KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2020/1229

af 29. november 2019

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for securitiseringsregistres operationelle standarder for dataindsamling, -aggregering, -sammenligning og -adgang og for kontrol af dataenes fuldstændighed og konsistens

(EØS-relevant tekst)

EUROPA-KOMMISSIONEN HAR —

under henvisning til traktaten om Den Europæiske Unions funktionsmåde,

under henvisning til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 af 12. december 2017 om en generel ramme for securitisering og om oprettelse af en specifik ramme for simpel, transparent og standardiseret securitisering og om ændring af direktiv 2009/65/EF, 2009/138/EF og 2011/61/EU og forordning (EF) nr. 1060/2009 og (EU) nr. 648/2012 ([1]), særlig artikel 10, stk. 7, litra a), og artikel 17, stk. 2, litra b), c) og d), og

ud fra følgende betragtninger:

(1) De enheder, der er omhandlet i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, bør være i stand til at opfylde deres respektive forpligtelser og mandater. De oplysninger, som securitiseringsregistre giver disse enheder, bør derfor være af høj kvalitet og bør være egnede til aggregering og sammenligning på tværs af forskellige securitiseringsregistre på en rettidig, struktureret og omfattende måde. Securitiseringsregistre bør derfor vurdere, om disse oplysninger er fuldstændige og konsistente, før de stilles til rådighed for disse enheder, og de bør give disse enheder en daglig slutrapport og en samlet score for dataenes fuldstændighed.

(2) Procedurerne for at kontrollere, om de oplysninger, der indberettes til securitiseringsregistre af eksponeringsleverende institutter, organiserende institutter eller SSPE'er, er fuldstændige og konsistente, bør tage hensyn til de forskellige securitiseringstyper, -egenskaber og -praksisser. Der bør derfor fastsættes kontrolprocedurer, som omfatter en sammenligning af de indberettede oplysninger med hensyn til tilsvarende securitiseringer, f.eks. securitiseringer, der har det samme eller forretningsmæssigt forbundne eksponeringsleverende institutter, den samme eller forbundne underliggende eksponeringstyper og de samme eller forbundne strukturelle kendetegn eller geografiske beliggenheder.

(3) For at sikre kvaliteten af de indberettede oplysninger bør kontrolprocedurerne også omfatte fuldstændigheden og konsistensen af den dokumentation, der ligger til grund for disse oplysninger. Da der imidlertid er relativt store vanskeligheder forbundet med at kontrollere fuldstændigheden og konsistensen af denne dokumentation, bør securitiseringsregistrene anmode de indberettende enheder om skriftligt at bekræfte, at dokumentationen for den underliggende securitisering, som de har stillet til rådighed, er fuldstændig og konsistent. Væsentlige opdateringer af dokumentation, der allerede er indberettet, bør betragtes som et nyt securitiseringsdokument, der kræver en skriftlig anmodning om bekræftelse.

(4) For at gøre det muligt for de enheder, der er omhandlet i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, at opfylde deres respektive forpligtelser og mandater, bør de nærmere oplysninger om securitiseringer, som disse enheder skal have direkte og øjeblikkelig adgang til, være sammenlignelige på tværs af securitiseringsregistrene på en harmoniseret og konsekvent måde. Disse oplysninger bør derfor anføres i Extensible Markup Language (XML), da dette format anvendes i vid udstrækning i den finansielle sektor.

(5) Fortroligheden af enhver type data, der udveksles mellem securitiseringsregistre og de enheder, der er omhandlet i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, bør sikres. Sådanne udvekslinger bør derfor foregå via en sikker forbindelse mellem maskiner ved hjælp af datakrypteringsprotokoller. For at sikre fælles minimumsstandarder bør der anvendes en SSH-filoverførselsprotokol.

([1]) EUT L 347 af 28.12.2017, s. 35.

(6) Data om de seneste securitiserede underliggende eksponeringer, investorrapporter, insiderviden og oplysninger om væsentlige hændelser samt indikatorer for disse datas kvalitet og rettidighed er afgørende for den løbende overvågning af securitiseringsinvesteringspositioner og potentielle investeringer samt finansiel stabilitet og systemisk risiko. De i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder bør derfor have adgang til disse data på ad hoc-basis eller i på forhånd fastsatte perioder i overensstemmelse med deres behov for at modtage dem.

