DELEGOVANÉ NARIADENIE KOMISIE (EÚ) 2020/1229

z 29. novembra 2019,

ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2017/2402, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy pre prevádzkové normy archívov sekuritizačných údajov o zhromažďovaní, agregácii, porovnávaní a overovaní úplnosti a konzistentnosti údajov a prístupe k nim

(Text s významom pre EHP)

EURÓPSKA KOMISIA,

so zreteľom na Zmluvu o fungovaní Európskej únie,

so zreteľom na nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2017/2402 z 12. decembra 2017, ktorým sa stanovuje všeobecný rámec pre sekuritizáciu a vytvára sa osobitný rámec pre jednoduchú, transparentnú a štandardizovanú sekuritizáciu, a ktorým sa menia smernice 2009/65/ES, 2009/138/ES a 2011/61/EÚ a nariadenia (ES) č. 1060/2009 a (EÚ) č. 648/2012 ([1]), a najmä na jeho článok 10 ods. 7 písm. a) a článok 17 ods. 2 písm. b), c) a d),

keďže:

(1) Subjekty uvedené v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 by mali byť schopné plniť svoje príslušné úlohy, mandáty a povinnosti. Informácie poskytnuté týmto subjektom archívmi sekuritizačných údajov by preto mali byť vysokokvalitné a mali by byť ľahko použiteľné na včasnú, štruktúrovanú a komplexnú agregáciu a porovnávanie v rámci rôznych archívov sekuritizačných údajov. Archívy sekuritizačných údajov by preto mali pred tým, ako sprístupnia informácie uvedeným subjektom, posúdiť, či sú úplné a konzistentné, a mali by týmto subjektom predložiť správu na konci dňa, ako aj celkové bodové hodnotenie úplnosti údajov.

(2) Postupy na overenie, či sú informácie, ktoré archívu sekuritizačných údajov vykazujú originátori, sponzori alebo účelové subjekty zaoberajúce sa sekuritizáciou (SSPE), úplné a konzistentné, by mali zohľadňovať rôznorodosť typov, vlastností a postupov sekuritizácie. Je preto vhodné stanoviť postupy overovania, ktoré zahŕňajú porovnanie informácií vykázaných pri podobných sekuritizáciách, ako sú napríklad sekuritizácie s tým istým originátorom alebo prepojenými originátormi, rovnakým typom podkladovej expozície či tými istými štrukturálnymi prvkami alebo geografiou.

(3) S cieľom zabezpečiť kvalitu vykazovaných informácií by sa postupy overovania mali vzťahovať aj na úplnosť a konzistentnosť podpornej dokumentácie priloženej k daným informáciám. Vzhľadom na relatívne ťažkosti pri overovaní úplnosti a konzistentnosti tejto dokumentácie by však archívy sekuritizačných údajov mali vyžadovať od vykazujúcich subjektov, aby písomne potvrdili, že podkladová sekuritizačná dokumentácia, ktorú sprístupňujú, je úplná a konzistentná. Podstatné aktualizácie už vykázanej dokumentácie by sa mali považovať za novú sekuritizačnú dokumentáciu, ktorá si vyžaduje žiadosť o písomné potvrdenie.

(4) S cieľom zabezpečiť, aby si subjekty uvedené v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 o sekuritizácii splnili svoje príslušné úlohy, mandáty a povinnosti, by podrobnosti o sekuritizáciách, ku ktorým musia mať tieto subjekty priamy a okamžitý prístup, mali byť harmonizovaným a konzistentným spôsobom porovnateľné medzi archívmi sekuritizačných údajov. Tieto podrobnosti by sa preto mali poskytovať vo formáte rozšíriteľného značkového jazyka (*Extensible Markup Language* – XML), keďže sa vo veľkej miere používa vo finančnom sektore.

(5) Mala by sa zabezpečiť dôvernosť každého druhu výmeny údajov medzi archívmi sekuritizačných údajov a subjektmi uvedenými v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402. Takéto výmeny by sa preto mali uskutočňovať prostredníctvom zabezpečeného pripojenia zariadení s použitím protokolov šifrovania údajov. Na zabezpečenie minimálnych spoločných noriem by sa mal použiť protokol prenosu súborov SSH.

