A BIZOTTSÁG (EU) 2020/1229 FELHATALMAZÁSON ALAPULÓ RENDELETE

(2019. november 29.)

az (EU) 2017/2402 európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az adatok gyűjtéséről, összesítéséről, összehasonlításáról, az adatokhoz való hozzáférésről, valamint a hiánytalanság és egységesség ellenőrzéséről szóló értékpapírosítási adattári operatív standardokra vonatkozó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről

(EGT-vonatkozású szöveg)

AZ EURÓPAI BIZOTTSÁG,

tekintettel az Európai Unió működéséről szóló szerződésre,

tekintettel az értékpapírosítás általános keretrendszerének meghatározásáról, az egyszerű, átlátható és egységesített értékpapírosítás egyedi keretrendszerének létrehozásáról, valamint a 2009/65/EK, a 2009/138/EK és a 2011/61/EU irányelv és az 1060/2009/EK és a 648/2012/EU rendelet módosításáról szóló, 2017. december 12-i (EU) 2017/2402 Európai Parlament és tanácsi rendeletre [1] és különösen annak 10. cikke (7) bekezdésének a) pontjára, valamint 17. cikke (2) bekezdésének b), c) és d) pontjára,

mivel:

(1) Az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezeteknek képesnek kell lenniük feladataik ellátására, valamint megbízatásuk és kötelezettségeik teljesítésére. Az értékpapírosítási adattárak által ezen szervezetek rendelkezésére bocsátott információnak ezért kiváló minőségűnek, valamint az értékpapírosítási adattárak közötti, időben, strukturált és átfogó módon történő összesítésre és összehasonlításra alkalmasnak kell lennie. Az értékpapírosítási adattáraknak ezért értékelniük kell, hogy az adott információ hiánytalan és egységes-e, mielőtt azt az említett szervezetek rendelkezésére bocsátják, továbbá egy napvégi jelentést és egy átfogó adathiánytalansági pontszámot biztosítanak az említett szervezetek részére.

(2) Az értékpapírosítást kezdeményezők, a szponzorok vagy a különleges célú gazdasági egységek által az értékpapírosítási adattárnak szolgáltatott információk hiánytalanságának és egységességének ellenőrzésére szolgáló eljárásoknak figyelembe kell venniük az értékpapírosítási típusok, jellemzők és gyakorlatok sokféleségét. Helyénvaló ezért előírni, hogy az ellenőrzési eljárások magukban foglalják a hasonló értékpapírosításokra, például ugyanazon vagy kapcsolódó értékpapírosítást kezdeményezővel, alapul szolgáló kitettségtípussal, strukturális vagy földrajzi jellemzővel rendelkező értékpapírosításokra vonatkozóan szolgáltatott információk összehasonlítását.

(3) A szolgáltatott információk minőségének biztosítása érdekében az ellenőrzési eljárásokat alkalmazni kell az említett információkat alátámasztó dokumentáció hiánytalanságára és egységességére is. Mivel azonban viszonylag nehéz a szóban forgó dokumentáció hiánytalanságának és egységességének ellenőrzése, az értékpapírosítási adattáraknak kérniük kell az adatszolgáltató szervezeteket annak írásbeli megerősítésére, hogy az általuk rendelkezésre bocsátott alapul szolgáló értékpapírosítási dokumentáció hiánytalan és egységes. A már benyújtott dokumentáció lényeges frissítése írásbeli megerősítés iránti kérést szükségessé tevő új értékpapírosítási dokumentációnak tekintendő.

(4) Annak érdekében, hogy az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek elláthassák feladataikat és teljesíthessék megbízatásaikat és kötelezettségeiket, azon értékpapírosítási adatoknak, amelyekhez az említett szervezeteknek közvetlen és azonnali hozzáféréssel kell rendelkezniük, harmonizált és egységes módon összehasonlíthatóknak kell lenniük az értékpapírosítási adattárak között. Ezeket az adatokat ezért bővíthető jelölőnyelv (XML) formátumban kell megadni, mivel a pénzügyi ágazatban széles körben használják ezt a formátumot.

(5) Az értékpapírosítási adattárak és az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek közötti adatcserének minden esetben bizalmas jellegűnek kell lennie. Az ilyen adatcseréket ezért adattitkosítási protokollok alkalmazásával, biztonságos, gépek közötti kapcsolaton keresztül kell végrehajtani. Az egységes minimumkövetelmények biztosítása érdekében SSH fájlátviteli protokollt kell használni.