(7) Securitiseringer er komplekse og heterogene, og de brugere, der tilgår oplysninger fra securitiseringsregistre, er forskellige. Det er derfor af afgørende betydning, at den direkte og umiddelbare adgang til specifikke datasæt og oplysninger lettes. Denne adgang bør omfatte adgang i et maskinlæsbart format, hvor oplysningerne vedrører data, og til alle aktuelle og historiske oplysninger om en securitisering, der er lagret i et register. Med henblik herpå bør der oprettes en ramme for ad hoc-anmodninger, der kan kombineres for at indhente specifikke oplysninger. De frister, inden for hvilke securitiseringsregistrene bør give oplysninger til de i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder, bør harmoniseres for at lette en effektiv databehandling i disse enheder og securitiseringsregistre. Samtidig bør det sikres, at data indhentes inden for frister, der gør det muligt effektivt at opfylde de anmodende enheders forpligtelser.

(8) De i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder er afhængige af data, der opbevares af securitiseringsregistre, bl.a. for at kunne sammenligne aktuelle securitiseringer med tidligere securitiseringer. Det er derfor hensigtsmæssigt at specificere, at registrene bør føre registre over en securitisering i 10 år, efter at securitiseringen er ophævet, jf. artikel 10, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402 og artikel 80, stk. 3, i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 ([2]).

(9) Bestemmelserne i denne forordning er tæt forbundne, da de omhandler standarder og procedurer for indsamling og behandling af oplysninger, som opbevares af securitiseringsregistre, og adgang til disse oplysninger. Disse bestemmelser bør derfor samles i en enkelt forordning.

(10) Denne forordning er baseret på det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA) har forelagt for Kommissionen.

(11) ESMA har afholdt en åben offentlig høring om det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som ligger til grund for denne forordning, analyseret de potentielle omkostninger og fordele samt anmodet interessentgruppen for værdipapirer og markeder, der er nedsat i henhold artikel 37 i Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010, om en udtalelse ([3]) —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Definitioner

I denne forordning forstås ved:

a) »indberettende enhed«: den enhed, som er udpeget i henhold til artikel 7, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402

b) »skæringsdag for indberetning af data«: referencedatoen for de oplysninger, der indberettes i henhold til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 ([4]).

([2]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 648/2012 af 4. juli 2012 om OTC-derivater, centrale modparter og transaktionsregistre (EUT L 201 af 27.7.2012, s. 1).

([3]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 1095/2010 af 24. november 2010 om oprettelse af en europæisk tilsynsmyndighed (Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed), om ændring af afgørelse nr. 716/2009/EF og om ophævelse af Kommissionens afgørelse 2009/77/EF (EUT L 331 af 15.12.2010, s. 84).

([4]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 af 16. oktober 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår de reguleringsmæssige tekniske standarder, som præciserer de oplysninger og de detaljer vedrørende en securitisering, som det eksponeringsleverende institut, det organiserende institut og SSPE'en skal stille til rådighed (se side 1 i denne EUT).

Artikel 2

Daglig slutrapport

1. Securitiseringsregistre skal dagligt udarbejde en samlet aggregeret daglig slutrapport for alle securitiseringer, der indberettes til dem, med undtagelse af enhver indberettet securitisering, der er blevet afvist i henhold til artikel 4, stk. 6. Denne rapport skal baseres på de seneste indberettede oplysninger, udelukke enhver indberettet securitisering, der er blevet afvist i overensstemmelse med artikel 4, stk. 6, og mindst indeholde følgende oplysninger:

a) den unikke identifikator tildelt i overensstemmelse med artikel XI i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224.