([1]) Ú. v. EÚ L 347, 28.12.2017, s. 35.

(6) Údaje týkajúce sa najnovších podkladových expozícií sekuritizácie, správ pre investorov, dôverných informácií a informácií o významných udalostiach, ako aj ukazovatele kvality a včasnosti týchto údajov sú nevyhnutné pre priebežné monitorovanie investičných pozícií sekuritizácie a potenciálnych investícií, ako aj finančnej stability a systémového rizika. Subjekty uvedené v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 by preto mali mať k týmto údajom *ad hoc* alebo pravidelný, vopred stanovený prístup primeraný ich potrebám.

(7) Sekuritizácie sú zložité a heterogénne a používatelia pristupujúci k informáciám z archívov sekuritizačných údajov sú rôzni. Je preto nevyhnutné umožniť priamy a okamžitý prístup k špecifickým súborom údajov a informáciám. Keď sa informácie týkajú údajov a všetkých aktuálnych i historických informácií o sekuritizácii uložených v archíve, tento prístup by mal zahŕňať prístup v strojovo čitateľnom formáte. Na tento účel by sa mal vytvoriť rámec pre *ad hoc* žiadosti, ktoré môžu byť kombinované so žiadosťami o konkrétne informácie. Lehoty, v rámci ktorých by archívy sekuritizačných údajov mali poskytovať údaje subjektom uvedeným v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402, by sa mali zosúladiť s cieľom uľahčiť efektívne spracúvanie údajov týmito subjektmi a archívmi sekuritizačných údajov. Zároveň by sa malo zabezpečiť, aby sa údaje poskytovali v lehotách, ktoré umožnia účinné plnenie povinností žiadajúcich subjektov.

(8) Subjekty uvedené v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 sa spoliehajú na údaje uchovávané archívmi sekuritizačných údajov vrátane porovnania súčasných sekuritizácií s minulými sekuritizáciami. Preto je vhodné spresniť, že archívy by mali uchovávať záznamy o sekuritizácii počas 10 rokov od ukončenia sekuritizácie v súlade s článkom 10 ods. 2 nariadenia (EÚ) 2017/2402 a článkom 80 ods. 3 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 ([2]).

(9) Ustanovenia tohto nariadenia sú úzko prepojené, keďže sa zaoberajú normami a postupmi týkajúcimi sa zhromažďovania a spracúvania informácií, ktoré uchovávajú archívy sekuritizačných údajov, a prístupom k týmto informáciám. Je preto vhodné zahrnúť tieto ustanovenia do jedného nariadenia.

(10) Toto nariadenie vychádza z návrhu regulačných technických predpisov, ktorý Európsky orgán pre cenné papiere a trhy (ESMA) predložil Komisii.

(11) Orgán ESMA vykonal otvorené verejné konzultácie k návrhu regulačných technických predpisov, z ktorých toto nariadenie vychádza, analyzoval možné súvisiace náklady a prínosy a požiadal o stanovisko Skupinu zainteresovaných strán v oblasti cenných papierov a trhov zriadenú v súlade s článkom 37 nariadenia Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 ([3]),

PRIJALA TOTO NARIADENIE:

Článok 1

Vymedzenie pojmov

Na účely tohto nariadenia sa uplatňuje toto vymedzenie pojmov:

a) „vykazujúci subjekt“ je subjekt určený v súlade s článkom 7 ods. 2 nariadenia (EÚ) 2017/2402;

b) „koncový dátum vykazovania údajov“ je referenčný dátum informácií vykazovaných v súlade s delegovaným nariadením Komisie (EÚ) 2020/1224 ([4]).

([2]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 648/2012 zo 4. júla 2012 o mimoburzových derivátoch, centrálnych protistranách a archívoch obchodných údajov (Ú. v. EÚ L 201, 27.7.2012, s. 1).

([3]) Nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) č. 1095/2010 z 24. novembra 2010, ktorým sa zriaďuje Európsky orgán dohľadu (Európsky orgán pre cenné papiere a trhy) a ktorým sa mení a dopĺňa rozhodnutie č. 716/2009/ES a zrušuje rozhodnutie Komisie 2009/77/ES (Ú. v. EÚ L 331, 15.12.2010, s. 84).

