GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2020/1229 VAN DE COMMISSIE

van 29 november 2019

tot aanvulling van Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad met technische reguleringsnormen betreffende operationele normen van securitisatieregisters voor gegevensverzameling, -aggregatie, -vergelijking, -toegang en -verificatie op het gebied van volledigheid en consistentie

(Voor de EER relevante tekst)

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad van 12 december 2017 tot vaststelling van een algemeen kader voor securitisatie en tot instelling van een specifiek kader voor eenvoudige, transparante en gestandaardiseerde securitisatie, en tot wijziging van de Richtlijnen 2009/65/EG, 2009/138/EG en 2011/61/EU en de Verordeningen (EG) nr. 1060/2009 en (EU) nr. 648/2012 ([1]), en met name artikel 10, lid 7, onder a), en artikel 17, lid 2, onder b), c) en d),

Overwegende hetgeen volgt:

(1) De in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten moeten hun respectieve taken, opdrachten en verplichtingen kunnen vervullen. De door securitisatieregisters aan die entiteiten verstrekte informatie moet daarom van hoge kwaliteit zijn en moet zich lenen voor het tijdig, gestructureerd en alomvattend aggregeren en vergelijken van gegevens van verschillende securitisatieregisters. Securitisatieregisters moeten daarom beoordelen of die informatie volledig en consistent is voordat zij aan die entiteiten beschikbaar wordt gesteld, en zij moeten die entiteiten een eindedagrapport en een algemene gegevensvolledigheidsscore verstrekken.

(2) De procedures om te verifiëren of de door initiators, sponsors of SSPE's aan securitisatieregisters gerapporteerde informatie volledig en consistent is, moeten rekening houden met de verscheidenheid van securitisatiesoorten, -kenmerken en -praktijken. Er moet derhalve worden voorzien in verificatieprocedures die vergelijking van de gerapporteerde informatie met betrekking tot soortgelijke securitisaties omvatten, zoals securitisaties die dezelfde/hetzelfde of een gerelateerd(e) initiator, type onderliggende blootstelling, structureel kenmerk of geografie hebben.

(3) Om de kwaliteit van de gerapporteerde informatie te waarborgen, moeten de verificatieprocedures ook gelden voor de volledigheid en consistentie van de documentatie ter staving van die informatie. Omdat het relatief moeilijk is de volledigheid en consistentie van die documentatie te verifiëren, moeten securitisatieregisters de rapporterende entiteiten verzoeken schriftelijk te bevestigen dat de door hen ter beschikking gestelde onderliggende securitisatiedocumentatie volledig en consistent is. Materiële actualiseringen van reeds gerapporteerde documentatie moeten worden beschouwd als een nieuw securitisatiedocument dat een verzoek om schriftelijke bevestiging vereist.

(4) Om de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten in staat te stellen hun respectieve taken, opdrachten en verplichtingen te vervullen, moeten de nadere gegevens van securitisaties waartoe die entiteiten rechtstreeks en onmiddellijk toegang moeten hebben, op geharmoniseerde en consistente wijze vergelijkbaar zijn tussen securitisatieregisters. Die nadere gegevens moeten daarom in Extensible Markup Language (XML)-formaat worden verstrekt, aangezien dit formaat in de financiële sector gangbaar is.

(5) De vertrouwelijkheid van elk soort tussen securitisatieregisters en de in artikel 17, lid 1, van de Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten uitgewisselde gegevens moet worden gewaarborgd. Dergelijke uitwisselingen moeten daarom plaatsvinden via een beveiligde machine-to-machine verbinding met gebruikmaking van gegevensversleutelingsprotocollen. Om te zorgen voor gemeenschappelijke minimumnormen moet een SSH File Transfer Protocol worden gebruikt.

([1]) PB L 347 van 28.12.2017, blz. 35.

(6) Gegevens over de meest recente onderliggende blootstellingen van een securitisatie, beleggersverslagen, informatie over voorwetenschap en belangrijke gebeurtenissen, alsook indicatoren van de kwaliteit en tijdigheid van die gegevens, zijn van essentieel belang voor een permanente monitoring van beleggingsposities en potentiële beleggingen in securitisaties, alsook voor de financiële stabiliteit en systeemrisico. De in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten moeten daarom, naargelang van hun behoefte, op ad-hocbasis of van tevoren vastgestelde periodieke basis toegang hebben tot deze gegevens.