[1] HL L 347., 2017.12.28., 35. o.

(6) A legutóbbi, az értékpapírosítás alapjául szolgáló kitettségekkel, a befektetői jelentésekkel, a belső információkkal és a jelentős eseményekre vonatkozó információkkal kapcsolatos adatok, valamint az adatok minőségére és időszerűségére vonatkozó mutatók alapvető fontosságúak az értékpapírosítási befektetési pozíciók és a potenciális befektetések, valamint a pénzügyi stabilitás és a rendszerszintű kockázat folyamatos nyomon követéséhez. Az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezeteknek ezért eseti jelleggel vagy előre meghatározott időközönként, az adatszükségleteikkel arányosan hozzá kell férniük ezekhez az adatokhoz.

(7) Az értékpapírosítások összetettek és heterogének, az értékpapírosítási adattárakban lévő információkhoz hozzáférő felhasználók pedig sokfélék. Ezért alapvetően fontos könnyített, közvetlen és azonnali hozzáférést biztosítani meghatározott adatkészletekhez és információkhoz. Ezt a hozzáférést adatok esetében géppel olvasható formátumban kell biztosítani, és a hozzáférésnek az adott értékpapírosítás kapcsán egy adattáron belül tárolt összes aktuális és múltbeli információra ki kell terjednie. E célból létre kell hozni egy keretet a meghatározott információkhoz való hozzájutást célzó, kombinálható eseti kérések számára. Az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek és az értékpapírosítási adattárak általi adatfeldolgozás hatékonyságának növelése érdekében össze kell hangolni azokat a határidőket, ameddig az értékpapírosítási adattáraknak az említett szervezetek rendelkezésére kell bocsátaniuk az adatokat. Ugyanakkor biztosítani kell, hogy az adatokhoz való hozzájutás olyan határidőkön belül valósuljon meg, amelyek lehetővé teszik a kérelmező szervezetek feladatainak hatékony ellátását.

(8) Az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek az értékpapírosítási adattárak által kezelt adatokra támaszkodnak, többek között a jelenlegi értékpapírosítások és a múltbeli értékpapírosítások összehasonlítása céljából. Célszerű ezért meghatározni, hogy az adattáraknak az értékpapírosítás lezárását követő 10 éven át meg kell őrizniük az adott értékpapírosítás adatait, az (EU) 2017/2402 rendelet 10. cikkének (2) bekezdése és a 648/2012/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet ([2]) 80. cikkének (3) bekezdése szerint.

(9) Az e rendeletben foglalt rendelkezések szorosan kapcsolódnak egymáshoz, mivel az értékpapírosítási adattárak által tartott információk gyűjtéséhez és feldolgozásához, és az ezen információkhoz való hozzáféréshez kapcsolódó standardokat és eljárásokat határozzák meg. Célszerű ezért ezeket a rendelkezéseket egyetlen rendeletbe foglalni.

(10) Ez a rendelet az Európai Értékpapírpiaci Hatóság (ESMA) által a Bizottsághoz benyújtott szabályozástechnikai standardtervezeteken alapul.

(11) Az ESMA nyilvános konzultációt folytatott az e rendelet alapját képező szabályozástechnikai standardtervezetekről, elemezte az esetlegesen kapcsolódó költségeket és hasznot, továbbá kikérte az 1095/2010/EU európai parlamenti és tanácsi rendelet ([3]) 37. cikkével összhangban létrehozott Értékpapírpiaci Érdekképviseleti Csoport véleményét,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

1. cikk

Fogalommeghatározások

E rendelet alkalmazásában:

a) „adatszolgáltató szervezet”: az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikkének (2) bekezdése szerinti szervezet;

b) „adatszolgáltatás zárónapja”: az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelettel ([4]) összhangban szolgáltatott információk vonatkozási időpontja.

([2]) Az Európai Parlament és a Tanács 648/2012/EU rendelete (2012. július 4.) a tőzsdén kívüli származtatott ügyletekről, a központi szerződő felekről és a kereskedési adattárakról (HL L 201., 2012.7.27., 1. o.).