b) ISIN-koderne for trancherne, obligationerne eller de efterstillede lån i securitiseringen, hvis sådanne foreligger

c) summen af den aktuelle hovedstolssaldo for alle trancher, obligationer og efterstillede lån i securitiseringen i EUR ved brug af de valutakurser, der offentliggøres på Den Europæiske Centralbanks websted for den foregående arbejdsdag

d) securitiseringens navn

e) hvorvidt securitiseringen er en ABCP-securitisering eller en securitisering, der ikke er ABCP

f) hvorvidt securitiseringsstrukturtypen er type »M«, som står for Master Trust, som indberettet i felt SESS9 i bilag XIV til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 eller type »S« for alle andre securitiseringer

g) hvorvidt risikooverførselsmetoden for securitiseringen er »T« for et reelt salg som indberettet i felt IVS11 i bilag XII til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 eller »S« for en syntetisk securitisering som indberettet i felt SESV11 i bilag XIV til nævnte forordning eller »ABCP« for ABCP-securitiseringer

h) det eksponeringsleverende instituts, det organiserende instituts og SSPE'ens navn og identifikator for juridiske enheder (LEI)

i) den seneste rentebetaling i ISO 8601-datoformat

j) tidsstemplet, i ISO 8601-datoformat og -klokkeslætsformat (UTC), til nærmeste sekund, for den seneste dataindberetning, som er modtaget af securitiseringsregistret, eller, hvis der er angivet flere dataindberetninger, som der er henvist til i forhold til samme skæringsdag for indberetning af data, tidsstemplerne, i ISO 8601-datoformat og -klokkeslætsformat (UTC), for de tidligste og de seneste dataindberetninger med samme skæringsdag for indberetning af data

k) skæringsdag for indberetning af data, i ISO 8601-datoformat, for den seneste dataindberetning, som er modtaget af securitiseringsregistret

l) antallet af dataindberetninger, som er modtaget af securitiseringsregistret, og som der er henvist til i forhold til samme skæringsdag for indberetning af data, som er angivet i litra k)

m) den i artikel 3 omhandlede score for dataenes fuldstændighed for den seneste dataindberetning, som securitiserings-registret har modtaget

n) for securitiseringer, der ikke er ABCP, det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers etableringsland

o) for ABCP-securitiseringer, det organiserende instituts etableringsland

p) det land, hvor størstedelen af de underliggende eksponeringer er beliggende, udtrykt i den underliggende eksponerings aktuelle hovedstolssaldo

q) den mest fremherskende type af de underliggende eksponeringer i securitiseringen udtrykt i den aktuelle hovedstolssaldo.

r) Med henblik på litra n) gælder det, at hvis de underliggende securitiseringseksponeringer er en kombination af eksponeringer fra flere eksponeringsleverende institutter eller oprindelige långivere, er det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers etableringsland det land, hvor det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver har de største eksponeringer udtrykt i den aktuelle primære hovedstolssaldo for securitiseringen.

2. Securitiseringsregistrene skal udarbejde den daglig slutrapport i XML-format.

3. Tidsstempler som omhandlet i denne artikel må ikke afvige mere end et sekund fra det UTC, der udstedes og vedligeholdes af et af de tidscentre, der er opført i den seneste årsrapport om tidsaktiviteter fra Bureau International des Poids et Mesures (BIPM).

Artikel 3

Score for dataenes fuldstændighed

4. Securitiseringsregistrene skal beregne en score for dataenes fuldstændighed for hver dataindberetning ved hjælp af matrixen for scoren for dataenes fuldstændighed i tabel 1 i bilaget og følgende input:

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

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

Hvor:

$\sum_i^N NDx$ betegner det samlede antal felter i en dataindberetning indeholdende en af de relevante »No Data Option«-værdier, der indberettes i overensstemmelse med artikel 9, stk. 3, i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224.

N betegner det samlede antal felter i dataindberetningen, hvor det tillades, at en af »No Data Option«-værdierne (ND1-ND4) indberettes i overensstemmelse med artikel 9, stk. 3, i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224.

For så vidt angår beregningen af scoren for dataenes fuldstændighed, forstås felter, der er udfyldt med »ND4-YYYY-MM-DD« -formatet, som »ND4«.

Artikel 4

Kontrol af oplysningernes fuldstændighed og konsistens

1. Securitiseringsregistre skal kontrollere fuldstændigheden og konsistensen af de oplysninger, der indberettes til dem, ved at kontrollere følgende:

a) navnet på den indberettende enhed som indberettet i felt IVSS4 i bilag XII eller i felt IVAS3 i bilag XIII til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224.

b) hvorvidt den postkode, der er indberettet i tabel 3 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 er korrekt.

