del av de erlagda premierna till originatorn efter utgången av transaktionens löptid återbetalas. | Ej tillämpligt |
| STSSY123 | Artikel 26e.3 fjärde stycket | Undantag för förskottsbetalningar av premier | | √ | | Genom undantag från fälten STSSY121 och STSSY122, och om garantisystemet särskilt föreskrivs i en medlemsstats nationella rätt och omfattas av en motgaranti från någon av de enheter som förtecknas i artikel 214.2 a–d i förordning (EU) nr 575/2013, en kortfattad beskrivning av att förskottsbetalningar av premier är tillåtna, förutsatt att reglerna för statligt stöd efterlevs. | Ej tillämpligt |
| STSSY124 | Artikel 26e.3 femte stycket | Beskrivning av kreditrisk-skyddspremien i transaktionsdokumentationen | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen innehåller en beskrivning av hur kreditriskskyddspremien och eventuella obligationskuponger beräknas med avseende på varje betalningsdag över värdepapperseringens hela löptid. | Ej tillämpligt |
| STSSY125 | Artikel 26e.3 sjätte stycket | Investerarnas rätt är verkställbar | | √ | | En kortfattad beskrivning av att investerarnas rätt att erhålla kreditriskskyddspremier är verkställbar. | Ej tillämpligt |
| STSSY126 | Artikel 26e.4 första stycket | Utseende av en tredjeparts-kontrollant före transaktionens avslutsdag | √ | | | En bekräftelse på att originatorn, före transaktionens avslutsdag, utser en tredjeparts-kontrollant. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY127 | Artikel 26e.4 första stycket led a | Tredjeparts-kontrollantens kontroll – Kredithändelse enligt vad som anges i villkoren i kredit-riskskyddsavtalet | √ | | | En bekräftelse av att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126, för var och en av de underliggande exponeringar för vilka ett meddelande om kredithändelse har skickats, kontrollerar att det är en kredithändelse enligt vad som är angivet i villkoren i kreditriskskyddsavtalet. | Ej tillämpligt |
| STSSY128 | Artikel 26e.4 första stycket led b | Tredjeparts-kontrollantens kontroll – Underliggande exponering ingår i referensportföljen | √ | | | För var och en av de underliggande exponeringar för vilka ett meddelande om kredithändelse har skickats, en bekräftelse på att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 kontrollerar att den underliggande exponeringen ingick i referensportföljen vid den tidpunkt när den berörda kredithändelsen inträffade. | Ej tillämpligt |
| STSSY129 | Artikel 26e.4 första stycket led c | Tredjeparts-kontrollantens kontroll – Godtagbarhets-kriterierna var uppfyllda när den underliggande exponeringen togs in i referensportföljen | √ | | | För var och en av de underliggande exponeringar för vilka ett meddelande om kredithändelse har skickats, en bekräftelse på att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 kontrollerar att den underliggande exponeringen uppfyllde godtagbarhetskriterierna vid den tidpunkt när den togs in i referensportföljen. | Ej tillämpligt |
| STSSY130 | Artikel 26e.4 första stycket led d | Tredjeparts-kontrollantens kontroll – Efterlevnad av villkoren för påfyllning | √ | | | För var och en av de underliggande exponeringar för vilka ett meddelande om kredithändelse har skickats, en bekräftelse på att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126, om en underliggande exponering har lagts till i värdepapperiseringen till följd av en påfyllning, kontrollerar att denna påfyllning följde villkoren för påfyllning. | Ej tillämpligt |