([4]) Delegované nariadenie Komisie (EÚ) 2020/1224 zo 16. októbra 2019, ktorým sa dopĺňa nariadenie Európskeho parlamentu a Rady (EÚ) 2017/2402, pokiaľ ide o regulačné technické predpisy, v ktorých sa spresňujú informácie a údaje o sekuritizácii, ktoré má sprístupňovať originátor, sponzor a účelový subjekt zaoberajúci sa sekuritizáciou (pozri stranu 1 tohto úradného vestníka).

Článok 2

Správa na konci dňa

1. Archívy sekuritizačných údajov vypracúvajú na konci každého dňa jednu súhrnnú správu o všetkých sekuritizáciách, ktoré im boli vykázané, s výnimkou akejkoľvek vykázanej sekuritizácie, ktorá bola zamietnutá v súlade s článkom 4 ods. 6 Táto správa vychádza z najnovších vykázaných informácií, nezahŕňa žiadnu vykázanú sekuritizáciu, ktorá bola zamietnutá v súlade s článkom 4 ods. 6, a obsahuje aspoň tieto informácie:

a) jedinečný identifikátor pridelený v súlade s článkom XI delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224;

b) kódy ISIN tranží, dlhopisov alebo podriadených úverov sekuritizácie, ak sú k dispozícii;

c) súčet aktuálnych zostatkov istiny všetkých tranží, dlhopisov alebo podriadených úverov sekuritizácie v EUR s použitím výmenných kurzov uverejnených za predchádzajúci pracovný deň na webovom sídle Európskej centrálnej banky;

d) názov sekuritizácie;

e) či ide o sekuritizáciu ABCP alebo sekuritizáciu s výnimkou ABCP;

f) či je typ sekuritizačnej štruktúry „M“ v prípade hlavného fondu (*Master Trust*), ako sa vykazuje v poli SESS9 prílohy XIV k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224, alebo „S“ v prípade všetkých ostatných sekuritizácií;

g) či je metóda presunu sekuritizačného rizika „T“ pri skutočnom predaji, ako sa vykazuje v poli IVSS11 prílohy XII k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224, „S“ pri syntetickej sekuritizácii, ako sa vykazuje v poli SESV11 prílohy XIV k uvedenému nariadeniu, alebo „ABCP“ v prípade sekuritizácií ABCP;

h) názov a identifikátor právnickej osoby (LEI) originátora, sponzora a účelového subjektu zaoberajúceho sa sekuritizáciou (SSPE);

i) dátum poslednej platby úrokov vo formáte dátumu podľa normy ISO 8601;

j) časovú pečiatku s uvedením dátumu a času podľa normy ISO 8601 (UTC – koordinovaný svetový čas), s presnosťou na najbližšiu sekundu, posledného predloženia údajov archívu sekuritizačných údajov, alebo ak existujú viaceré predloženia údajov, ktoré sa vzťahujú na ten istý koncový dátum vykazovania údajov, časové pečiatky [s dátumom a časom uvedeným vo formáte podľa normy ISO 8601 (UTC)] najskoršieho a posledného predloženia údajov s rovnakým koncovým dátumom vykazovania údajov;

k) koncový dátum posledného predloženia údajov archívu sekuritizačných údajov vo formáte podľa normy ISO 8601;

l) počet predložení údajov prijatých archívom sekuritizačných údajov, ktoré sa vzťahujú na ten istý koncový dátum vykazovania údajov, ako sa uvádza v písmene k);

m) bodové hodnotenie úplnosti údajov vypracované vo vzťahu k poslednému predloženiu údajov prijatému archívom sekuritizačných údajov, ako sa uvádza v článku 3;

n) v prípade sekuritizácií s výnimkou ABCP krajinu, v ktorej je usadený originátor alebo pôvodný veriteľ;

o) v prípade sekuritizácií ABCP krajinu, v ktorej je usadený sponzor;

p) krajinu, v ktorej sa podľa aktuálneho zostatku istiny podkladových expozícií nachádza väčšina podkladových expozícií;

q) najbežnejší typ podkladových expozícií v sekuritizácii podľa aktuálneho zostatku istiny.

r) Na účely písmena n), ak sú podkladové expozície sekuritizácie kombináciou expozícií od viacerých originátorov alebo pôvodných veriteľov, krajinou usadenia originátora alebo pôvodného veriteľa je krajina originátora alebo pôvodného veriteľa, ktorý má podľa aktuálneho zostatku istiny v sekuritizácii najväčšiu hodnotu expozícií.