2. Med hensyn til de oplysninger, der er omhandlet i artikel 7, stk. 1, litra a), e), f) og g), i forordning (EU) 2017/2402, kontrollerer securitiseringsregistrene også oplysningernes fuldstændighed og konsistens ved at:

a) kontrollere, om de indberettede oplysninger er i overensstemmelse med strukturen og formatet af skemaerne i bilag II-XV til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1225 ([5])

b) kontrollere de indberettede oplysninger:

   i) på tværs af forskellige felter for samme skæringsdag for indberetning af data og samme underliggende eksponering, investorrapport, insiderviden eller oplysninger om væsentlige hændelser

   ii) på tværs af forskellige underliggende eksponeringer, investorrapporter, insiderviden eller oplysninger om væsentlige hændelser for samme felt og samme skæringsdag for indberetning af data

   iii) på tværs af samme underliggende eksponering, investorrapport, insiderviden eller oplysninger om væsentlige hændelser for samme felt og forskellige skæringsdage for indberetning af data

   iv) på tværs af ensartede securitiseringer

([5]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1225 af 29. oktober 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår de reguleringsmæssige tekniske standarder, som præciserer de oplysninger og de detaljer vedrørende en securitisering, som det eksponeringsleverende institut, det organiserende institut og SSPE'en skal stille til rådighed (se side 217 i denne EUT).

c) kontrollere, om skæringsdagen for indberetning af data for de indberettede oplysninger og tidsstemplet for indsendelsen er i overensstemmelse med artikel 10 i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224.

d) kontrollere, om de »No Data Options«, der er omhandlet i artikel 9, stk. 3, i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 kun anvendes, hvor det er tilladt, og ikke er til hinder for, at dataindberetningen er tilstrækkeligt repræsentativ for de underliggende eksponeringer i securitiseringen.

For ABCP-securitiseringer forstås henvisninger i dette stykke til underliggende eksponeringer som henvisninger til underliggende eksponeringstyper.

3. Securitiseringsregistre skal kontrollere fuldstændigheden og konsistensen af den dokumentation, der stilles til rådighed for dem i henhold til artikel 7, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/2402, ved at anmode de indberettende enheder om en skriftlig bekræftelse af følgende:

a) at securitiseringsregistret er blevet oplyst om alle de punkter, som er omhandlet i tabel 3 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224, og som skal stilles til rådighed i henhold til artikel 7, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/2402

b) at dokumentationen er i overensstemmelse med securitiseringens faktiske ordning og karakteristika.

4. Der anmodes om den i stk. 3 omhandlede skriftlige bekræftelse inden for følgende frister:

a) inden for fem arbejdsdage efter den første udstedelse af værdipapirer under securitiseringen eller, når der er tale om ABCP-securitiseringer, senest fem arbejdsdage efter den første udstedelse af værdipapirer under ABCP-programmet

b) hver tolvte måned fra datoerne for de i litra a) omhandlede anmodninger

c) inden for fem arbejdsdage, efter at et nyt dokument er blevet stillet til rådighed i henhold til artikel 7, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/2402.

Et securitiseringsregister, der ikke har modtaget en skriftlig bekræftelse inden for 14 dage efter datoen for en anmodning som omhandlet i første afsnit, skal anmode den indberettende enhed om at fremsende den skriftlige bekræftelse inden for 14 dage.

5. Securitiseringsregistre skal kontrollere, om den i artikel 7, stk. 1, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede STS-meddelelse, som er blevet stillet til rådighed for det pågældende securitiseringsregister, er i overensstemmelse med strukturen og formatet af skemaerne i bilagene til Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1227 ([6]).

6. Et securitiseringsregister skal afvise en indsendelse af oplysninger, der er ufuldstændige eller inkonsekvente i henhold til stk. 1, 2 og 5, bortset fra stk. 2, litra b), nr. iii) og iv). Securitiseringsregistret tildeler indsendelser, der afvises i henhold til dette stykke, en af de afvisningskategorier, der er anført i tabel 2 i bilaget.