([3]) Az Európai Parlament és a Tanács 1095/2010/EU rendelete (2010. november 24.) az európai felügyeleti hatóság (Európai Értékpapírpiaci Hatóság) létrehozásáról, a 716/2009/EK határozat módosításáról és a 2009/77/EK bizottsági határozat hatályon kívül helyezéséről (HL L 331., 2010.12.15., 84. o.).

([4]) A Bizottság (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelete (2019. október 16.) az (EU) 2017/2402 európai parlamenti és tanácsi rendeletnek az értékpapírosítást kezdeményező, a szponzor és a különleges célú gazdasági egység által az értékpapírosítással kapcsolatosan rendelkezésre bocsátandó információkat és adatokat meghatározó szabályozástechnikai standardok tekintetében történő kiegészítéséről (lásd e Hivatalos Lap 1 oldalát).

2. cikk

Napvégi jelentés

(1) Az értékpapírosítási adattárak naponta előállítanak egyetlen összevont napvégi jelentést a nekik bejelentett összes értékpapírosításra vonatkozóan, kivéve az olyan értékpapírosítási adatszolgáltatásokat, amelyeket a 4. cikk (6) bekezdésének megfelelően elutasítottak. A szóban forgó jelentésnek a legfrissebb szolgáltatott információkon kell alapulnia, nem foglalhatja magában a 4. cikk (6) bekezdésének megfelelően elutasított értékpapírosítási adatszolgáltatásokat, és legalább a következő információkat tartalmaznia kell:

a) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet XI. cikkével összhangban kiosztott egyedi azonosító;

b) az értékpapírosításhoz tartozó ügyletrészsorozatok, kötvények vagy alárendelt hitelek ISIN kódja, ha rendelkezésre áll;

c) az értékpapírosításhoz tartozó összes ügyletrészsorozat, kötvény vagy alárendelt hitel aktuális tőkeegyenlegének összege, EUR-ban, az Európai Központi Bank honlapján az előző munkanapra vonatkozóan közzétett árfolyamok felhasználásával;

d) az értékpapírosítás neve;

e) az értékpapírosítás ABCP vagy nem ABCP-értékpapírosítás;

f) az értékpapírosítási struktúra típusa: „M” az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet XIV. mellékletének SESS9 mezőjében feltüntetettek szerinti bizalmi vagyonkezelés esetén, vagy „S” minden egyéb értékpapírosítás esetén;

g) az értékpapírosítás kockázatátruházási módszerének típusa: „T” az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet XII. mellékletének IVSS11 mezőjében feltüntetettek szerinti valós értékesítés esetén, vagy „S” az említett rendelet XIV. mellékletének SESV11 mezőjében feltüntetettek szerinti szintetikus értékpapírosítás esetén, vagy „ABCP” az ABCP-értékpapírosítások esetén;

h) az értékpapírosítást kezdeményező, a szponzor és a különleges célú gazdasági egység neve és jogalany-azonosítója („LEI”);

i) a legutóbbi kamatfizetés dátuma ISO 8601 szabvány szerinti dátumformátumban;

j) az értékpapírosítási adattárhoz beérkezett legutolsó adatszolgáltatás másodperces pontosságú időbélyegzője az ISO 8601 szabvány szerinti dátum- és időformátumban (UCT), vagy ha ugyanazzal az adatszolgáltatási zárónappal több adatszolgáltatás történt, az ugyanazzal az adatszolgáltatási zárónappal rendelkező legkorábbi és legutolsó adatszolgáltatás időbélyegzője az ISO 8601 szabvány szerinti dátum- és időformátumban (UCT);

k) az értékpapírosítási adattárhoz beérkezett legutolsó adatszolgáltatás adatszolgáltatási zárónapja, ISO 8601 szabvány szerinti dátumformátumban;

l) az értékpapírosítási adattárhoz beérkezett olyan adatszolgáltatások száma, amelyek ugyanazzal a k) pontban meghatározott adatszolgáltatási zárónappal rendelkeznek;

m) az értékpapírosítási adattárhoz beérkezett legutolsó adatszolgáltatás 3. cikkben említett adathiánytalansági pontszáma;

n) nem ABCP-értékpapírosítás esetén az értékpapírosítást kezdeményező vagy az eredeti hitelező székhelye szerinti ország;

o) ABCP-értékpapírosítás esetén a szponzor székhelye szerinti ország;

p) az az ország, ahol az alapul szolgáló kitettségek aktuális tőkeegyenlegét tekintve az alapul szolgáló kitettségek többsége található;

q) az aktuális tőkeegyenleget tekintve az értékpapírosításban lévő alapul szolgáló kitettségek leggyakoribb típusa.