(7) Securitisaties zijn complex en heterogeen en de gebruikers die toegang hebben tot informatie uit securitisatieregisters, zijn divers. Het is daarom van essentieel belang dat de rechtstreekse en onmiddellijke toegang tot specifieke datasets en informatie wordt vergemakkelijkt. Hierbij moet het onder meer gaan om toegang tot informatie in een machineleesbaar formaat die bestaat uit gegevens en alle actuele en historische informatie over een securitisatie die in een register is opgeslagen. Voor dat doel moet een kader worden gecreëerd voor ad-hocverzoeken die kunnen worden gecombineerd om specifieke informatie te verkrijgen. De termijnen waarbinnen securitisatieregisters gegevens aan de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten moeten verstrekken, moeten worden geharmoniseerd om een efficiënte gegevensverwerking door die entiteiten en de securitisatieregisters te vergemakkelijken. Tegelijkertijd moet ervoor worden gezorgd dat de gegevens worden verkregen binnen termijnen die de verzoekende entiteiten in staat stellen hun taken doeltreffend te vervullen.

(8) De in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten vertrouwen op de door securitisatieregisters bewaarde gegevens, onder meer voor het vergelijken van actuele securitisaties met vroegere securitisaties. Daarom is het passend te specificeren dat registers de vastleggingen van een securitisatie tien jaar na de beëindiging van de securitisatie moeten bewaren, overeenkomstig artikel 10, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402 en artikel 80, lid 3, van Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad ([2]).

(9) De bepalingen van deze verordening houden nauw verband met elkaar, aangezien zij betrekking hebben op normen en procedures voor het verzamelen en verwerken van door securitisatieregisters bewaarde informatie en toegang tot die informatie. Daarom is het passend die bepalingen in één verordening op te nemen.

(10) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische reguleringsnormen die de Europese Autoriteit voor effecten en markten (European Securities and Markets Authority, ESMA) bij de Commissie heeft ingediend.

(11) De ESMA heeft een open publieke raadpleging gehouden over de ontwerpen van technische reguleringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, heeft de mogelijke daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd en heeft de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten om advies verzocht ([3]),

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Definities

Voor de toepassing van deze verordening gelden de volgende definities:

a) "rapporterende entiteit": de overeenkomstig artikel 7, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402 aangewezen entiteit;

b) "afsluitdatum van de gegevensinzending": de referentiedatum van de informatie die wordt gerapporteerd overeenkomstig Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 van de Commissie ([4]).

([2]) Verordening (EU) nr. 648/2012 van het Europees Parlement en de Raad van 4 juli 2012 betreffende otc-derivaten, centrale tegenpartijen en transactieregisters (PB L 201 van 27.7.2012, blz. 1).

([3]) Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 84).

([4]) Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 van de Commissie van 16 oktober 2019 tot aanvulling van Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad betreffende technische reguleringsnormen ter specificatie van de door de initiator, de sponsor en de SSPE beschikbaar te stellen informatie over een securitisatie (zie bladzijde 1 van dit Publicatieblad).

Artikel 2

Eindedagrapport

1. Securitisatieregisters stellen dagelijks één geaggregeerd eindedagrapport op voor alle aan hen gerapporteerde securitisaties, met uitzondering van gerapporteerde securitisaties die zijn afgewezen overeenkomstig artikel 4, lid 6. Dat rapport is gebaseerd op de meest recente gerapporteerde informatie, omvat geen gerapporteerde securitisaties die zijn afgewezen overeenkomstig artikel 4, lid 6, en omvat ten minste de volgende informatie:

a) de in overeenstemming met artikel 11 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 toegekende unieke identificatiecode;

b) de ISIN-codes van de tranches, obligaties of achtergestelde leningen van de securitisatie, indien beschikbaar;

(c) de som van de huidige kapitaalsaldo's van alle tranches, obligaties of achtergestelde leningen van de securitisatie, in EUR, met gebruikmaking van de wisselkoersen die voor de vorige werkdag op de website van de Europese Centrale Bank zijn gepubliceerd;