2. Archívy sekuritizačných údajov sprístupňujú správu na konci dňa vo formáte XML.

3. Časové pečiatky uvedené v tomto článku sa nesmú odchyľovať o viac než jednu sekundu od koordinovaného svetového času (UTC) stanoveného a udržiavaného jedným z časových centier uvedených v najnovšej výročnej správe Medzinárodného úradu pre miery a váhy o činnostiach v oblasti času.

Článok 3

Bodové hodnotenie úplnosti údajov

4. Archívy sekuritizačných údajov vypracúvajú bodové hodnotenie úplnosti údajov pre každé predloženie údajov za pomoci matice bodového hodnotenia uvedenej v tabuľke 1 prílohy a týchto vstupných údajov:

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

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

kde:

$\sum_i^N NDx$ označuje celkový počet polí, v ktorých sa pri predložení údajov uviedli hodnoty s poznámkou „žiadne údaje“, vykázané v súlade s článkom 9 ods. 3 delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224.

N označuje celkový počet polí, v ktorých sa pri predložení údajov nemôžu uviesť žiadne hodnoty s poznámkou „žiadne údaje“ (ND1 až ND4), vykázané v súlade s článkom 9 ods. 3 delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224.

Na účely výpočtu bodového hodnotenia úplnosti údajov sa polia vyplnené vo formáte „ND4-RRRR-MM-DD“ chápu ako „ND4“.

Článok 4

Overovanie úplnosti a konzistentnosti informácií

1. Archívy sekuritizačných údajov overujú úplnosť a konzistentnosť informácií, ktoré im boli vykázané, a to tak, že skontrolujú:

a) názov vykazujúceho subjektu, ako sa uvádza v poli IVSS4 prílohy XII alebo v poli IVAS3 prílohy XIII k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224

b) či je kód predloženej položky, ako sa uvádza v tabuľke 3 prílohy I k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224, správny.

2. Pokiaľ ide o informácie uvedené v článku 7 ods. 1 písm. a), e), f) a g) nariadenia (EÚ) 2017/2402, archívy sekuritizačných údajov overujú úplnosť a konzistentnosť informácií tak, že:

a) overujú, či sú vykázané informácie v súlade so štruktúrou a formátom vzorov stanovených v prílohách II až XV k vykonávaciemu nariadeniu Komisie (EÚ) 2020/1225 ([5]);

b) porovnajú informácie vykázané:

   i) v rôznych poliach pre rovnaký koncový dátum vykazovania údajov a v súvislosti s tou istou podkladovou expozíciou, správou pre investorov, dôvernými informáciami alebo informáciami o významných udalostiach;

   ii) v rovnakom poli pre rovnaký koncový dátum vykazovania údajov a v súvislosti s rôznymi podkladovými expozíciami, správami pre investorov, dôvernými informáciami alebo informáciami o významných udalostiach;

   iii) v rovnakom poli pre rôzne koncové dátumy vykazovania údajov a v súvislosti s tou istou podkladovou expozíciou, správou pre investorov, dôvernými informáciami alebo informáciami o významných udalostiach;

   iv) pri podobných sekuritizáciách;

([5]) Vykonávacie nariadenie Komisie (EÚ) 2020/1225 z 29. októbra 2019, ktorým sa stanovujú vykonávacie technické predpisy, pokiaľ ide o formát a štandardizované vzory sprístupňovania informácií a údajov o sekuritizácii zo strany originátora, sponzora a účelového subjektu zaoberajúceho sa sekuritizáciou (SSPE) (pozri stranu 217 tohto úradného vestníka).

c) overujú, či sú koncový dátum vykazovania údajov a časová pečiatka použitá pri predkladaní údajov v súlade s článkom 10 delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224;

d) overujú, či sa poznámka „žiadne údaje“ stanovená v článku 9 ods. 3 delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224, použila len v povolených prípadoch, a či nebránila tomu, aby predloženie údajov dostatočne reprezentovalo podkladové expozície v sekuritizácii.