r) Az n) pont alkalmazásában, ha az értékpapírosítás alapjául szolgáló kitettségek több értékpapírosítást kezdeményezőtől vagy eredeti hitelezőtől származó kitettségek kombinációjából állnak, akkor az értékpapírosítást kezdeményező vagy az eredeti hitelező székhelye szerinti ország annak az értékpapírosítást kezdeményezőnek vagy eredeti hitelezőnek az országa, amely az aktuális tőkeegyenleget tekintve a legtöbb kitettséggel rendelkezik az értékpapírosításban.

(2) Az értékpapírosítási adattárak a napvégi jelentést XML formátumban bocsátják rendelkezésre.

(3) Az ebben a cikkben említett időbélyegzők legfeljebb egy másodperccel térhetnek el a Nemzetközi Mérésügyi Irodának az időméréshez kapcsolódó tevékenységekről szóló legutóbbi éves jelentésében felsorolt időzóna-központok egyike által kibocsátott és fenntartott egyeztetett világidőtől (UTC).

3. cikk

Az adatok hiánytalanságának pontozása

4. Az értékpapírosítási adattárak minden egyes adatszolgáltatás esetében kiszámítják az adathiánytalansági pontszámot a melléklet 1. táblázatában meghatározott pontozási mátrix és a következő inputok felhasználásával:

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

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

ahol:

$\sum_i^N NDx$ egy adatszolgáltatáson belül azon mezők teljes száma, amelyek az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet 9. cikkének (3) bekezdésével összhangban feltüntetett, vonatkozó „Nincs adat” opció értékeit tartalmazzák.

N egy adatszolgáltatáson belül azon mezők teljes száma, amelyek esetében engedélyezett a „Nincs adat” opció bármely értékének (ND1–ND4) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet 9. cikkének (3) bekezdésével összhangban történő feltüntetése.

Az adathiánytalansági pontszám kiszámítása céljából az „ND4-YYYY-MM-DD” formátum használatával kitöltött mezőket „ND4”-ként kell érteni.

4. cikk

Az információk hiánytalanságának és egységességének ellenőrzése

(1) Az értékpapírosítási adattárak a következők ellenőrzése révén ellenőrzik a hozzájuk bejelentett információk hiánytalanságát és egységességét:

a) az adatszolgáltató szervezet neve, az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet XII. mellékletének IVSS4 mezőjében vagy XIII. mellékletének IVAS3 mezőjében feltüntetettek szerint;

b) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet I. mellékletének 3. táblázatában feltüntetettek szerinti adatszolgáltatási tételkód helyes-e.

(2) Az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikke (1) bekezdésének a), e), f) és g) pontjában említett információk tekintetében az értékpapírosítási adattárak az információk hiánytalanságát és egységességét a következők elvégzésével is ellenőrzik:

a) annak ellenőrzése, hogy a szolgáltatott információk megfelelnek-e az (EU) 2020/1225 bizottsági végrehajtási rendelet ([5]) II–XV. mellékletében meghatározott adatlapok szerkezetének és formátumának;

b) a szolgáltatott információk összehasonlítása:

   i. különböző mezők között, azonos adatszolgáltatási zárónap és azonos alapul szolgáló kitettség, befektetői jelentés, bennfentes információ vagy jelentős eseményekre vonatkozó információ esetében;

   ii. különböző alapul szolgáló kitettségek, befektetői jelentések, bennfentes információk vagy jelentős eseményekre vonatkozó információk között, azonos mező és azonos adatszolgáltatási zárónap esetében;

   iii. azonos alapul szolgáló kitettségek, befektetői jelentések, bennfentes információk vagy jelentős eseményekre vonatkozó információk között, azonos mező és különböző adatszolgáltatási zárónapok esetében;

   iv. hasonló értékpapírosítások között;

([5]) A Bizottság (EU) 2020/1225 végrehajtási rendelete (2019. október 29.) az értékpapírosítást kezdeményező, a szponzor és a különleges célú gazdasági egység által az értékpapírosítással kapcsolatosan rendelkezésre bocsátandó információk és adatok formátumára és egységesített adatlapjaira vonatkozó végrehajtás-technikai standardok meghatározásáról (lásd e Hivatalos Lap 217. oldalát).

c) annak ellenőrzése, hogy a szolgáltatott információk adatszolgáltatási zárónapja és az adatszolgáltatás időbélyegzője megfelel-e az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet 10. cikkének;

d) annak ellenőrzése, hogy az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet 9. cikkének (3) bekezdésében meghatározott „Nincs adat" opciókat csak engedélyezett esetben használják, és azok nem gátolják azt, hogy az adatszolgáltatás az értékpapírosításban lévő alapul szolgáló kitettségek tekintetében kellően reprezentatív legyen.