| STSSY131 | Artikel 26e.4 första stycket led e | Tredjeparts-kontrollantens kontroll – Förluster förenliga med förluster redovisade i originatorns resultaträkning | √ | | | För var och en av de underliggande exponeringar för vilka ett meddelande om kredithändelse har skickats, en bekräftelse på att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 kontrollerar att det slutliga förlustbeloppet är förenligt med de förluster som redovisats av originatorn i dennes resultaträkning. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY132 | Artikel 26e.4 första stycket led f | Tredjeparts-kontrollantens kontroll – Förlusterna har fördelats på investerarna på ett riktigt sätt | √ | | | För var och en av de underliggande exponeringar för vilka ett meddelande om kredithändelse har skickats, en bekräftelse på att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 kontrollerar att, vid den tidpunkt den slutliga kreditrisk-skyddsbetalningen görs, förlusterna i samband med de underliggande exponeringarna har fördelats på investerarna på ett riktigt sätt. | Ej tillämpligt |
| STSSY133 | Artikel 26e.4 andra stycket | Tredjeparts-kontrollanten är oberoende av originatorer, investerare och, i tillämpliga fall, specialföretaget för värdepapperisering | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 är oberoende av originatorn och investerarna och, i tillämpliga fall, av specialföretaget för värdepapperisering. | Ej tillämpligt |
| STSSY134 | Artikel 26e.4 andra stycket | Tredjeparts-kontrollanten har utsetts senast på transaktionens avslutsdag. | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 har accepterat uppdraget som tredjeparts-kontrollant senast på transaktionens avslutsdag. | Ej tillämpligt |
| STSSY135 | Artikel 26e.4 tredje stycket | Tredjeparts-kontrollantens kontroll utförs på urvalsbasis | | √ | | En kortfattad beskrivning av att den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 utför kontrollen på urvalsbasis i stället för av varje enskild underliggande exponering för vilken kreditriskskyddsbetalning begärs. | Ej tillämpligt |
| STSSY136 | Artikel 26e.4 tredje stycket | Möjlighet för investerare att begära att tredjeparts-kontrollanten kontrollerar underliggande exponeringar | | √ | | En kortfattad beskrivning av huruvida och hur investerare får begära kontroll av en viss underliggande exponerings godtagbarhet om de inte är nöjda med kontrollen på urvalsbasis. | Ej tillämpligt |
| STSSY137 | Artikel 26e.4 fjärde stycket | Möjlighet för tredjeparts-kontrollanten att få tillgång till all relevant information | | √ | | En kortfattad beskrivning av att originatorn inkluderar ett åtagande i transaktionsdokumentationen om att ge den tredjeparts-kontrollant som avses i fält STSSY126 tillgång till all den information som krävs för att kontrollera kraven i artikel 26e.4 första stycket a-f i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|--|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSS 138 | Artikel 26e.5 första stycket leden a-f | Händelser som möjliggör uppsägning | | √ | | En kortfattad beskrivning av att originatorn endast får säga upp en transaktion före utgången av dess löptid på grund av någon av de händelser som anges i artikel 26e.5 a-f i förordning (EU) 2017/2402. | Ej tillämpligt |
| STSS 139 | Artikel 26e.5 andra stycket | Transaktionsdokumentation – Rätt till uppsägning | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen anger om någon av de rättigheter som avses i artikel 26e.5 första stycket led d och e i förordning (EU) 2017/2402 ingår i den berörda transaktionen och hur sådana rättigheter är strukturerade. | Ej tillämpligt |
| STSS 140 | Artikel 26e.5 tredje stycket | Transaktionsdokumentation – Tidsoptionen inte utformad för att undvika fördelning av förluster på kreditförstärkningspositioner | | √ | | Vid tillämpningen av artikel 26e.5 första stycket led d i förordning (EU) 2017/2402, en kortfattad beskrivning av att tidsoptionen inte är utformad för att undvika fördelning av förluster på kreditförstärkningspositioner eller andra positioner som innehas av investerare och inte är utformad på annat sätt för att tillhandahålla kreditförstärkning. | Ej tillämpligt |
