KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2020/1226

af 12. november 2019

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 og reguleringsmæssige tekniske standarder, der præciserer, hvilke oplysninger der skal indberettes i overensstemmelse med STS-meddelelseskravene

(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 27, stk. 6, og

ud fra følgende betragtninger:

(1) I henhold til forordning (EU) 2017/2402 skal eksponeringsleverende institutter og organiserende institutter indberette visse oplysninger til Den Europæiske Værdipapir- og Markedstilsynsmyndighed (ESMA), hvis de anser en securitisering for at opfylde kravene vedrørende kriterierne for simpel, transparent og standardiseret securitisering (STS-kriterierne), der er omhandlet i nævnte forordnings artikel 19-22 og 23-26. De oplysninger, der skal indberettes, er forskellige afhængigt af de forskellige typer meddelte securitiseringer.

(2) For at gøre det muligt for de kompetente myndigheder at varetage deres opgaver og for investorer og potentielle investorer at udvise rettidig omhu er det nødvendigt med tilstrækkeligt detaljerede oplysninger, som er relevante for STS-meddelelsen, for at afgøre, om STS-kriterierne er opfyldt. Begrundelsen for at vælge en given homogenitetsfaktor og for at udelukke andre bør navnlig indgå i meddelelsen for at danne grundlag for vurderingen af homogenitetskriteriet. For visse STS-kriterier er det tilstrækkeligt blot med en bekræftelse af overholdelse, mens andre kriterier kræver yderligere oplysninger. Det er derfor nødvendigt at skelne mellem krav, i forbindelse med hvilke det er tilstrækkeligt blot med en bekræftelse, og krav, i forbindelse med hvilke det er nødvendigt med en koncis eller detaljeret redegørelse.

(3) Securitiseringer, i forbindelse med hvilke der i henhold til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1129 ([2]) ikke er krav om udfærdigelse af et prospekt (private securitiseringer), gør det muligt for parterne at indgå i securitiseringstransaktioner uden at offentliggøre følsomme forretningsmæssige oplysninger. De oplysninger, der skal offentliggøres i forbindelse med STS-meddelelserne om sådanne securitiseringer, bør derfor begrænses til ikke-følsomme forretningsmæssige oplysninger.

(4) For at lette adgangen til oplysninger, som er relevante for STS-kravene, bør eksponeringsleverende institutter og organiserende institutter kunne henvise til det relevante prospekt, som i henhold til forordning (EU) 2017/1129 er udfærdiget i forbindelse med den givne securitisering, anden relevant underliggende dokumentation som omhandlet i artikel 7, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 eller andre dokumenter med oplysninger, som er relevante for STS-meddelelsen.

(5) Denne forordning er baseret på det udkast til reguleringsmæssige tekniske standarder, som ESMA har forelagt Kommissionen.

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

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

([2]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1129 af 14. juni 2017 om det prospekt, der skal offentliggøres, når værdipapirer udbydes til offentligheden eller optages til handel på et reguleret marked, og om ophævelse af direktiv 2003/71/EF (EUT L 168 af 30.6.2017, s. 12).

([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. 4).

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Oplysninger, der skal indgå i STS-meddelelsen

1. Følgende oplysninger skal i henhold til artikel 27 i forordning (EU) 2017/2402 indgå i STS-meddelelsen:

a) hvis securitiseringen er en ikke-ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i bilag I til denne forordning

b) hvis securitiseringen er en ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i bilag II til denne forordning

c) for et ABCP-program, de oplysninger, der er præciseret i bilag III til denne forordning.

2. For securitiseringer, i forbindelse med hvilke der i henhold til forordning (EU) 2017/1129 ikke skal udfærdiges et prospekt, ledsages de oplysninger, der i henhold til stk. 1 skal indgå i STS-meddelelsen, af følgende:

a) hvis securitiseringen er en ikke-ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i felt STSS9 og STSS10 i bilag I til denne forordning

b) hvis securitiseringen er en ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i felt STSAT9 og STSAT10 i bilag II til denne forordning

c) for et ABCP-program, de oplysninger, der er præciseret i felt STSAP9 i bilag III til denne forordning.