7. Securitiseringsregistret underretter hurtigst muligt de i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder om følgende:

a) at de indsendte oplysninger er ufuldstændige eller inkonsekvente i henhold til stk. 2, litra b), nr. iii) og iv)

b) at securitiseringsregistret ikke har modtaget den i stk. 3 omhandlede skriftlige bekræftelse.

8. Securitiseringsregistrene skal senest en time efter modtagelsen af de i artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede oplysninger give de indberettende enheder detaljerede tilbagemeldinger om resultaterne af den kontrol, der er foretaget i henhold til stk. 1, 2, 3 og 5, herunder eventuelle afvisningskategorier, der er tildelt i henhold til stk. 6. Tilbagemeldingerne skal også mindst indeholde følgende:

a) securitiseringens unikke identifikator tildelt i overensstemmelse med artikel 11 i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224

([6]) Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1227 af 12. november 2019 om gennemførelsesmæssige tekniske standarder for skemaer til indberetning af oplysninger i overensstemmelse med STS-meddelelseskravene (se side 315 i denne EUT).

b) de(n) postkode(r), som er omhandlet i tabel 3 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224

c) tidsstemplet for indsendelsen, i ISO 8601-datoformat og -klokkeslætsformat (UTC), til nærmeste sekund, for de indberettede oplysninger.

9. Senest 19.00.00 UTC hver mandag udarbejder securitiseringsregistrene en rapport om alle de oplysninger, der er blevet afvist siden 19.00.00 UTC den foregående mandag. Rapporten skal som minimum indeholde følgende oplysninger:

a) securitiseringens unikke identifikator tildelt i overensstemmelse med artikel 11 i gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224

b) securitiseringens navn

c) ISIN-koderne for trancherne eller obligationerne eller de efterstillede lån i securitiseringen, hvis sådanne foreligger

d) det eksponeringsleverende instituts, det organiserende instituts og SSPE'ens navn og LEI

e) tidsstemplet, i ISO 8601-datoformat og -klokkeslætsformat (UTC), til nærmeste sekund, for de indsendte oplysninger

f) de(n) postkode(r), der er indsendt, og som er omhandlet i tabel 3 i bilag I til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224

g) den i tabel 2 i bilaget til denne forordning omhandlede afvisningskategori og de særlige omstændigheder for tildeling af denne afvisningskategori

h) en eventuel forklaring/eventuelle forklaringer, som den indberettende enhed har givet inden 17.00.00 UTC den mandag, hvor rapporten offentliggøres, om, hvorfor de indberettede oplysninger er ufuldstændige eller inkonsekvente, eller hvorfor den i stk. 3 omhandlede skriftlige bekræftelse ikke er blevet meddelt.

Artikel 5

Præcisering af de oplysninger, hvortil der skal gives adgang

De oplysninger, der er omhandlet i artikel 17, stk. 2, litra c), i forordning (EU) 2017/2402, præciseres på følgende måde:

a) alle oplysninger, som er modtaget af securitiseringsregistret fra indberettende enheder i overensstemmelse med forordning (EU) 2017/2402

b) den i artikel 2 omhandlede daglige slutrapport, den i artikel 3 omhandlede score for dataenes fuldstændighed og alle oplysninger, der følger af den kontrol, der er foretaget i henhold til artikel 4 i denne forordning

c) alle formler og metoder til beregning og aggregering, der anvendes til at tilvejebringe de oplysninger, der er omhandlet i litra a) og b).

Artikel 6

Vilkår og betingelser for adgang til nærmere oplysninger

1. Der gives efter anmodning adgang til de oplysninger, der er omhandlet i artikel 5. Anmodningen om adgang skal indeholde følgende oplysninger:

a) navnet på den anmodende enhed

b) den anmodende enheds kontaktperson

c) typen af den anmodende enhed, som anmoder om adgang, jf. artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402

d) navnene på de personer i den anmodende enhed, som vil få adgang til de ønskede oplysninger

e) oplysninger om sikker forbindelse for SSH-filoverførselsprotokol som krævet i artikel 7, stk. 2

f) hvorvidt anmodningen er en ad hoc-anmodning eller en på forhånd fastsat periodisk anmodning

g) præcisering af de oplysninger, der anmodes om, på grundlag af enhver kombination af kriterierne i stk. 4

h) andre tekniske oplysninger af relevans for den anmodende enheds adgang.