V prípade sekuritizácií ABCP sa odkazy na podkladové expozície v tomto odseku považujú za odkazy na druhy podkladových expozícií.

3. Archívy sekuritizačných údajov overujú úplnosť a konzistentnosť dokumentácie, ktorá im bola sprístupnená podľa článku 7 ods. 1 písm. b) nariadenia (EÚ) 2017/2402, a to tak, že vykazujúce subjekty požiadajú o písomné potvrdenie, že:

a) všetky položky uvedené v tabuľke 3 prílohy I k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224;, ktoré musia byť sprístupnené podľa článku 7 ods. 1 písm. b) nariadenia (EÚ) 2017/2402, sa poskytli archívu sekuritizačných údajov;

b) dokumentácia je v súlade so skutočnými úpravami a vlastnosťami sekuritizácie.

4. Písomné potvrdenie uvedené v odseku 3 sa vyžaduje v týchto lehotách:

a) do piatich pracovných dní od prvej emisie cenných papierov v rámci sekuritizácie alebo v prípade sekuritizácií ABCP do piatich pracovných dní od prvej emisie cenných papierov v rámci programu ABCP;

b) každých dvanásť mesiacov od dátumov žiadostí uvedených v písmene a);

c) do piatich pracovných dní od sprístupnenia nového dokumentu podľa článku 7 ods. 1 písm. b) nariadenia (EÚ) 2017/2402.

Archív sekuritizačných údajov, ktorý nedostal písomné potvrdenie do 14 dní odo dňa podania žiadosti uvedenej v prvom pododseku, požiada vykazujúci subjekt, aby mu ho poskytol do 14 dní.

5. Archívy sekuritizačných údajov overujú, či je oznámenie o STS uvedené v článku 7 ods. 1 písm. d) nariadenia (EÚ) 2017/2402, ktoré im bolo sprístupnené, v súlade so štruktúrou a formátom vzorov stanovených v prílohách k vykonávaciemu nariadeniu Komisie (EÚ) 2020/1227 ([6]).

6. Archív sekuritizačných údajov zamieta predloženie neúplných alebo nekonzistentných informácií podľa odsekov 1, 2 a 5 s výnimkou odseku 2 písm. b) bodov iii) a iv). Archív sekuritizačných údajov zahrňuje predložené informácie zamietnuté podľa tohto odseku do jednej z kategórií zamietnutia uvedených v tabuľke 2 prílohy.

7. Archív sekuritizačných údajov bez zbytočného odkladu informuje subjekty uvedené v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 o tom, že:

a) predložené informácie sú neúplné alebo nekonzistentné podľa odseku 2 písm. b) bodov iii) a iv);

b) archív sekuritizačných údajov nedostal písomné potvrdenie uvedené v odseku 3.

8. Do jednej hodiny od prijatia informácií uvedených v článku 7 nariadenia (EÚ) 2017/2402 poskytnú archívy sekuritizačných údajov vykazujúcim subjektom podrobnú spätnú väzbu o výsledkoch overovania vykonaného podľa odsekov 1, 2, 3 a 5 vrátane akejkoľvek kategórie zamietnutia priradenej podľa odseku 6. Táto spätná väzba zahŕňa aspoň tieto informácie:

a) jedinečný identifikátor sekuritizácie pridelený v súlade s článkom 11 delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224;

([6]) Vykonávacie nariadenie Komisie (EÚ) 2020/1227 z 12. novembra 2019, ktorým sa stanovujú vykonávacie technické predpisy, pokiaľ ide o vzory na poskytovanie informácií v súlade s požiadavkami na oznámenie o STS (pozri stranu 315 tohto úradného vestníka).

b) kód(-y) položky uvedený(-é) v tabuľke 3 prílohy I k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224;

c) časovú pečiatku predloženia vykázaných informácií s uvedením dátumu a času podľa normy ISO 8601 (UTC – koordinovaný svetový čas), s presnosťou na najbližšiu sekundu.