(d) de naam van de securitisatie;

e) of de securitisatie een ABCP- of een niet-ABCP-securitisatie is;

f) of de securitisatiestructuur van het type "M" is voor een mastertrust zoals gerapporteerd in veld SESS9 van bijlage XIV bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 of van het type "S" voor alle andere securitisaties;

g) of de methode voor de overdracht van het securitisatierisico "T" is voor een echte verkoop zoals gerapporteerd in veld IVSS11 van bijlage XII bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 dan wel "S" voor een synthetische securitisatie zoals gerapporteerd in veld SESV11 van bijlage XIV bij die verordening, of "ABCP" voor ABCP-securitisaties;

h) de naam en identificatiecode voor juridische entiteiten (legal entity identifier — "LEI") van de initiator, de sponsor en de SSPE;

i) de meest recente rentebetalingsdatum in datumformaat volgens ISO 8601;

j) het tijdstempel, in datum- en tijdformaat volgens ISO 8601 (UTC), tot op de dichtstbijzijnde seconde, van de meest recente door het securitisatieregister ontvangen gegevensinzending of, wanneer er verschillende gegevensinzendingen met dezelfde afsluitdatum zijn, de tijdstempels, in datum- en tijdformaat volgens ISO 8601 (UTC), van de eerste en van de meest recente gegevensinzending met dezelfde afsluitdatum;

k) de afsluitdatum, in datumformaat volgens ISO 8601, van de meest recente door het securitisatieregister ontvangen gegevensinzending;

l) het aantal door het securitisatieregister ontvangen gegevensinzendingen met dezelfde afsluitdatum als bedoeld onder k);

m) de in artikel 3 bedoelde gegevensvolledigheidsscore van de meest recente door het securitisatieregister ontvangen gegevensinzending;

n) voor niet-ABCP-securitisaties, het land van vestiging van de initiator of oorspronkelijke kredietverstrekker;

o) voor ABCP-securitisaties, het land van vestiging van de sponsor;

p) het land waar het grootste deel van de onderliggende blootstellingen zich bevindt, qua huidig kapitaalsaldo van de onderliggende blootstellingen;

q) het meest voorkomende type van de onderliggende blootstellingen in de securitisatie, qua huidig kapitaalsaldo.

r) Voor de toepassing van punt n) is het land van vestiging van de initiator of oorspronkelijke kredietverstrekker, wanneer de onderliggende blootstellingen van de securitisatie een combinatie van blootstellingen van meerdere initiators of oorspronkelijke kredietverstrekkers zijn, het land van de initiator of oorspronkelijke kredietverstrekker die qua huidig kapitaalsaldo het grootste bedrag aan blootstellingen in de securitisatie heeft.

2. Securitisatieregisters stellen het eindedagrapport beschikbaar in XML-formaat.

3. De in dit artikel bedoelde tijdstempels mogen niet meer dan één seconde afwijken van de UTC die wordt vastgesteld en bijgehouden door een van de centra voor tijdmeetkunde die zijn vermeld in het laatste "Annual Report on Time Activities" van het Internationaal Bureau voor maten en gewichten (BIPM, Bureau International des Poids et Mesures).

Artikel 3

Gegevensvolledigheidsscore

4. Securitisatieregisters berekenen voor elke gegevensinzending een gegevensvolledigheidsscore met gebruikmaking van de in tabel 1 van de bijlage beschreven scorematrix en de volgende inputs:

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

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

Waarbij:

$\sum_i^N NDx$ het totale aantal velden in een gegevensinzending aangeeft dat de respectieve "Geen gegevens"-waarden bevat die worden gerapporteerd in overeenstemming met artikel 9, lid 3, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224;

N het totale aantal velden in een gegevensinzending aangeeft waar "Geen gegevens"-waarden (ND1 tot en met ND4) mogen worden gerapporteerd in overeenstemming met artikel 9, lid 3, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224.

Voor de berekening van de gegevensvolledigheidsscore worden velden die zijn ingevuld met behulp van het formaat "ND4-JJJJ-MM-DD" beschouwd als "ND4".

Artikel 4

Verificatie van de volledigheid en consistentie van informatie

1. Securitisatieregisters verifiëren de volledigheid en consistentie van de aan hen verstrekte informatie door het volgende te verifiëren:

a) de naam van de rapporterende entiteit, zoals gerapporteerd in veld IVSS4 van bijlage XII of in veld IVAS3 van bijlage XIII bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224;

b) of de documentcode van de inzending zoals gerapporteerd in tabel 3 van bijlage I bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 juist is.