2. Med henblik på stk. 1 skal securitiseringsregistrene:

a) udpege en eller flere personer, som er ansvarlige for kontakten til de enheder, der er omhandlet i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402

b) på deres websted offentliggøre vilkårene og betingelserne for at få adgang til oplysningerne og instrukserne for indgivelse af en anmodning om adgang til disse oplysninger

c) kun give adgang til de oplysninger, der er anført i anmodningen om adgang

d) snarest muligt og senest 30 dage efter en anmodning om at få adgang til disse oplysninger fastlægge de tekniske bestemmelser, der er nødvendige for, at de enheder, der er omhandlet i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, kan indgive anmodninger om adgang til disse oplysninger.

3. Der gives adgang til de oplysninger, der er omhandlet i artikel 5, inden for følgende frister:

a) senest 19.00.00 UTC på den dag, som rapporten vedrører, i forbindelse med en ad hoc-anmodning eller en på forhånd fastsat periodisk anmodning om en daglig slutrapport som omhandlet i artikel 2

b) senest kl. 12.00.00 UTC den første dag efter modtagelsen af anmodningen om adgang, hvis oplysningerne vedrører en securitisering, der enten endnu ikke er prissat, endnu ikke er forfalden eller er forfalden mindre end et år før den dato, hvor anmodningen blev indgivet

c) senest tre arbejdsdage efter modtagelsen af anmodningen om adgang, hvis oplysningerne vedrører en securitisering, der er forfalden mindre end et år før den dato, hvor anmodningen blev indgivet

d) senest tre arbejdsdage efter datoen for modtagelsen af anmodningen om adgang, hvis oplysningerne vedrører flere securitiseringer, der henhører under både litra b) og c).

4. Securitiseringsregistre giver de i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder adgang til de i artikel 5 omhandlede oplysninger baseret på enhver kombination af følgende kriterier:

a) securitiseringstype: ikke-ABCP eller ABCP

b) securitiseringsstrukturtype: enten »M«, som står for Master Trust, som indberettet i felt SESS9 i bilag XIV til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224 eller »S« for alle andre securitiseringer

c) risikooverførselsmetode for securitiseringen: enten type »Y« for et reelt salg som indberettet i felt IVS11 i bilag XII til gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224, »Y« for en syntetisk securitisering som indberettet i felt SESV11 i bilag XIV til nævnte forordning eller »ABCP« for ABCP-securitiseringer

d) securitiseringspostkode

e) securitiseringens underliggende eksponeringstype

f) punktet om securitiseringens underliggende eksponering

g) punktet om investorrapportmodellen for securitiseringen

h) punktet om insiderviden eller modellen for oplysninger om væsentlige hændelser

i) identifikator:

   i) unik identifikator

   ii) transaktionsidentifikator

   iii) International Securities Identification Number (internationalt identifikationsnummer for værdipapirer)

iv) ny eller oprindelig identifikator for tranche/obligation

v) ny eller oprindelig identifikator for underliggende eksponering

vi) ny eller oprindelig identifikator for låntager

vii) identifikator for det eksponeringsleverende instituts juridiske enhed

viii) identifikator for det organiserende instituts juridiske enhed

ix) identifikator for SSPE'ens juridiske enhed

x) identifikator for den oprindelige långivers juridiske enhed

xi) identifikator for CLO-forvalterens juridiske enhed

j) geografi:

i) geografisk område

ii) lovvalg

k) dato og tidspunkt:

i) tidsstemplet for indsendelsen

ii) skæringsdag for indberetning af data

iii) udstedelsesdato for tranche/obligation

iv) tranches/obligations ubetingede udløb

v) underliggende eksponerings indgåelsesdato

vi) underliggende eksponerings forfaldsdato

l) valuta:

i) tranchens/obligationens valuta

ii) underliggende eksponerings valutadenominering.