9. Archívy sekuritizačných údajov vypracujú každý pondelok do 19.00.00 UTC správu o všetkých informáciách, ktoré zamietli od 19.00.00 UTC v predchádzajúci pondelok. Správa obsahuje aspoň tieto informácie:

a) jedinečný identifikátor sekuritizácie pridelený v súlade s článkom 11 delegovaného nariadenia (EÚ) 2020/1224;

b) názov sekuritizácie;

c) kódy ISIN tranží, dlhopisov alebo podriadených úverov sekuritizácie, ak sú k dispozícii;

d) názov a identifikátor právnickej osoby (LEI) originátora, sponzora a účelového subjektu zaoberajúceho sa sekuritizáciou (SSPE);

e) časovú pečiatku predložených informácií s uvedením dátumu a času podľa normy ISO 8601 (UTC – koordinovaný svetový čas), s presnosťou na najbližšiu sekundu;

f) kód predkladanej položky uvedený v tabuľke 3 prílohy I k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224;

g) kategóriu zamietnutia uvedenú v tabuľke 2 prílohy k tomuto nariadeniu a osobitné okolnosti priradenia uvedenej kategórie zamietnutia;

h) akékoľvek vysvetlenie(-a), ktoré vykazujúci subjekt poskytol pred 17.00.00 UTC v pondelok, t. j. v deň uverejnenia správy, o tom, prečo sú vykázané informácie neúplné alebo nekonzistentné, alebo prečo nebolo poskytnuté písomné potvrdenie uvedené v odseku 3.

Článok 5

Podrobnosti o informáciách, ku ktorým sa má poskytnúť prístup

Podrobnosti o informáciách uvedené v článku 17 ods. 2 písm. c) nariadenia (EÚ) 2017/2402 zahŕňajú:

a) všetky informácie, ktoré archív sekuritizačných údajov dostal od vykazujúcich subjektov v súlade s nariadením (EÚ) 2017/2402;

b) správu na konci dňa uvedenú v článku 2, bodové hodnotenie úplnosti údajov uvedené v článku 3 a všetky informácie vyplývajúce z overení vykonaných podľa článku 4 tohto nariadenia;

c) všetky vzorce a výpočtové a agregačné metódy použité na získanie informácií uvedených v písmenách a) a b).

Článok 6

Podmienky prístupu k podrobnostiam o informáciách

1. Prístup k informáciám uvedeným v článku 5 sa poskytuje na požiadanie. Žiadosť o prístup obsahuje tieto informácie:

a) názov žiadajúceho subjektu;

b) kontaktnú osobu žiadajúceho subjektu;

c) typ žiadajúceho subjektu podľa článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402, ktorý žiada o prístup;

d) mená osôb v žiadajúcom subjekte, ktoré budú mať prístup k požadovaným informáciám;

e) prihlasovacie údaje na zabezpečené pripojenie prostredníctvom protokolu prenosu súborov SSH, ako sa vyžaduje v článku 7 ods. 2;

f) či ide o žiadosť *ad hoc* alebo o vopred stanovenú pravidelnú žiadosť;

g) identifikáciu požadovaných informácií na základe ktorejkoľvek z kombinácií kritérií uvedených v odseku 4;

h) akékoľvek ďalšie technické informácie týkajúce sa prístupu žiadajúceho subjektu.

2. Na účely odseku 1 archívy sekuritizačných údajov:

a) určia osobu alebo osoby zodpovedné za styk so subjektmi uvedenými v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402;

b) zverejnia na svojom webovom sídle podmienky prístupu k informáciám a pokyny na podanie žiadosti o prístup k týmto informáciám;

c) poskytnú prístup len k informáciám uvedeným v žiadosti o prístup;

d) čo najskôr, ale najneskôr do 30 dní od podania žiadosti o vytvorenie prístupu k týmto informáciám, stanovia technické opatrenia potrebné na to, aby sa subjektom uvedeným v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 umožnilo predkladať žiadosti o prístup k týmto informáciám.