ABCP-értékpapírosítás esetén az ebben a bekezdésben az alapul szolgáló kitettségekre való hivatkozásokat alapul szolgáló kitettségtípusokra való hivatkozásként kell értelmezni.

(3) Az értékpapírosítási adattárak az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikke (1) bekezdésének b) pontja alapján rendelkezésükre bocsátott dokumentáció hiánytalanságát és egységességét úgy ellenőrzik, hogy a következők írásbeli megerősítését kérik az adatszolgáltató szervezetektől:

a) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet I. mellékletének 3. táblázatában említett, és az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikke (1) bekezdése b) pontjának előírása szerint rendelkezésre bocsátandó összes tételt az értékpapírosítási adattár rendelkezésére bocsátották;

b) a dokumentáció összhangban van az értékpapírosítás tényleges feltételeivel és jellemzőivel.

(4) A (3) bekezdésben említett írásbeli megerősítést a következő határidőkön belül kell kérni:

a) az értékpapírok értékpapírosítás keretében történő első kibocsátását követő öt munkanapon belül, vagy ABCP-értékpapírosítás esetén az értékpapírok ABCP-program keretében történő első kibocsátását követő öt munkanapon belül;

b) az a) pontban említett kérelmek dátumától számítva tizenkét havonta;

c) egy új dokumentumnak az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikke (1) bekezdésének b) pontja szerinti rendelkezésre bocsátását követő öt munkanapon belül.

Ha az értékpapírosítási adattár az első albekezdésben említett bármely kérelem dátumától számított 14 napon belül nem kap írásbeli megerősítést, akkor felkéri az adatszolgáltató szervezetet, hogy 14 napon belül bocsássa rendelkezésére az írásbeli megerősítést.

(5) Az értékpapírosítási adattárak ellenőrzik, hogy az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikke (1) bekezdésének d) pontjában említett STS kritériumoknak való megfelelésről szóló értesítés, amelyet számukra rendelkezésére bocsátottak, megfelel-e a Bizottság (EU) 2020/1227 végrehajtási rendeletének ([6]) mellékleteiben meghatározott adatlapok szerkezetének és formátumának.

(6) Az értékpapírosítási adattár elutasítja az olyan adatszolgáltatást, amely az (1), (2) és (5) bekezdés figyelembevételével hiányos vagy nem egységes, a (2) bekezdés b) pontjának iii. és iv. alpontja kivételével. Az értékpapírosítási adattár az e bekezdés alapján elutasított adatszolgáltatásokat hozzárendeli a melléklet 2. táblázatában meghatározott elutasítási kategóriák egyikéhez.

(7) Az értékpapírosítási adattár indokolatlan késedelem nélkül értesíti az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezeteket a következőkről:

a) a benyújtott információ hiányos vagy nem egységes a (2) bekezdés b) pontjának iii. és iv. alpontját figyelembe véve;

b) az értékpapírosítási adattár nem kapta meg a (3) bekezdésben említett írásbeli megerősítést.

(8) Az értékpapírosítási adattárak az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikkében említett információk kézhezvételétől számított egy órán belül részletes visszajelzést adnak az adatszolgáltató szervezeteknek az (1), (2), (3) és (5) bekezdés értelmében végzett ellenőrzések eredményeiről, beleértve a (6) bekezdés szerint hozzárendelt elutasítási kategóriákat is. A visszajelzésnek legalább a következőket kell tartalmaznia::

a) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet 11. cikkével összhangban az értékpapírosításhoz rendelt egyedi azonosító;

([6]) A Bizottság (EU) 2020/1227 végrehajtási rendelete az STS kritériumoknak való megfelelésről szóló értesítés követelményeivel összhangban az információk közlésére szolgáló adatlapok tekintetében végrehajtás-technikai standardok meghatározásáról (lásd e Hivatalos Lap 315. oldalát).

b) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet I. mellékletének 3. táblázatában említett tételkód(ok);

c) a szolgáltatott információk benyújtásának másodperc pontosságú időbélyegzője, az ISO 8601 szabvány szerinti dátum- és időformátumban (UCT).