2. Met betrekking tot de in artikel 7, lid 1, onder a), e), f) en g), van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde informatie verifiëren securitisatieregisters ook de volledigheid en consistentie van de informatie door:

a) na te gaan of de gerapporteerde informatie voldoet aan de structuur en het formaat van de templates beschreven in de bijlagen II tot en met XV bij Uitvoeringsverordening (EU) 2020/1225 van de Commissie ([5]).

b) de gerapporteerde informatie te vergelijken:

   i) tussen verschillende velden voor dezelfde afsluitdatum en dezelfde onderliggende blootstelling, hetzelfde beleggersverslag, dezelfde voorwetenschap of belangrijke gebeurtenissen;

   ii) tussen verschillende onderliggende blootstellingen, beleggersverslagen, voorwetenschap of belangrijke gebeurtenissen voor hetzelfde veld en dezelfde afsluitdatum;

   iii) tussen verschillende afsluitdata voor dezelfde onderliggende blootstelling, hetzelfde beleggersverslag, dezelfde voorwetenschap of belangrijke gebeurtenissen en voor hetzelfde veld;

   iv) tussen soortgelijke securitisaties;

([5]) Uitvoeringsverordening (EU) 2020/1225 van de Commissie van 29 oktober 2019 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen met betrekking tot het formaat en gestandaardiseerde templates voor het beschikbaar stellen van de informatie en gegevens over een securitisatie door de initiator, sponsor en SSPE (zie bladzijde 217 van dit Publicatieblad).

c) na te gaan of de afsluitdatum van de gerapporteerde informatie en het tijdstempel van de gegevensinzending in overeenstemming zijn met artikel 10 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224;

d) na te gaan of de in artikel 9, lid 3, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 beschreven "Geen gegevens"-opties alleen worden gebruikt waar dat is toegestaan en niet beletten dat de gegevensinzending representatief genoeg is voor de onderliggende blootstellingen in de securitisatie.

Voor ABCP-securitisaties worden verwijzingen in dit lid naar onderliggende blootstellingen opgevat als verwijzingen naar types onderliggende blootstellingen.

3. Securitisatieregisters verifiëren de volledigheid en consistentie van de documentatie die hun op grond van artikel 7, lid 1, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 ter beschikking wordt gesteld, door de rapporterende entiteiten te verzoeken om schriftelijke bevestiging:

a) dat alle in tabel 3 van bijlage I bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 bedoelde documenten die overeenkomstig artikel 7, lid 1, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 ter beschikking moeten worden gesteld, aan het securitisatieregister zijn verstrekt;

b) dat de documentatie strookt met de werkelijke regelingen en kenmerken van de securitisatie.

4. Om schriftelijke bevestiging in de zin van lid 3 wordt binnen de volgende termijnen verzocht:

a) binnen vijf werkdagen na de eerste uitgifte van effecten in het kader van de securitisatie of, voor ABCP-securitisaties, binnen vijf werkdagen na de eerste uitgifte van effecten in het kader van het ABCP-programma;

b) om de twaalf maanden na de data van de onder a) bedoelde verzoeken;

c) binnen vijf werkdagen nadat een nieuw document ter beschikking is gesteld overeenkomstig artikel 7, lid 1, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402.

Een securitisatieregister dat binnen 14 dagen na de datum van een verzoek als bedoeld in de eerste alinea geen schriftelijke bevestiging heeft ontvangen, verzoekt de rapporterende entiteit nogmaals deze bevestiging binnen 14 dagen te verstrekken.

5. Securitisatieregisters verifiëren of de in artikel 7, lid 1, onder d), van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde STS-kennisgeving die aan het betrokken securitisatieregister ter beschikking is gesteld, voldoet aan de structuur en het formaat van de templates die zijn beschreven in de bijlagen bij Uitvoeringsverordening (EU) 2020/1227 van de Commissie ([6]).