3. Prístup k informáciám uvedeným v článku 5 sa poskytuje v týchto lehotách:

a) v prípade *ad hoc* alebo vopred stanovenej pravidelnej žiadosti o správu na konci dňa, ako sa uvádza v článku 2, najneskôr do 19.00.00 UTC dňa, ktorého sa správa týka;

b) najneskôr do 12.00.00 UTC v prvý deň nasledujúci po dni doručenia žiadosti o prístup, ak sa informácie týkajú sekuritizácie, ktorá ešte nebola ocenená, ktorá ešte nie je splatná alebo ktorej splatnosť uplynula menej ako jeden rok pred dátumom predloženia žiadosti;

c) najneskôr do troch pracovných dní odo dňa doručenia žiadosti o prístup, ak sa informácie týkajú sekuritizácie, ktorej splatnosť uplynula viac ako jeden rok pred dátumom predloženia žiadosti;

d) najneskôr do troch pracovných dní odo dňa doručenia žiadosti o prístup, ak sa informácie týkajú viacerých sekuritizácií podľa písmen b) a c).

4. Archívy sekuritizačných údajov poskytujú subjektom uvedeným v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 prístup k informáciám uvedeným v článku 5, a to na základe ľubovoľnej kombinácie týchto kritérií:

a) typ sekuritizácie: sekuritizácia s výnimkou ABCP alebo sekuritizácia ABCP;

b) typ sekuritizačnej štruktúry: buď „M“ v prípade hlavného fondu (*Master Trust*), ako sa vykazuje v poli SESS9 prílohy XIV k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224, alebo „S“ v prípade všetkých ostatných sekuritizácií;

c) metóda presunu sekuritizačného rizika: buď „Y“ pri skutočnom predaji, ako sa vykazuje v poli IVSS11 prílohy XII k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224, „Y“ pri syntetickej sekuritizácii, ako sa vykazuje v poli SESV11 prílohy XIV k uvedenému nariadeniu, alebo „ABCP“ v prípade sekuritizácií ABCP;

d) kód sekuritizačnej položky;

e) druh podkladovej expozície sekuritizácie;

f) oddiel vzoru podkladovej expozície sekuritizácie;

g) oddiel vzoru sekuritizačnej správy pre investorov;

h) oddiel vzoru pre dôverné informácie o sekuritizácii alebo informácie o významných udalostiach;

i) identifikátor:

   i) jedinečný identifikátor;

   ii) identifikátor transakcie;

   iii) medzinárodné identifikačné číslo cenných papierov;

iv) nový alebo pôvodný identifikátor tranže/dlhopisu;

v) nový alebo pôvodný identifikátor podkladovej expozície;

vi) nový alebo pôvodný identifikátor dlžníka;

vii) identifikátor právnickej osoby originátora;

viii) identifikátor právnickej osoby sponzora;

ix) identifikátor právnickej osoby účelového subjektu zaoberajúceho sa sekuritizáciou;

x) identifikátor právnickej osoby pôvodného veriteľa;

xi) identifikátor právnickej osoby správcu CLO (záväzok zabezpečený úvermi);

j) geografia:

i) zemepisný región;

ii) rozhodné právo;

k) dátum a čas:

i) časová pečiatka predloženia údajov;

ii) koncový dátum vykazovania údajov;

iii) dátum emisie tranže/dlhopisu;

iv) dátum zmluvne dohodnutej splatnosti tranže/dlhopisu;

v) dátum vzniku podkladovej expozície;

vi) dátum splatnosti podkladovej expozície;

l) mena:

i) mena tranže/dlhopisu;

ii) menová denominácia podkladovej expozície.

5. Archívy sekuritizačných údajov sprístupňujú vo formáte XML tieto informácie:

a) informácie uvedené v článku 7 ods. 1 písm. a) a d) až g) nariadenia (EÚ) 2017/2402;

b) informácie získané archívmi sekuritizačných údajov v súlade s článkami 2 a 4 tohto nariadenia, s výnimkou písomných potvrdení prijatých podľa článku 4 ods. 3

Článok 7

Normy pre zhromažďovanie údajov a prístup k nim

1. Archívy sekuritizačných údajov používajú na prijímanie údajov od vykazujúcich subjektov alebo iných archívov sekuritizačných údajov a na prenos údajov subjektom uvedeným v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402 elektronické podpisy a protokoly šifrovania údajov.