| STSS 141 | Artikel 26e.5 fjärde stycket | Tidsoption | | √ | | Om en tidsoption ingår i transaktionen, en kortfattad beskrivning av att kraven i STSS139 och STSS140 uppfylls, tillsammans med en motivering till användningen av tidsoptionen och en rimlig redogörelse som visar att skälet till användningen av tidsoptionen inte är en försämring av de underliggande tillgångarnas kvalitet. | Ej tillämpligt |
| STSS 142 | Artikel 26e.5 femte stycket | Förbetalt kreditriskskydd – Återlämnande av säkerheter till investerarna i prioritetsordning för trancherna | | √ | | När det gäller förbetalt kreditriskskydd, en kortfattad beskrivning av att säkerheten, vid uppsägning av kreditriskskyddsavtalet, återlämnas till investerarna i prioritetsordning för de trancher som omfattas av bestämmelserna i relevant insolvensrätt, beroende på vad som är tillämpligt på originatorn. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSS 143 | Artikel 26e.6 | Investerares uppsägning av en transaktion på grund av underlåtenhet att betala kreditriskskyddspremien | | √ | | En kortfattad beskrivning av att investerare inte får säga upp en transaktion före utgången av dess löptid av något annat skäl än underlåtenhet att betala kreditriskskyddspremien eller någon annan väsentlig överträdelse av avtalsförpliktelser från originatorns sida. | Ej tillämpligt |
| STSSY144 | Artikel 26e.7 a | Syntetisk överskottsmarginal till investerare anges i transaktionsdokumentationen och uttrycks som en fast procentsats av det totala utestående portföljsaldot | | √ | | Om originatorn gör åtaganden om syntetisk överskottsmarginal som är tillgänglig som kreditförstärkning för investerarna, en kortfattad beskrivning av att beloppet för den syntetiska överskottsmarginal som originatorn åtar sig att använda som kreditförstärkning vid varje betalningsperiod är angivet i transaktionsdokumentationen och uttryckt som en fast procentsats av det totala utestående portföljsaldot per början av den berörda betalningsperioden (fast syntetisk överskottsmarginal). | Ej tillämpligt |
| STSSY145 | Artikel 26e.7 b | Outnyttjad syntetisk överskottsmarginal betalas tillbaka till originatorn | | √ | | Om originatorn gör åtaganden om syntetisk överskottsmarginal som är tillgänglig som kreditförstärkning för investerarna, en kortfattad beskrivning av att den syntetiska överskottsmarginal som inte används till att täcka förluster som uppstår under varje betalningsperiod återbetalas till originatorn. | Ej tillämpligt |
| STSSY146 | Artikel 26e.7 c | Originatorer som använder internmetoden – Totalt belopp för åtaganden per år överstiger inte beloppen för förväntade förluster för ett år beräknade enligt förordningen | | √ | | Om originatorn gör åtaganden om syntetisk överskottsmarginal som är tillgänglig som kreditförstärkning för investerarna, en kortfattad beskrivning av att det totala beloppet för sådana åtaganden per år för originatorer som använder den internmetod som avses i artikel 143 i förordning (EU) nr 575/2013 inte överstiger beloppen för förväntade förluster för ett år på alla underliggande exponeringar för det året, beräknade i enlighet med artikel 158 i den förordningen. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljrad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|-----------------------|--|-------------------------|
| STSSY147 | Artikel 26e.7 d | Originatorer som inte använder internmetoden – Beräkningen av de förväntade förlusterna i den underliggande portföljen för ett år fastställs tydligt i transaktionsdokumentationen | | √ | | Om originatorn gör åtaganden om syntetisk överskottsmarginal som är tillgänglig som kreditförstärkning för investerarna, en kortfattad beskrivning av att beräkningen av de förväntade förlusterna i den underliggande portföljen för ett år, för originatorer som inte använder den internmetod som avses i artikel 143 i förordning (EU) nr 575/2013, tydligt fastställs i transaktionsdokumentationen. | Ej tillämpligt |