(9) Az értékpapírosítási adattárak minden hétfőn 19.00.00 UTC-ig jelentést készítenek az általuk az előző hétfőn 19.00.00 UTC óta elutasított minden információról. A jelentésnek legalább a következő tételeket kell tartalmaznia:

a) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet 11. cikkével összhangban az értékpapírosításhoz rendelt egyedi azonosító;

b) az értékpapírosítás neve;

c) az értékpapírosításhoz tartozó ügyletrészsorozatok, kötvények vagy alárendelt hitelek ISIN kódja, ha rendelkezésre áll;

d) az értékpapírosítást kezdeményező, a szponzor és a különleges célú gazdasági egység neve és jogalany-azonosítója;

e) a szolgáltatott információk másodperc pontosságú időbélyegzője, az ISO 8601 szabvány szerinti dátum- és időformátumban (UTC);

f) az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet I. mellékletének 3. táblázatában említett adatszolgáltatási tételkód;

g) az e rendelet mellékletének 2. táblázatában említett elutasítási kategória és az ennek a kategóriának a hozzárendelésével összefüggő egyedi körülmények;

h) az adatszolgáltató szervezet által a jelentés közzétételének hétfőjén 17.00.00 UTC előtt benyújtott magyarázat(ok) arra, hogy a szolgáltatott információk miért hiányosak vagy nem egységesek, vagy hogy a (3) bekezdésben említett írásbeli megerősítést miért nem nyújtották be.

5. cikk

Azon részletes információk, amelyekhez hozzáférést kell biztosítani

Az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikke (2) bekezdésének c) pontjában említett részletes információk a következők:

a) minden olyan információ, amelyet az értékpapírosítási adattár az (EU) 2017/2402 rendelettel összhangban adatszolgáltató szervezetektől kapott;

b) a 2. cikkben említett napvégi jelentés, a 3. cikkben említett adathiánytalansági pontszám, valamint az e rendelet 4. cikke értelmében elvégzett ellenőrzésekből származó információk;

c) az a) és b) pontban említett információk előállításához használt összes képlet, valamint számítási és összesítési módszer.

6. cikk

A részletes információkhoz való hozzáférés feltételei

(1) Az 5. cikkben említett információkhoz való hozzáférést kérésre biztosítani kell. A hozzáférés iránti kérelem az alábbi információkat tartalmazza:

a) a kérelmező szervezet neve;

b) a kapcsolattartó személy a kérelmező szervezetnél;

c) a hozzáférést kérelmező szervezet típusa az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említettek szerint;

d) a kérelmező szervezetnél dolgozó azon személyek neve, akik hozzá fognak férni a kért információkhoz;

e) a biztonságos SSH fájlátviteli protokollhoz szükséges hitelesítő adatok a 7. cikk (2) bekezdésében előírtak szerint;

f) a kérelem eseti vagy előre meghatározott időszakos kérelem-e;

g) a kért információ azonosítása a (4) bekezdésben szereplő kritériumok bármely kombinációja alapján;

h) a kérelmező szervezet hozzáférése szempontjából releváns bármely egyéb technikai információ.

(2) Az (1) bekezdés alkalmazásában az értékpapírosítási adattárak:

a) kijelölik az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetekkel való kapcsolattartásért felelős személyt vagy személyeket;

b) közzéteszik honlapjukon az információkhoz való hozzáférés feltételeit és az információhoz való hozzáférés iránti kérelem benyújtására vonatkozó utasításokat;

c) kizárólag a hozzáférés iránti kérelemben meghatározott információkhoz biztosítanak hozzáférést;

d) amint lehetséges, de legkésőbb az adott információhoz való hozzáférés kialakítása iránti kérelmet követő 30 napon belül megteszik az ahhoz szükséges technikai intézkedéseket, hogy az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek be tudják nyújtani az adott információhoz való hozzáférés iránti kérelmeiket.

