

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2020/1229**av den 29 november 2019****om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 vad gäller tekniska tillsynsstandarder för värdepapperiseringsregisters operativa standarder för uppgiftsinsamling, aggregering, jämförelse, tillgång och kontroll av fullständighet och samstämmighet****(Text av betydelse för EES)**

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 av den 12 december 2017 om ett allmänt ramverk för värdepapperisering och om inrättande av ett särskilt ramverk för enkel, transparent och standardiserad värdepapperisering samt om ändring av direktiven 2009/65/EG, 2009/138/EG och 2011/61/EU och förordningarna (EG) nr 1060/2009 och (EU) nr 648/2012 ⁽¹⁾, särskilt artiklarna 10.7 a och 17.2 b, c och d, och

av följande skäl:

- (1) De enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 bör kunna fullgöra sitt ansvar och sina uppgifter och skyldigheter. De uppgifter som värdepapperiseringsregister lämnar till dessa enheter bör därför vara av hög kvalitet och kunna användas för aggregering och jämförelse mellan olika värdepapperiseringsregister på ett heltäckande och strukturerat sätt i lämplig tid. Värdepapperiseringsregister bör därför bedöma om uppgifterna är fullständiga och samstämmiga innan de görs tillgängliga för dessa enheter, och de bör förse enheterna med en rapport vid dagens slut och en samlad poäng för datafullständighet.
- (2) Förfarandena för att kontrollera att de uppgifter som originatorer, medverkande institut eller specialföretag för värdepapperisering rapporterar till värdepapperiseringsregister är fullständiga och samstämmiga bör beakta den variation som finns när det gäller olika typer av värdepapperisering, olika inslag och olika metoder. Det är därför lämpligt att föreskriva kontrollförfaranden där det ingår jämförelse av de rapporterade uppgifterna med avseende på liknande värdepapperiseringar, såsom värdepapperiseringar med samma eller närstående originator, typ av underliggande exponering, strukturella inslag eller geografiskt område.
- (3) För att säkerställa att de rapporterade uppgifterna håller god kvalitet bör förfarandena också innefatta kontroll av att den dokumentation som stöder uppgifterna är fullständig och samstämmig. Med tanke på att det är relativt svårt att kontrollera att dokumentationen är fullständig och samstämmig, bör värdepapperiseringsregistren begära en skriftlig bekräftelse från de rapporterade enheterna på att så är fallet för den underliggande värdepapperiseringsdokumentation som de tillhandahåller. Väsentliga uppdateringar av redan rapporterad dokumentation bör betraktas som ny värdepapperiseringsdokumentation som kräver begäran om skriftlig bekräftelse.
- (4) För att göra det möjligt för de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 att fullgöra sitt ansvar och sina uppgifter och skyldigheter, bör de uppgifter om värdepapperiseringar som dessa enheter måste ha direkt och omedelbar tillgång till vara jämförbara mellan värdepapperiseringsregister på ett harmoniserat och samstämmigt sätt. Uppgifterna bör därför lämnas i xml-format (Extensible Markup Language), eftersom det formatet används i stor utsträckning inom finansbranschen.
- (5) Konfidentialitet bör säkerställas för alla typer av uppgifter som utbyts mellan värdepapperiseringsregister och de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402. Sådana utbyten bör därför ske genom en säker maskin-till-maskin-uppkoppling med hjälp av datakrypteringsprotokoll. För att säkerställa gemensamma minimistandarder bör SSH-filöverföringsprotokoll användas.

⁽¹⁾ EUT L 347, 28.12.2017, s. 35.