| STSSY148 | Artikel 26e.7 e | Villkor för syntetisk överskottsmarginal anges i transaktionsdokumentationen | | √ | | Om originatorn gör åtaganden om syntetisk överskottsmarginal som är tillgänglig som kreditförstärkning för investerarna, en kortfattad beskrivning av att villkoren i artikel 26e.7 i förordning (EU) 2017/2402 anges i transaktionsdokumentationen. | Ej tillämpligt |
| STSS 149 | Artikel 26e.8 leden a, b och c | Kreditrisk-skydd som används | | √ | | En kortfattad beskrivning av vilken av följande former kreditriskskyddsavtalet har: a) En garanti som uppfyller kraven i del tre avdelning II kapitel 4 i förordning (EU) nr 575/2013, genom vilken kreditrisken överförs till någon av de enheter som förtecknas i artikel 214.2 a–d i förordning (EU) nr 575/2013, förutsatt att exponeringarna för investeraren uppfyller villkoren för en riskvikt på 0 % enligt del tre avdelning II kapitel 2 i den förordningen. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| | | | | | | <p>b) En garanti som uppfyller kraven i del tre avdelning II kapitel 4 i förordning (EU) nr 575/2013, som omfattas av en motgaranti av någon av de enheter som avses i led a i denna punkt.</p> <p>c) Annat kreditriskskydd som inte avses i leden a och b ovan, i form av en garanti, ett kreditderivat eller en kreditlänkad obligation som uppfyller kraven i artikel 249 i förordning (EU) nr 575/2013, förutsatt att investerarens förpliktelser garanteras av säkerheter som uppfyller kraven i artikel 26e. 9 och artikel 26e.10 i förordning (EU) 2017/2402.</p> | |
| STSSY150 | Artikel 26e.9 första stycket led a | Originators rätt att använda säkerheten för att fullgöra investerarnas skyddsbetalningsförpliktelser är verkställbar genom lämpliga säkerhetsarrangemang | | | √ | Om ett kreditriskskydd som avses i artikel 26e.8 c i förordning (EU) 2017/2402 används, en detaljerad beskrivning av hur originators rätt att använda säkerheten för att fullgöra investerarnas skyddsbetalningsförpliktelser är verkställbar och denna rätts verkställbarhet säkerställs genom lämpliga säkerhetsarrangemang. | Ej tillämpligt |
| STSSY151 | Artikel 26e.9 första stycket led b | Investerarnas rätt att, när värdepapperiseringen avvecklas eller när trancherna amorteras, få tillbaka säkerhet som inte har använts | | | √ | Om ett kreditriskskydd som avses i artikel 26e.8 c i förordning (EU) 2017/2402 används, en kortfattad beskrivning av att investerarnas rätt att, när värdepapperiseringen avvecklas eller när trancherna amorteras, få tillbaka säkerhet som inte har använts för att göra skyddsbetalningar är verkställbar. | Ej tillämpligt |

▼ M1

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSSY152 | Artikel 26e.9 första stycket led c | Säkerhet placerad i värdepapper – Godtagbarhetskriterier och förvaringsarrangemang anges i transaktionsdokumentationen | | | √ | Om ett kreditriskskydd som avses i artikel 26e.8 c i förordning (EU) 2017/2402 används, en detaljerad beskrivning av hur, om säkerheten investeras i värdepapper, godtagbarhetskriterierna och förvaringsarrangemangen för dessa värdepapper anges i transaktionsdokumentationen. | Ej tillämpligt |
| STSSY153 | Artikel 26e.9 andra stycket | Investerare exponerade för originatorns kreditrisk | | √ | | En kortfattad beskrivning av att transaktionsdokumentationen anger om investerare är fortsatt exponerade för originatorns kreditrisk. | Ej tillämpligt |
| STSSY154 | Artikel 26e.9 tredje stycket | Juridiskt utlåtande som bekräftar att kreditriskskyddet är verkställbart inom alla territorier | √ | | | En bekräftelse av att originatorn har inhämtat ett utlåtande från en kvalificerad juridisk rådgivare som bekräftar att kreditriskskyddet är verkställbart inom alla relevanta territorier. | Ej tillämpligt |