6. Een securitisatieregister wijst een inzending van informatie af als die onvolledig of inconsistent is in de zin van de leden 1, 2 en 5, met uitzondering van lid 2, onder b), punten iii) en iv). Het securitisatieregister kent aan de overeenkomstig dit lid afgewezen inzendingen een van de in tabel 2 van de bijlage beschreven afwijzingscategorieën toe.

7. Het securitisatieregister deelt de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten onverwijld mede:

a) dat de ingezonden informatie onvolledig of inconsistent is in de zin van lid 2, onder b) iii) en iv);

b) dat het securitisatieregister de in lid 3 bedoelde schriftelijke bevestiging niet heeft ontvangen.

8. Binnen één uur na ontvangst van de in artikel 7 van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde informatie geven securitisatieregisters de rapporterende entiteiten gedetailleerde feedback over de resultaten van de krachtens de leden 1, 2, 3 en 5 verrichte verificaties, inclusief eventuele overeenkomstig lid 6 toegekende afwijzingscategorieën. Die feedback omvat voorts ten minste de volgende gegevens:

a) de in overeenstemming met artikel 11, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 toegekende unieke identificatiecode van de securitisatie;

([6]) Uitvoeringsverordening (EU) 2020/1227 van de Commissie van 12 november 2019 tot vaststelling van technische uitvoeringsnormen met betrekking tot templates voor de overeenkomstig de STS-kennisgevingsvereisten te verstrekken informatie (zie bladzijde 315 van dit Publicatieblad).

b) de documentcode(s) als bedoeld in tabel 3 van bijlage I bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224;

c) het tijdstempel van de inzending, in datum- en tijdformaat volgens ISO 8601 (UTC), tot op de dichtstbijzijnde seconde, van de gerapporteerde informatie.

9. Securitisatieregisters stellen elke maandag om 19.00.00 UTC een rapport op over alle informatie die sinds 19.00.00 UTC op de vorige maandag door hen is afgewezen. Dat rapport moet ten minste de volgende elementen bevatten:

a) de in overeenstemming met artikel 11 van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 toegekende unieke identificatiecode van de securitisatie;

b) de naam van de securitisatie;

c) de ISIN-codes van de tranches, obligaties of achtergestelde leningen van de securitisatie, indien beschikbaar;

d) de naam en LEI van de initiator, de sponsor en de SSPE;

e) het tijdstempel, in datum- en tijdformaat volgens ISO 8601 (UTC), tot op de dichtstbijzijnde seconde, van de ingezonden informatie;

f) de documentcode van de inzending als bedoeld in tabel 3 van bijlage I bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224;

g) de in tabel 2 van de bijlage bij deze verordening bedoelde afwijzingscategorie en de specifieke omstandigheden voor de toekenning van die afwijzingscategorie;

h) eventuele uitleg die de rapporterende entiteit vóór 17.00.00 UTC op de maandag van de publicatiedatum van het rapport geeft over de reden waarom de gerapporteerde informatie onvolledig of inconsistent is, of over de reden waarom de in lid 3 bedoelde schriftelijke bevestiging niet is verstrekt.

Artikel 5

Nadere omschrijving van de informatie waartoe toegang moet worden verleend

De in artikel 17, lid 2, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde informatie omvat het volgende:

a) alle overeenkomstig Verordening (EU) 2017/2402 door het securitisatieregister van de rapporterende entiteiten ontvangen informatie;

b) het in artikel 2 bedoelde eindedagrapport, de in artikel 3 bedoelde gegevensvolledigheidsscore en alle informatie die voortvloeit uit de krachtens artikel 4 van deze verordening verrichte verificaties;

c) alle formules en berekenings- en aggregatiemethoden die worden gebruikt om de onder a) en b) bedoelde informatie te produceren.

Artikel 6

Voorwaarden voor toegang tot informatie

1. Toegang tot de in artikel 5 bedoelde informatie wordt op verzoek verleend. Het verzoek om toegang bevat de volgende informatie:

a) de naam van de verzoekende entiteit;

b) de contactpersoon bij de verzoekende entiteit;

c) het soort verzoekende entiteit in de zin van artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402;

d) de namen van de personen bij de verzoekende entiteit die toegang zullen hebben tot de gevraagde informatie;

e) de toegangsgegevens voor een beveiligde SSH File Transfer Protocol-verbinding zoals voorgeschreven door artikel 7, lid 2;

f) of het verzoek een ad-hocverzoek dan wel een van tevoren vastgesteld periodiek verzoek is;

g) de identificatie van de informatie waarom wordt verzocht op basis van een combinatie van de criteria in lid 4;

h) alle andere voor de toegang van de verzoekende entiteit relevante technische informatie.