(3) Az 5. cikkben említett információkhoz való hozzáférést a következő határidőkön belül kell biztosítani:

a) a 2. cikkben említett napvégi jelentés iránti eseti vagy előre meghatározott időszakos kérelem esetén legkésőbb 19.00.00 UTC azon a napon, amelyre a jelentés vonatkozik;

b) legkésőbb 12.00.00 UTC a hozzáférés iránti kérelem kézhezvételét követő első napon, ha az információ olyan értékpapírosításra vonatkozik, amelyre még nem állapítottak meg árat vagy amely még nem járt le vagy a kérelem benyújtásának dátuma előtt kevesebb mint egy évvel járt le;

c) legkésőbb három munkanappal a hozzáférés iránti kérelem kézhezvételét követően, ha az információ olyan értékpapírosításra vonatkozik, amely a kérelem benyújtásának dátuma előtt több mint egy évvel járt le;

d) legkésőbb három munkanappal a hozzáférés iránti kérelem kézhezvételének napját követően, ha az információ a b) és c) pont alá is tartozó több értékpapírosításra vonatkozik.

(4) Az értékpapírosítási adattárak az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezeteknek a következő kritériumok bármilyen kombinációja alapján hozzáférést biztosítanak az 5. cikkben említett információkhoz:

a) az értékpapírosítás típusa: nem ABCP vagy ABCP;

b) az értékpapírosítás szerkezetének típusa: vagy „M” az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet XIV. mellékletének SESS9 mezőjében feltüntetettek szerinti bizalmi vagyonkezelés esetén, vagy „S” minden egyéb értékpapírosítás esetén;

c) az értékpapírosítás kockázatátruházási módszere: „Y” az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló rendelet XII. mellékletének IVSS11 mezőjében feltüntetettek szerinti valós értékesítés esetén, „Y” az említett rendelet XIV. mellékletének SESV11 mezőjében feltüntetettek szerinti szintetikus értékpapírosítás esetén, vagy „ABCP” az ABCP-értékpapírosítások esetén;

d) az értékpapírosítás tételkódja;

e) az értékpapírosítás alapjául szolgáló kitettség típusa;

f) az adatlap értékpapírosítás alapjául szolgáló kitettségre vonatkozó szakasza;

g) az adatlap értékpapírosítási befektetői jelentésre vonatkozó szakasza;

h) az adatlap értékpapírosítási bennfentes információkra vagy jelentős eseményekre vonatkozó információkra vonatkozó szakasza;

i) azonosító:

   i. egyedi azonosító;

   ii. ügyletazonosító;

   iii. nemzetközi értékpapír-azonosító szám;

iv. új vagy eredeti ügyletrészsorozat/kötvény azonosítója;

v. új vagy eredeti alapul szolgáló kitettség azonosítója;

vi. új vagy eredeti kötelezett azonosítója;

vii. az értékpapírosítást kezdeményező jogalany-azonosítója;

viii. a szponzor jogalany-azonosítója;

ix. a különleges célú gazdasági egység jogalany-azonosítója;

x. az eredeti hitelező jogalany-azonosítója;

xi. a CLO-kezelő jogalany-azonosítója;

j) földrajzi jellemzők:

i. földrajzi régió;

ii. irányadó jog;

k) dátum és idő:

i. a benyújtás időbélyegzője;

ii. az adatszolgáltatás zárónapja;

iii. az ügyletrészsorozat/kötvény kibocsátásának időpontja;

iv. az ügyletrészsorozat/kötvény jogszerű lejárata;

v. az alapul szolgáló kitettség kihelyezésének időpontja;

vi. az alapul szolgáló kitettség lejáratának napja;

l) pénznem:

i. ügyletrészsorozat/kötvény pénzneme;

ii. az alapul szolgáló kitettség pénznemének denominációja.

(5) Az értékpapírosítási adattárak a következő információkat XML formátumban bocsátják rendelkezésre:

a) az (EU) 2017/2402 rendelet 7. cikke (1) bekezdésének a) pontjában, valamint d)–g) pontjában említett információk;

b) az értékpapírosítási adattárak által az e rendelet 2. és 4. cikkének megfelelően előállított információk, a 4. cikk (3) bekezdése értelmében kapott írásbeli megerősítések kivételével.