- (6) Aktuella uppgifter om värdepapperiseringars underliggande exponeringar, investerarrapporter, insiderinformation och information om viktiga händelser samt indikatorer på dessa uppgifters kvalitet och aktualitet är centralt för löpande övervakning av investeringspositioner i värdepapperiseringar och potentiella investeringar samt finansiell stabilitet och systemrisk. De enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 bör därför ges särskild eller fördefinierad regelbunden tillgång till dessa uppgifter, i proportion till deras behov.
- (7) Värdepapperiseringar är komplexa och heterogena, och användarna med tillgång till uppgifter från värdepapperiseringsregister är av många olika slag. Det är därför viktigt att underlätta direkt och omedelbar tillgång till specifika datamängder och uppgifter. Tillgången bör omfatta åtkomst i ett maskinläsbart format till information som utgörs av data och alla aktuella och historiska uppgifter om en värdepapperisering som lagras i ett register. Därför bör det inrättas ett system för särskilda begäranden, som kan kombineras för att erhålla specifik information. Tidsfristerna för när värdepapperiseringsregister bör lämna uppgifter till de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 bör harmoniseras för att underlätta en effektiv behandling av uppgifterna från dessa enheters och värdepapperiseringsregisters sida. Samtidigt bör det säkerställas att de enheter som begär uppgifterna får dem inom tidsfrister som gör det möjligt för dem att fullgöra sitt ansvar.
- (8) De enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 förlitar sig på värdepapperiseringsregistrens uppgifter bland annat för att jämföra aktuella värdepapperiseringar med tidigare värdepapperiseringar. Det är därför lämpligt att precisera att registren bör bevara uppgifterna om en värdepapperisering i tio år efter det att värdepapperiseringen har löpt ut, i enlighet med artikel 10.2 i förordning (EU) 2017/2402 och artikel 80.3 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012^(?).
- (9) Bestämmelserna i denna förordning är nära kopplade till varandra, eftersom de handlar om standarder och förfaranden för insamling och bearbetning av uppgifter som innehas av värdepapperiseringsregister och tillgång till dessa uppgifter. Det är därför lämpligt att samla bestämmelserna i en enda förordning.
- (10) Denna förordning grundar sig på det förslag till tekniska tillsynsstandarder som Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) har överlämnat till kommissionen.
- (11) Esma har anordnat ett öppet offentligt samråd om det förslag till tekniska tillsynsstandarder som den här förordningen bygger på, analyserat möjliga kostnader och fördelar samt begärt in synpunkter från den intressentgrupp för värdepapper och marknader som inrättats i enlighet med artikel 37 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010^(?).

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Definitioner

I denna förordning gäller följande definitioner:

- a) *rapporterande enhet*: den enhet som utsetts i enlighet med artikel 7.2 första stycket i förordning (EU) 2017/2402.
- b) *brytdatum för inlämning av data*: referensdatumet för den information som rapporteras i enlighet med delegerad förordning (EU) 2020/1224^(*).

^(?) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 648/2012 av den 4 juli 2012 om OTC-derivat, centrala motparter och transaktionsregister (EUT L 201, 27.7.2012, s. 1).

^(?) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/77/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 84).

^(*) 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 värdepapperiseringar som ska tillgängliggöras av originatorn, det medverkande institutet och specialföretaget för värdepapperisering (se sidan 1 i detta nummer av EUT)..

Artikel 2

Rapport vid dagens slut

1. Värdepapperiseringsregister ska dagligen upprätta en samlad rapport vid dagens slut för alla värdepapperiseringar som rapporterats till dem, med undantag för de rapporterade värdepapperiseringar som avvisats i enlighet med artikel 4.6. Rapporten ska baseras på de senast rapporterade uppgifterna, den ska inte ta med några rapporterade värdepapperiseringar som har avvisats i enlighet med artikel 4.6 och den ska innefatta åtminstone följande uppgifter:

- a) Den unika identifieringskod som tilldelats i enlighet med artikel 11 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.
- b) ISIN-koder för trancher, obligationer eller efterställda lån i värdepapperiseringen, om tillgängliga.
- c) Summan av aktuella kapitalbeloppsbalanser för alla trancher, obligationer eller efterställda lån i värdepapperiseringen, i euro, med hjälp av växelkurser offentliggjorda på Europeiska centralbankens webbplats föregående arbetsdag.
- d) Värdepapperiseringens beteckning.
- e) Uppgift om huruvida värdepapperiseringen är en ABCP-värdepapperisering eller en icke-ABCP-värdepapperisering.
- f) Om värdepapperiseringen har en struktur av typ masterfond, "M", enligt rapporteringen i fält SESS9 i bilaga XIV till delegerad förordning (EU) .../... [kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224 eller av typ "S" för alla andra värdepapperiseringar.
- g) Om värdepapperiseringens risköverföringsmetod är "T" för äkta värdepapperiseringar enligt rapporteringen i fält IVSS11 i bilaga XII till delegerad förordning (EU) 2020/1224 eller "S" för syntetiska värdepapperiseringar enligt rapporteringen i fält SESV11 i bilaga XIV till den förordningen, eller "ABCP" för ABCP-värdepapperiseringar.
- h) Namn och identifieringskod för juridisk person (LEI) för originatorn, det medverkande institutet och specialföretaget för värdepapperisering.
- i) Den senaste dagen för räntebetalning i datumformat enligt ISO 8601.
- j) Tidsstämpel, i datum- och tidsformat enligt ISO 8601 (UTC), angiven?? till närmaste sekund, för den senaste datainlämning som värdepapperiseringsregistret tagit emot, eller, om flera datainlämningar refererar till samma brytdatum, tidsstämplar, i datum- och tidsformat enligt ISO 8601 (UTC) för de tidigaste och de senaste datainlämningarna med samma brytdatum.
- k) Brytdatum för inlämning av data, i datumformat enligt ISO 8601, för den senaste datainlämning som värdepapperiseringsregistret tagit emot.
- l) Antalet datainlämningar som värdepapperiseringsregistret tagit emot som refererar till samma brytdatum vilket anges i led k.
- m) Poäng för datafullständighet enligt artikel 3 för den senaste datainlämning som värdepapperiseringsregistret tagit emot.
- n) För icke-ABCP-värdepapperiseringar, originatorns eller den ursprungliga långgivarens etableringsland.
- o) För ABCP-värdepapperiseringar, det medverkande institutets etableringsland.
- p) Det land där de flesta av de underliggande exponeringarna finns, i termer av deras aktuella kapitalbeloppsbalans.
- q) Den vanligaste typen av underliggande exponeringar i värdepapperiseringen, i termer av deras aktuella kapitalbeloppsbalans.
- r) Vid tillämpning av led n, om de underliggande exponeringarna utgör en kombination av exponeringar från flera originatorer eller ursprungliga långgivare, ska originatorns eller den ursprungliga långgivarens etableringsland vara etableringslandet för den originator eller ursprungliga långgivare som står för det största exponeringsbeloppet, i termer av aktuell kapitalbeloppsbalans i värdepapperiseringen.

2. Värdepapperiseringsregister ska göra rapporten vid dagens slut tillgänglig i xml-format.

3. Tidsstämplar som avses i denna artikel får inte avvika med mer än en sekund från UTC som utfärdas och upprätthålls av en av de tidscentraler som förtecknas i den senaste årsrapporten om tidsaktiviteter från Internationella byrån för mått och vikt (BIPM).

Artikel 3

Poäng för datafullständighet

4. Värdepapperiseringsregister ska beräkna en poäng för datafullständighet för varje datainlämning genom att använda den matris som anges i tabell 1 i bilagan och följande indata:

$$\text{Input 1} = \frac{\sum_i^N ND1}{N}$$

$$\text{Input 2} = \frac{\sum_i^N ND2 + \sum_i^N ND3 + \sum_i^N ND4}{N}$$

där $\sum_i^N NDx$ anger det totala antalet fält i en datainlämning som innehåller de olika "inga data"-valmöjligheter som rapporteras i enlighet med artikel 9.3 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.

N anger det totala antalet fält i datainlämningen där någon av de olika "inga data"-valmöjligheterna (ND1 till ND4) får rapporteras i enlighet med artikel 9.3 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.

Vid beräkning av poäng för datafullständighet ska fält som har fyllts i med användning av formatet ND4-ÅÅÅÅ-MM-DD förstås som ND4.

Artikel 4

Kontroll av att uppgifterna är fullständiga och samstämmiga

1. Värdepapperiseringsregister ska kontrollera att de uppgifter som rapporteras till dem är fullständiga och samstämmiga genom att kontrollera följande:

- a) Den rapporterade enhetens namn enligt rapportering i fält IVSS4 i bilaga XII eller i fält IVAS3 i bilaga XIII till delegerad förordning (EU) .../... [kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224.
- b) Huruvida datainlämningens postkod enligt rapportering i tabell 3 i bilaga I till delegerad förordning (EU) 2020/1224 är korrekt.