5. Securitiseringsregistrene stiller følgende oplysninger til rådighed i XML-format:

a) de i artikel 7, stk. 1, litra a) og litra d) -g), i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede oplysninger

b) oplysninger produceret af securitiseringsregistre i overensstemmelse med artikel 2 og 4 i denne forordning med undtagelse af skriftlige bekræftelser, der er modtaget i henhold til artikel 4, stk. 3.

Artikel 7

Standarder for dataindsamling og -adgang

1. Securitiseringsregistre skal anvende elektroniske signatur- og datakrypteringsprotokoller til at modtage data fra indberettende enheder eller andre securitiseringsregistre og overføre data til de i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder.

2. I forbindelse med stk. 1 skal securitiseringsregistre oprette og vedligeholde en sikker grænseflade mellem maskiner og stille denne grænseflade til rådighed for de indberettende enheder og de i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder. Denne grænseflade skal gøre brug af SSH-filoverførselsprotokollen.

3. Securitiseringsregistre skal anvende standardiserede XML-meddelelser til at kommunikere via den i stk. 2 omhandlede grænseflade og stille de i artikel 6, stk. 5, i denne forordning omhandlede oplysninger til rådighed for de i artikel 17, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402 omhandlede enheder.

Artikel 8

Opbevaring af dokumentation

1. Securitiseringsregistre skal opbevare følgende:

a) dokumentation for kontroller i henhold til denne forordning og enhver anden validering udført af securitiseringsregistret

b) de skriftlige bekræftelser modtaget af securitiseringsregistret, jf. artikel 4, stk. 3

c) de resultater, som securitiseringsregistret giver til den indberettende enhed i henhold til artikel 4, stk. 6

d) en eventuel redegørelse fra den indberettende enhed for årsagen til, at de indsendte oplysninger er ufuldstændige eller inkonsekvente, eller at der ikke foreligger nogen skriftlig bekræftelse som omhandlet i artikel 4, stk. 7

e) i en indberetningslog, de nærmere oplysninger om eventuelle korrektioner eller annulleringer indsendt af den indberettende enhed

f) alle andre oplysninger produceret eller indsendt i henhold til denne forordning.

2. Al dokumentation opbevares i 10 år efter ophævelsen af den securitisering, som den pågældende dokumentation vedrører.

3. Den i stk. 1, litra d), omhandlede indberetningslog skal omfatte den entydige identifikator for securitiseringen, postkoden, tidsstemplet for den berørte indsendelse, tidsstemplet for ændringerne og en klar beskrivelse af ændringerne af de indsendte oplysninger, herunder det tidligere og nye indhold af de pågældende oplysninger.

Artikel 9

Ikrafttræden

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

Udfærdiget i Bruxelles, den 29. november 2019.

På Kommissionens vegne
Formand
Jean-Claude JUNCKER

BILAG

Matrix for scoren for dataenes fuldstændighed og afvisningskategorier

Tabel 1

Matrix for scoren for dataenes fuldstændighed

		Input 1: Procentdelen af felter, der er registreret som »ND1«			
		Input 1 = 0 %	0 % < Input 1 ≤ 10 %	10 % < Input 1 ≤ 30 %	Input 1 > 30 %
Input 2: Procentdelen af felter, der er registreret som »ND2«, »ND3« eller »ND4-YYYY-MM-DD«	Input 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < Input 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < Input 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	Input 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabel 2

Afvisningskategorier

Afvisningskategorier	**Årsag**
Skema	Indsendelsen af oplysninger er blevet afvist, fordi skemaet ikke opfylder kravene.
Tilladelse	Indsendelsen af oplysninger er blevet afvist, fordi den indberettende enhed ikke har fået tilladelse til at rapportere på det eksponeringsleverende instituts, det organiserende instituts eller SSPE'ens vegne.
Logik	Indsendelsen af oplysninger er blevet afvist, fordi postkoden ikke stemmer overens med de tilgængelige værdier i tabel 3 i bilag 1 i Kommissionens gennemførelsesforordning (EU) 2020/1224.
Virksomhed	Indsendelsen af oplysninger er blevet afvist, fordi dataindberetningen ikke er i overensstemmelse med en eller flere indholdsvalideringer.
Repræsentativitet	Indsendelsen af oplysninger er blevet afvist i henhold til artikel 4, stk. 6.