7. cikk

Az adatgyűjtésre és az adatokhoz való hozzáférésre vonatkozó standardok

(1) Az értékpapírosítási adattárak elektronikus aláírást és adattitkosítási protokollokat használnak az adatszolgáltató szervezetektől vagy más értékpapírosítási adattáraktól származó adatok fogadásához, valamint az adatok az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek részére történő továbbításához.

(2) Az (1) bekezdés alkalmazásában az értékpapírosítási adattárak gépek közötti biztonságos interfészt hoznak létre és tartanak fenn, és ezt az interfészt hozzáférhetővé teszik az adatszolgáltató szervezetek és az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek számára. Az interfész SSH fájlátviteli protokollt használ.

(3) Az értékpapírosítási adattárak szabványos XML-üzeneteket használnak a (2) bekezdésben említett interfészen keresztüli kommunikációhoz, és az e rendelet 6. cikkének (5) bekezdésében meghatározott információknak az (EU) 2017/2402 rendelet 17. cikkének (1) bekezdésében említett szervezetek részére történő rendelkezésre bocsátásához.

8. cikk

Nyilvántartás

(1) Az értékpapírosítási adattárak nyilvántartják a következőket:

a) az e rendelet szerinti ellenőrzések, és az értékpapírosítási adattár által elvégzett bármely egyéb validálás;

b) a 4. cikk (3) bekezdésében említettek szerint az értékpapírosítási adattárhoz beérkezett írásbeli megerősítések;

c) a 4. cikk (6) bekezdése szerint az értékpapírosítási adattár által az adatszolgáltató szervezet rendelkezésére bocsátott eredmények;

d) a 4. cikk (7) bekezdésében említettek szerint az adatszolgáltató szervezet által arra vonatkozóan adott magyarázat, hogy a szolgáltatott információ miért hiányos vagy nem egységes, vagy hogy miért nem nyújtott be írásbeli megerősítést;

e) az adatszolgáltató szervezet által benyújtott korrekciók vagy törlések részleteit tartalmazó változásnapló;

f) az e rendelet alapján előállított vagy benyújtott bármely egyéb információ.

(2) Minden rögzített adatot az annak az értékpapírosításnak a lezárását követő 10 éven keresztül meg kell őrizni, amelyre az adott adat vonatkozik.

(3) Az (1) bekezdés d) pontjában említett változásnapló tartalmazza az értékpapírosítás egyedi azonosítóját, a tételkódot, az érintett adatszolgáltatás időbélyegzőjét, a változtatások időbélyegzőjét és a szolgáltatott információban tett változtatások egyértelmű leírását, beleértve az adott információ korábbi és új tartalmát.

9. cikk

Hatálybalépés

Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* való kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó valamennyi tagállamban.

Kelt Brüsszelben, 2019. november 29-én.

a Bizottság részéről
az elnök
Jean-Claude JUNCKER

MELLÉKLET

Adathiánytalansági pontozási mátrix és elutasítási kategóriák

1. táblázat

Adathiánytalansági pontozási mátrix

		1. input: „ND1” jelzésű mezők százalékos aránya			
		1. input = 0 %	0 % < 1. input ≤ 10 %	10 % < 1. input ≤ 30 %	1. input > 30 %
2. input: „ND2”, „ND3”, vagy „ND4-YYYY-MM-DD” jelzésű mezők százalékos aránya	2. input = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < 2. input ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < 2. input ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	2. input > 40 %	A4	B4	C4	D4

2. táblázat

Elutasítási kategóriák

Elutasítási kategóriák	**Indok**
Séma	Az adatszolgáltatást azért utasították el, mert a séma nem felel meg az előírásoknak.
Jogosultság	Az adatszolgáltatást azért utasították el, mert az adatszolgáltató szervezet nem kapott engedélyt arra, hogy az értékpapírosítást kezdeményező, a szponzor vagy a különleges célú gazdasági egység nevében szolgáltasson adatot.
Logika	Az adatszolgáltatást azért utasították el, mert a tételkód nem felel meg az (EU) 2020/1224 felhatalmazáson alapuló bizottsági rendelet 1. mellékletének 3. táblázatában szereplő rendelkezésre álló értékeknek;
Tevékenység	Az adatszolgáltatást azért utasították el, mert az adatszolgáltatás tartalmilag egy vagy több ponton nem felel meg az előírásoknak.
Reprezentativitás	Az adatszolgáltatást a 4. cikk (6) bekezdése alapján utasították el.