2. När det gäller de uppgifter som avses i artikel 7.1 a, e, f och g i förordning (EU) 2017/2402 ska värdepapperiseringsregister också kontrollera att informationen är fullständig och samstämmig genom att

- a) kontrollera att de rapporterade uppgifterna överensstämmer med strukturen och formatet i mallarna i bilagorna II–XV till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2020/1225 ⁽⁵⁾,
- b) jämföra de rapporterade uppgifterna:
 - i) över olika fält för samma brytdatum för inlämning av data och samma post för underliggande exponeringar, investerarrapport, insiderinformation eller viktig händelse,
 - ii) över olika poster för underliggande exponeringar, investerarrapport, insiderinformation eller viktig händelse för samma fält och samma brytdatum för inlämning av data,
 - iii) över samma post för underliggande exponeringar, investerarrapport, insiderinformation eller viktig händelse för samma fält och olika brytdatum för inlämning av data,
 - iv) över liknande värdepapperiseringar,

⁽⁵⁾ Kommissionens genomförandeförordning 2020/1225 av den 29 oktober 2019 om fastställande av genomförandestandarder vad gäller format och standardiserade mallar för tillgängliggörande av information och detaljerade uppgifter om en värdepapperisering av originatorn, det medverkande institutet och specialföretaget för värdepapperisering (se sidan 217 i detta nummer av EUT).

- c) kontrollera att brytdatumet för inlämning av data för de rapporterade uppgifterna och tidsstämpeln för datainlämningen följer artikel 10 i delegerad förordning (EU) 2020/1224,
- d) kontrollera att de "inga data"-valmöjligheter som anges i artikel 9.3 i delegerad förordning (EU) .../... [kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224 endast används när detta är tillåtet och inte hindrar att datainlämningen är tillräckligt representativ för de underliggande exponeringarna i värdepapperiseringen.

För ABCP-värdepapperiseringar ska hänvisningar till underliggande exponeringar i denna punkt förstås som hänvisningar till typer av underliggande exponeringar.

3. Värdepapperiseringsregister ska kontrollera att den dokumentation som gjorts tillgänglig för dem enligt artikel 7.1 b i förordning (EU) 2017/2402 är fullständig och samstämmig genom att begära att de rapporterande enheterna skriftligen bekräftar följande:

- a) Att alla poster som avses i tabell 3 i bilaga I till delegerade förordning (EU) 2020/1224 och som måste göras tillgängliga enligt artikel 7.1 b i förordning (EU) 2017/2402, har tillhandahållits värdepapperiseringsregistret.
- b) Att dokumentationen överensstämmer med värdepapperiseringens verkliga arrangemang och inslag.

4. Den skriftliga bekräftelse som avses i punkt 3 ska begäras inom följande tidsfrister:

- a) Inom fem arbetsdagar från den första emissionen av värdepapper inom värdepapperiseringen eller, för ABCP-värdepapperiseringar, inom fem arbetsdagar från den första emissionen av värdepapper inom ABCP-programmet.
- b) Var tolfte månad från och med dagen för de begäranden som avses i led a.
- c) Inom fem arbetsdagar efter det att ett nytt dokument har gjorts tillgängligt i enlighet med artikel 7.1 b i förordning (EU) 2017/2402.

Om ett värdepapperiseringsregister inte har fått en skriftlig bekräftelse inom 14 dagar från dagen för varje sådan begäran som avses i första stycket ska det begära att den rapporterande enheten lämnar den skriftliga bekräftelsen inom 14 dagar.

5. Ett värdepapperiseringsregister ska kontrollera att den STS-anmälan som avses i artikel 7.1 d i förordning (EU) 2017/2402, som har gjorts tillgänglig för det värdepapperiseringsregistret, överensstämmer med strukturen och formatet i mallarna i bilagorna till kommissionens genomförandeförordning (EU) 2020/1227 ⁽⁶⁾.

6. Ett värdepapperiseringsregister ska avvisa en datainlämning som är ofullständig eller ej samstämmig i enlighet med punkterna 1, 2 och 5, utom vad gäller punkt 2 b iii och iv. Värdepapperiseringsregistret ska tilldela datainlämningar som avvisas i enlighet med denna punkt en av de avvisningskategorier som anges i tabell 2 i bilagan.

7. Värdepapperiseringsregistret ska utan onödigt dröjsmål underrätta de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 om följande:

- a) Att de inlämnade uppgifterna är ofullständiga eller ej samstämmiga i enlighet med punkt 2 b iii och iv.
- b) Att värdepapperiseringsregistret inte har mottagit den skriftliga bekräftelse som avses i punkt 3.