2. Na účely odseku 1 archívy sekuritizačných údajov vytvoria a udržiavajú bezpečné rozhranie medzi zariadeniami a toto rozhranie sprístupnia vykazujúcim subjektom a subjektom uvedeným v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402. Toto rozhranie využíva protokol prenosu súborov SSH.

3. Archívy sekuritizačných údajov používajú na komunikáciu cez rozhranie uvedené v odseku 2 štandardizované správy XML a sprístupňujú informácie uvedené v článku 6 ods. 5 tohto nariadenia subjektom uvedeným v článku 17 ods. 1 nariadenia (EÚ) 2017/2402.

Článok 8

Uchovávanie záznamov

1. Archívy sekuritizačných údajov zaznamenávajú tieto informácie:

a) overenia podľa tohto nariadenia a akúkoľvek inú validáciu vykonanú archívom sekuritizačných údajov;

b) písomné potvrdenia doručené do archívu sekuritizačných údajov uvedené v článku 4 ods. 3;

c) výsledky, ktoré archív sekuritizačných údajov poskytol vykazujúcemu subjektu podľa článku 4 ods. 6;

d) akékoľvek vysvetlenie vykazujúceho subjektu, pokiaľ ide o to, prečo sú predložené informácie neúplné alebo nekonzistentné alebo prečo nebolo doručené žiadne písomné potvrdenie, ako sa uvádza v článku 4 ods. 7;

e) v denníku vykazovania údaje o všetkých opravách alebo zrušeniach, ktoré oznámil vykazujúci subjekt;

f) akékoľvek ďalšie informácie, ktoré sa získajú alebo predložia podľa tohto nariadenia.

2. Každý záznam sa uchováva 10 rokov po ukončení sekuritizácie, na ktorú sa vzťahuje daný záznam.

3. Denník vykazovania uvedený v odseku 1 písm. d) obsahuje jedinečný identifikátor sekuritizácie, kód položky, časovú pečiatku príslušného predloženia údajov, časovú pečiatku zmien a jasný opis zmien predložených informácií vrátane predchádzajúceho a nového obsahu týchto informácií.

Článok 9

Nadobudnutie účinnosti

Toto nariadenie nadobúda účinnosť dvadsiatym dňom po jeho uverejnení v *Úradnom vestníku Európskej únie*.

Toto nariadenie je záväzné v celom rozsahu a priamo uplatniteľné vo všetkých členských štátoch.

V Bruseli 29. novembra 2019

Za Komisiu
predseda
Jean Claude JUNCKER

PRÍLOHA

Matica bodového hodnotenia úplnosti údajov a kategórie zamietnutia

Tabuľka 1

Matica bodového hodnotenia úplnosti údajov

		Vstupný údaj 1: Percentuálny podiel polí označených ako „ND1“			
		Vstupný údaj 1 = 0 %	0 % < Vstupný údaj 1 ≤ 10 %	10 % < Vstupný údaj 1 ≤ 30 %	Vstupný údaj 1 > 30 %
Vstupný údaj 2: Percentuálny podiel polí označených ako „ND2“, „ND3“ alebo „ND4-RRRR-MM-DD“	Vstupný údaj 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < Vstupný údaj 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < Vstupný údaj 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	Vstupný údaj 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabuľka 2

Kategórie zamietnutia

Kategórie zamietnutia	**Dôvod**
Schéma	Predloženie informácií sa zamietlo z dôvodu nevyhovujúcej schémy.
Povolenie	Predloženie informácií sa zamietlo, pretože vykazujúcemu subjektu nebolo udelené povolenie vykazovať informácie v mene originátora, sponzora alebo účelového subjektu zaoberajúceho sa sekuritizáciou.
Logické dôvody	Predloženie informácií sa zamietlo, pretože kód položky nie je v súlade s hodnotami uvedenými v tabuľke 3 prílohy 1 k delegovanému nariadeniu (EÚ) 2020/1224.
Činnosť	Predloženie informácií sa zamietlo, pretože nie je v súlade s jedným alebo viacerými potvrdeniami obsahu.
Reprezentatívnosť	Predloženie informácií sa zamietlo podľa článku 4 ods. 6.