2. Voor de toepassing van lid 1:

a) wijzen securitisatieregisters een of meer personen aan die belast zijn met de contacten met de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten;

b) publiceren securitisatieregisters op hun website de voorwaarden voor toegang tot informatie en de instructies voor het indienen van een verzoek om toegang tot die informatie;

c) verlenen securitisatieregisters uitsluitend toegang tot de in het verzoek om toegang genoemde informatie;

d) treffen securitisatieregisters zo spoedig mogelijk, maar uiterlijk 30 dagen na het verzoek om toegang tot die informatie, de technische regelingen die nodig zijn om de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten in staat te stellen verzoeken om toegang tot die informatie in te dienen.

3. Toegang tot de in artikel 5 bedoelde informatie wordt binnen de volgende termijnen verleend:

a) niet later dan 19.00.00 UTC van de dag waarop het rapport betrekking heeft voor een ad-hocverzoek of een van tevoren vastgesteld periodiek verzoek om een eindedagrapport als bedoeld in artikel 2;

b) niet later dan 12.00.00 UTC op de eerste dag na de dag van ontvangst van het verzoek om toegang wanneer de informatie betrekking heeft op een securitisatie die nog niet is geprijsd of nog niet is vervallen of die minder dan één jaar vóór de datum waarop het verzoek is ingediend, is vervallen;

c) niet later dan drie werkdagen na de dag van ontvangst van het verzoek om toegang wanneer de informatie betrekking heeft op een securitisatie die meer dan één jaar vóór de datum waarop het verzoek is ingediend, is vervallen;

d) niet later dan drie werkdagen na de dag van ontvangst van het verzoek om toegang wanneer de informatie betrekking heeft op meerdere securitisaties die onder de punten b) en c) vallen.

4. Securitisatieregisters verlenen de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten toegang tot de in artikel 5 bedoelde informatie op basis van eender welke combinatie van de volgende criteria:

a) soort securitisatie: niet-ABCP of ABCP;

b) soort securitisatiestructuur: ofwel "M" voor een mastertrust zoals gerapporteerd in veld SESS9 van bijlage XIV bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224, ofwel "S" voor alle andere securitisaties;

c) methode voor de overdracht van het securitisatierisico: type "Y" voor echte verkoop zoals gerapporteerd in veld IVSS11 in bijlage XII bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224, "Y" voor synthetische securitisaties zoals gerapporteerd in veld SESV11 in bijlage XIV bij die verordening, of "ABCP" voor ABCP-securitisaties;

d) documentcode van de securitisatie;

e) type onderliggende blootstelling van de securitisatie;

f) afdeling van de onderliggende blootstelling van de securitisatie;

g) afdeling van de template over het beleggersverslag van de securitisatie;

h) afdeling van de template over voorwetenschap of belangrijke gebeurtenissen van de securitisatie;

i) identificatiecode:

   i) unieke identificatiecode;

   ii) transactie-identificatiecode;

   iii) internationaal effectenidentificatienummer (ISIN)

iv) identificatiecode van de nieuwe of oorspronkelijke tranche/obligatie;

v) identificatiecode van de nieuwe of oorspronkelijke onderliggende blootstelling;

vi) identificatiecode van de nieuwe of oorspronkelijke debiteur;

vii) identificatiecode voor juridische entiteiten van de initiator;

viii) identificatiecode voor juridische entiteiten van de sponsor;

ix) identificatiecode voor juridische entiteiten van de SSPE;

x) identificatiecode voor juridische entiteiten van de oorspronkelijke kredietverstrekker;

xi) identificatiecode voor juridische entiteiten van de CLO-beheerder;

j) geografie:

i) geografische regio;

ii) toepasselijk recht;

k) datum en tijd:

i) tijdstempel van de inzending;

ii) afsluitdatum van de gegevensinzending;

iii) uitgiftedatum van de tranche/obligatie;

iv) wettelijke vervaldatum van de tranche/obligatie;

v) datum van initiëring van de onderliggende blootstelling;

vi) vervaldatum van de onderliggende blootstelling;

l) valuta:

i) valuta van de tranche/obligatie;

ii) munteenheid waarin de onderliggende blootstelling is uitgedrukt.