8. Inom en timme efter mottagandet av de uppgifter som avses i artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402 ska värdepapperiseringsregister ge detaljerad återkoppling till rapporterande enheter om resultaten av de kontroller som utförts enligt punkterna 1, 2, 3 och 5, inbegripet eventuella avvisningskategorier som tilldelats i enlighet med punkt 6. Återkopplingen ska även innehålla minst följande uppgifter:

- a) Den unika identifieringskod som tilldelats värdepapperiseringen i enlighet med artikel 11 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.

⁽⁶⁾ Kommissionens genomförandeförordning (EU) 2020/1227 av den 12 november 2019 om fastställande av tekniska genomförandesstandarder vad gäller mallar för tillhandahållande av information i enlighet med kraven för STS-anmälan (se sidan 315 i detta nummer av EUT).

- b) Postkod eller postkoder som anges i tabell 3 i bilaga I till delegerad förordning (EU) 2020/1224.
 - c) Tidsstämpel, i datum- och tidsformat enligt ISO 8601 (UTC), till närmaste sekund, för datainlämningen med de rapporterade uppgifterna.
9. Till kl. 19.00.00 UTC varje måndag ska värdepapperiseringsregister sammanställa en rapport om alla uppgifter som det avvisat sedan kl. 19.00.00 UTC föregående måndag. Rapporten ska innehålla åtminstone följande poster:
- a) Den unika identifieringskod som tilldelats värdepapperiseringen i enlighet med artikel 11 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.
 - b) Värdepapperiseringens beteckning.
 - c) ISIN-koder för trancher, obligationer eller efterställda lån i värdepapperiseringen, om de är tillgängliga.
 - d) Namn och identifieringskod för juridisk person (LEI) för originatorn, det medverkande institutet och specialföretaget för värdepapperisering.
 - e) Tidsstämpel, i datum- och tidsformat enligt ISO 8601 (UTC), till närmaste sekund, för de inlämnade uppgifterna.
 - f) Postkod för datainlämningen som anges i tabell 3 i bilaga I till delegerad förordning (EU) 2020/1224.
 - g) Den avvisningskategori som avses i tabell 2 i bilagan till denna förordning och de särskilda omständigheter som ligger till grund för tilldelningen av denna kategori.
 - h) Alla eventuella förklaringar som den rapporterande enheten tillhandahållit före kl.17.00.00 UTC på måndagen för rapportens offentliggörande om varför den rapporterade informationen är ofullständig eller ej samstämmig, eller varför den skriftliga bekräftelse som avses i punkt 3 inte har lämnats.

Artikel 5

Uppgifter till vilka tillgång ska beviljas

De uppgifter som avses i artikel 17.2 c i förordning (EU) 2017/2402 är följande:

- a) Alla uppgifter som mottagits av värdepapperiseringsregistret från rapporterande enheter i enlighet med förordning (EU) 2017/2402.
- b) Den rapport vid dagens slut som avses i artikel 2, den poäng för datafullständighet som avses i artikel 3 och alla eventuella uppgifter som följer av de kontroller som utförts i enlighet med artikel 4 i denna förordning.
- c) Alla formler och beräknings- och aggregeringsmetoder som använts för att ta fram de uppgifter som avses i leden a och b.

Artikel 6

Villkor för tillgång till uppgifter

1. Tillgång till de uppgifter som avses i artikel 5 ska beviljas på begäran. Begäran om tillgång ska inkludera följande information:

- a) Namn på den enhet som begär tillgång.
- b) Kontaktperson vid den enhet som begär tillgång.
- c) Typ av enhet enligt artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 som begär tillgång.
- d) Namn på personerna inom enheten som begär tillgång vilka kommer att ha tillgång till de begärda uppgifterna.
- e) Identifieringsuppgifter för säker uppkoppling med SSH-filöverföringsprotokoll i enlighet med artikel 7.2.
- f) Angivande av om det är en särskild begäran eller en fördefinierad regelbunden begäran.