| STSSY155 | Artikel 26e.10 första stycket led a | Säkerhet av hög kvalitet – Räntebärande värdepapper med en riskvikt på 0 % | | √ | | Om ett kreditriskskydd tillhandahålls i enlighet med artikel 26e.10 a i förordning (EU) 2017/2402 i form av sådana räntebärande värdepapper med en riskvikt på 0 % som avses i del tre avdelning II kapitel 2 i förordning (EU) nr 575/2013, en kortfattad beskrivning av att samtliga följande villkor är uppfyllda: i) Dessa räntebärande värdepapper har en återstående löptid på högst tre månader som inte är längre än den återstående tiden fram till nästa betalningsdatum. ii) Dessa räntebärande värdepapper kan lösas in mot ett kontantbelopp motsvarande det utestående saldot för den skyddade tranchen. iii) Dessa räntebärande värdepapper innehas av ett förvaringsinstitut som är oberoende av originatorn och investerarna. | Ej tillämpligt |

▼ **M1**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|---|-------------|------------------------|------------------------|--|-------------------------|
| STSSY156 | Artikel 26e.10 första stycket led b | Säkerhet av hög kvalitet – Kontanta medel som innehas av ett utomstående kreditinstitut med kreditkvalitetssteg 3 eller högre | | √ | | Om ett kreditriskskydd tillhandahålls i enlighet med artikel 26e.10 b i förordning (EU) 2017/2402, en kortfattad beskrivning av det säkerhetsarrangemang som ger originatorm och investeraren säkerhet i form av kontanta medel som innehas av ett utomstående kreditinstitut med kreditkvalitetssteg 3 eller högre i linje med mappningen som fastställs i artikel 136 i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |
| STSSY157 | Artikel 26e.10 andra stycket | Undantag – Säkerhet i form av kontanta medel som inlåning hos originatorm | | | √ | Om undantaget från artikel 26e.10 första stycket i förordning (EU) 2017/2402 används, en detaljerad beskrivning av säkerhetsarrangemanget och investerarens samtycke till detta som ger endast originatorm regressrätt till säkerhet av hög kvalitet i form av kontanta medel som inlåning hos originatorm eller ett av dess närstående företag. | Ej tillämpligt |
| STSSY158 | Artikel 26e.10 tredje stycket | Säkerhet i form av kontanta medel som inlåning hos originatorm – Tillstånd från behörig myndighet | | | √ | En detaljerad beskrivning av det tillstånd som getts av de behöriga myndigheter som utsetts enligt artikel 29.5 i förordning (EU) 2017/2402 om att säkerheter kan vara i form av kontanta medel som inlåning hos originatorm, eller ett av dess närstående företag, om originatorm eller ett av dess närstående företag uppfyller kraven för kreditkvalitetssteg 3 förutsatt att marknadssvårigheter, objektiva hinder som en följd av det kreditkvalitetssteg som tilldelats institutets medlemsstat eller betydande potentiella koncentrationsproblem i den berörda medlemsstaten som en följd av tillämpningen av det lägsta kreditkvalitetssteg 2 som avses i artikel 26e.10 andra stycket i förordning (EU) 2017/2402 kan dokumenteras. | Ej tillämpligt |

▼ **M1**

| Fältnummer | Artikel i förordning (EU) 2017/2402 | Fältets beteckning | Bekräftelse | Kortfattad beskrivning | Detaljerad beskrivning | Innehåll som ska rapporteras | Ytterligare information |
|------------|-------------------------------------|--|-------------|------------------------|------------------------|---|-------------------------|
| STSSY159 | Artikel 26e.10 fjärde stycket | Överföring av säkerhet om det utomstående kreditinstitutet eller originatorn inte längre uppfyller kraven för det lägsta kreditkvalitetssteget | | | √ | En detaljerad beskrivning av hur säkerheten överförs i enlighet med artikel 26e.10 fjärde stycket i förordning (EU) 2017/2402 om säkerheten hölls i form av kontanta medel som inlåning hos ett institut som inte längre uppfyller kraven för det lägsta kreditkvalitetssteget. | Ej tillämpligt |
| STSSY160 | Artikel 26e.10 femte stycket | Uppfyllande av kraven på säkerheter vid investeringar i kreditlänkade obligationer som emitterats av originatorn | √ | | | En bekräftelse av att det finns en investering i kreditlänkade obligationer som emitterats av originatorn i enlighet med artikel 218 i förordning (EU) nr 575/2013. | Ej tillämpligt |