5. Securitisatieregisters stellen de volgende informatie beschikbaar met gebruikmaking van het XML-formaat:

a) de in artikel 7, lid 1, onder a) en d) tot en met g), van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde informatie;

b) de overeenkomstig de artikelen 2 en 4 van deze verordening door de securitisatieregisters verstrekte informatie, met uitzondering van de uit hoofde van artikel 4, lid 3, ontvangen schriftelijke bevestigingen.

Artikel 7

Normen voor gegevensverzameling en toegang

1. Securitisatieregisters gebruiken elektronische ondertekenings- en gegevensversleutelingsprotocollen om gegevens van rapporterende entiteiten of andere securitisatieregisters te ontvangen en om gegevens aan de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten te verstrekken.

2. Voor de toepassing van lid 1 brengen securitisatieregisters een beveiligde machine-to-machine interface tot stand die zij onderhouden en ter beschikking stellen aan de rapporterende entiteiten en de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten. Die interface maakt gebruik van het SSH File Transfer Protocol.

3. Securitisatieregisters gebruiken gestandaardiseerde XML-berichten om via de in lid 2 bedoelde interface te communiceren en de in artikel 6, lid 5, van deze verordening bedoelde informatie ter beschikking te stellen aan de in artikel 17, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde entiteiten.

Artikel 8

Bewaren van gegevens

1. Securitisatieregisters leggen het volgende vast:

a) verificaties uit hoofde van deze verordening en andere door het securitisatieregister verrichte valideringen;

b) de door het securitisatieregister ontvangen schriftelijke bevestigingen als bedoeld in artikel 4, lid 3;

c) de door het securitisatieregister aan de rapporterende entiteit verstrekte resultaten uit hoofde van artikel 4, lid 6;

d) eventuele uitleg die de rapporterende entiteit geeft over de reden waarom de ingediende informatie onvolledig of inconsistent is, of over de reden waarom er geen schriftelijke bevestiging is als bedoeld in artikel 4, lid 7;

e) in een rapportagelogboek, de details van door de rapporterende entiteit ingediende correcties of annuleringen;

f) alle andere krachtens deze verordening overgelegde of ingezonden informatie.

2. Alle gegevens worden tien jaar bewaard na de beëindiging van de securitisatie waarop zij betrekking hebben.

3. Het in lid 1, onder d), bedoelde rapportagelogboek omvat de unieke identificatiecode van de securitisatie, de documentcode, het tijdstempel van de betrokken inzending, het tijdstempel van de wijzigingen en een duidelijke beschrijving van de wijzigingen in de ingezonden informatie, inclusief de vorige en de nieuwe inhoud van die informatie.

Artikel 9

Inwerkingtreding

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 29 november 2019.

Voor de Commissie
De voorzitter
Jean-Claude JUNCKER

BIJLAGE

Matrix voor de gegevensvolledigheidsscore en afwijzingscategorieën

Tabel 1

Matrix voor de gegevensvolledigheidsscore

		Input 1: Percentage velden ingevuld als "ND1"			
		Input 1 = 0 %	0 % < Input 1 ≤ 10 %	10 % < Input 1 ≤ 30 %	Input 1 > 30 %
Input 2: Percentage velden ingevuld als "ND2", "ND3", of "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

Afwijzingscategorieën

Afwijzingscategorieën	**Reden**
Schema	De inzending van informatie is afgewezen wegens een niet-conform schema.
Toestemming	De inzending van informatie is afgewezen omdat de rapporterende entiteit geen toestemming heeft gekregen om namens de initiator, de sponsor of de SSPE te rapporteren.
Logisch	De inzending van informatie is afgewezen omdat de documentcode niet strookt met de beschikbare waarden in tabel 3 van bijlage 1 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224.
Bedrijfsmatig	De inzending van informatie is afgewezen omdat de gegevensinzending niet strookt met een of meer inhoudsvalideringen.
Representativiteit	De inzending van informatie is afgewezen op grond van artikel 4, lid 6.