- g) Precisering av vilka uppgifter som begärs, på grundval av kombinationer av kriterierna i punkt 4.
 - h) All annan teknisk information som är relevant för den tillgång som enheten begär.
2. För tillämpningen av punkt 1 ska värdepapperiseringsregister
- a) utse en eller flera personer som ansvariga för kontakter med de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402,
 - b) på sin webbplats offentliggöra villkoren för tillgång till uppgifterna och instruktioner för att lämna in en begäran om tillgång till dem,
 - c) ge tillgång endast till de uppgifter som anges i begäran om tillgång,
 - d) så snart som möjligt, men senast 30 dagar efter en begäran om att skapa tillgång till dessa uppgifter, fastställa de tekniska arrangemang som är nödvändiga för att de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 ska kunna sända in begäranden om tillgång till uppgifterna.
3. Tillgång till de uppgifter som avses i artikel 5 ska beviljas inom följande tidsfrister:
- a) Senast kl. 19.00.00 UTC den dag som rapporten avser, för en särskild eller fördefinierad regelbunden begäran om en rapport vid dagens slut som avses i artikel 2.
 - b) Senast kl. 12.00.00 UTC den första dagen efter den dag då begäran om tillgång tagits emot, om uppgifterna rör en värdepapperisering som antingen ännu inte har prissatts eller ännu inte har löpt ut eller har löpt ut mindre än ett år före den dag då begäran sändes in.
 - c) Senast tre arbetsdagar efter den dag då begäran om tillgång tagits emot, om uppgifterna rör en värdepapperisering som har löpt ut mer än ett år före den dag då begäran sändes in.
 - d) Senast tre arbetsdagar efter den dag då begäran om tillgång tagits emot, om uppgifterna rör flera värdepapperiseringar som omfattas av både led b och led c.
4. Värdepapperiseringsregister ska bevilja de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402 tillgång till de uppgifter som avses i artikel 5, på grundval av kombinationer av följande kriterier:
- a) Typ av värdepapperisering. ABCP-värdepapperisering eller icke-ABCP-värdepapperisering.
 - b) Typ av värdepapperiseringsstruktur. Antingen "M" för masterfond, enligt rapporteringen i fält SESS9 i bilaga XIV till delegerad förordning (EU) 2020/1224 eller "S" för alla andra värdepapperiseringar.
 - c) Värdepapperiseringens risköverföringsmetod: Antingen "Y" för äkta värdepapperiseringar enligt rapporteringen i fält IVSS11 i bilaga XII till delegerad förordning (EU) 2020/1224, "Y" för syntetiska värdepapperiseringar enligt rapporteringen i fält SESV11 i bilaga XIV till den förordningen, eller "ABCP" för ABCP-värdepapperiseringar.
 - d) Värdepapperiseringens postkod.
 - e) Typ av underliggande exponeringar i värdepapperiseringen.
 - f) Avsnitt för de underliggande exponeringarna i värdepapperiseringen.
 - g) Avsnitt i mall för investerarrapport för värdepapperiseringen.
 - h) Avsnitt i mall för insiderinformation eller viktiga händelser för värdepapperiseringen.
 - i) Identifieringskod:
 - i) Unik identifieringskod.
 - ii) Transaktionsidentifierare.
 - iii) Internationellt standardnummer för värdepapper (ISIN-kod).

- iv) Identifieringskod för ny eller ursprunglig tranche/obligation.
 - v) Identifieringskod för ny eller ursprunglig underliggande exponering.
 - vi) Identifieringskod för ny eller ursprunglig gäldenär.
 - vii) Identifieringskod för juridisk person (LEI) för originatorn.
 - viii) Identifieringskod för juridisk person (LEI) för det medverkande institutet.
 - ix) Identifieringskod för juridisk person (LEI) för specialföretaget för värdepapperisering.
 - x) Identifieringskod för juridisk person (LEI) för ursprunglig långgivare.
 - xi) Identifieringskod för juridisk person (LEI) för CLO-förvaltaren.
- j) Geografi.
- i) Geografiskt område.
 - ii) Tillämplig lag.
- k) Datum och tid.
- i) Tidsstämpel för datainlämningen.
 - ii) Brytdatum för inlämning av data.
 - iii) Emissionsdatum för tranchen/obligationen.
 - iv) Laglig inlösendag för tranchen/obligationen.
 - v) Ursprungsdatum för underliggande exponering.
 - vi) Inlösendag för underliggande exponering.
- l) Valuta:
- i) Valuta för tranchen/obligationen.
 - ii) Valuta i vilken den underliggande exponeringen är denominerad.
5. Värdepapperiseringsregister ska göra följande uppgifter tillgängliga i xml-format:
- a) De uppgifter som avses i artikel 7.1 a och d–g i förordning (EU) 2017/2402.
 - b) De uppgifter som tas fram av värdepapperiseringsregister i enlighet med artiklarna 2 och 4 i denna förordning, med undantag för skriftliga bekräftelser som tagits emot i enlighet med artikel 4.3.

Artikel 7

Standarder för datainsamling och datatillgång

1. Värdepapperiseringsregister ska använda elektroniska signaturer och datakrypteringsprotokoll för att ta emot data från rapporterande enheter eller andra värdepapperiseringsregister och för att överföra data till de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402.
2. För tillämpningen av punkt 1 ska värdepapperiseringsregister inrätta och upprätthålla ett säkert maskin-till-maskin-gränssnitt och göra detta gränssnitt tillgängligt för de rapporterande enheterna och de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402. Gränssnittet ska använda SSH-filöverföringsprotokoll.
3. Värdepapperiseringsregister ska använda standardiserade xml-meddelanden för att kommunicera genom det gränssnitt som avses i punkt 2 och göra de uppgifter som anges i artikel 6.5 i denna förordning tillgängliga för de enheter som avses i artikel 17.1 i förordning (EU) 2017/2402.

*Artikel 8***Dokumentation**

1. Värdepapperiseringsregister ska dokumentera följande:
 - a) Kontroller enligt denna förordning och all annan validering som utförs av värdepapperiseringsregistret.
 - b) De skriftliga bekräftelser som värdepapperiseringsregistret har tagit emot enligt vad som avses i artikel 4.3.
 - c) De resultat som värdepapperiseringsregistret har lämnat till det rapporterande företaget enligt vad som avses i artikel 4.6.
 - d) Alla förklaringar från den rapporterande enheten med skälen till att de inlämnade uppgifterna är ofullständiga eller ej samstämmiga, eller till att det inte finns någon skriftlig bekräftelse i enlighet med artikel 4.7.
 - e) I en rapporteringsjournal, uppgifter om korrigeringar eller annulleringar som har gjorts av den rapporterande enheten.
 - f) All annan information som tagits fram eller lämnats in i enlighet med denna förordning.
2. Varje dokumenterad uppgift ska bevaras i tio år efter det att den värdepapperisering som den gäller har löpt ut.
3. Den rapporteringsjournal som avses i punkt 1 d ska innefatta värdepapperiseringens unika identifieringskod, postens kod, tidsstämpeln för den berörda datainlämningen, tidsstämpeln för ändringarna och en tydlig beskrivning av ändringarna av de inlämnade uppgifterna, inklusive tidigare och nytt innehåll i uppgifterna.

*Artikel 9***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.

Utfärdad i Bryssel den 29 november 2019.

På kommissionens vägnar
Ordföranden
Jean-Claude JUNCKER

BILAGA

Matris för poängsystem för datafullständighet och avvisningskategorier

Tabell 1

Matris för poängsystem för datafullständighet

		Indata 1: Procentandel fält som fyllts i med ND1			
		Indata 1 = 0 %	0 % < indata 1 ≤ 10 %	10 % < indata 1 ≤ 30 %	Indata 1 > 30 %
Indata 2: Procentandel fält som fyllts i med ND2, ND3, eller ND4-ÅÅÅÅ-MM-DD	Indata 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < indata 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < indata 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	Indata 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabell 2

Avvisningskategorier

Avvisningskategorier	Skäl
Databasschema	Datainlämningen avvisas eftersom databasschemat inte uppfyller villkoren.
Rättigheter	Datainlämningen avvisas eftersom den rapporterande enheten inte har rättighet att rapportera på uppdrag av originatorn, det medverkande institutet eller specialföretaget för värdepapperisering.
Logik	Datainlämningen avvisas eftersom postkoden inte överensstämmer med något av de värden som anges i tabell 3 i bilaga I till kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224.
Affärsrelaterat	Datainlämningen avvisas eftersom den inte uppfyller villkoren för en eller flera innehållsrelaterade valideringar.
Representativitet	Datainlämningen avvisas i enlighet med artikel 4.6.