For så vidt angår artikel 27, stk. 1, tredje afsnit, i forordning (EU) 2017/2402 begrænses offentliggørelsen af STS-meddelelsen for disse securitiseringer til de oplysninger, der er omhandlet i nærværende stykke.

Artikel 2

Supplerende oplysninger

Hvis følgende dokumenter omfatter oplysninger, som er relevante for STS-meddelelsen, kan der indsættes en henvisning til de relevante dele af disse dokumenter i kolonnen »Yderligere oplysninger« i bilag I, II eller III til denne forordning, og hvis sådanne oplysninger gives, skal dokumentationen klart identificeres:

a) et prospekt udfærdiget i henhold til forordning (EU) 2017/1129

b) anden underliggende dokumentation som omhandlet i artikel 7, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/2402

c) andre dokumenter med oplysninger, som er relevante for STS-meddelelsen.

Artikel 3

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 12. november 2019.

På Kommissionens vegne
Jean-Claude JUNCKER
Formand

BILAG I

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 19-22 i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende ikkeABCP-securitiseringer

Generelle oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES [1]	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS0	Artikel 27, stk. 1	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980 [2]
STSS1	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	Det eller de internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-nummer), hvis et sådant nummer foreligger. Hvis et sådant ikke foreligger, et andet entydigt værdipapirnummer tildelt denne securitisering.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980.
STSS2	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de eksponeringsleverende institutter og det eller de organiserende institutter og den eller de oprindelige långivere, hvis en sådan kode foreligger.	Punkt 4.2 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS3	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSS4	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed i overensstemmelse med artikel 11, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2020/1224 [3].	Ikke relevant
STSS5	Ikke relevant	Prospektidentifikator	Prospektidentifikator som tildelt af den relevante kompetente myndighed, hvis en sådan identifikator foreligger.	Ikke relevant
STSS6	Ikke relevant	Securitiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSS7	Ikke relevant	Securitiseringens navn	Securitiseringens navn.	Afsnit 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS8	Artikel 18 og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de eksponeringsleverende institutter, det eller de organiserende institutter, SSPE'en eller SSPE'erne og den eller de oprindelige långivere, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant

STSS9	Ikke relevant	Securitiseringsklassifikation	Securitiseringstype: — ikkeABCP-securitisering — ABCP-securitisering — ABCP-program.	Ikke relevant
STSS10	Ikke relevant	Underliggende eksponeringers klassifikation	Type underliggende eksponeringer, herunder: 1) boliglån, som enten er sikret ved et eller flere panter i beboelsesejendom, eller som fuldt ud garanteres af en anerkendt udbyder af kreditrisikoafdækning, jf. artikel 201, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013, der kan henføres til kreditkvalitetstrin 2 eller derover som fastsat i nævnte forordnings tredje del, afsnit II, kapitel 2 2) kommercielle lån, som er sikret ved et eller flere panter i erhvervsejendom, herunder kontorer eller andre forretningslokaler 3) kreditfaciliteter til enkeltpersoner til personligt, familiemæssigt eller husholdningsmæssigt forbrug 4) kreditfaciliteter, herunder lån og leasing, til alle typer virksomheder eller selskaber 5) billån og -leasing 6) kreditkorttilgodehavender 7) tilgodehavender fra salg 8) andre underliggende eksponeringer, der af det eksponeringsleverende eller organiserende institut anses for at svare til en bestemt aktivtype på grundlag af interne metoder og parametre	Ikke relevant
STSS11	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Hvis der er udfærdiget et prospekt i overensstemmelse med forordning (EU) 2017/1129 ([4]), datoen for prospektets godkendelse. I alle andre tilfælde, slutdatoen for den seneste transaktion.	Ikke relevant
STSS12	Ikke relevant	Meddelelsesdato	Datoen for meddelelse til ESMA.	Ikke relevant
STSS13	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepartsvirksomhed.	Ikke relevant

STSS14	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemsted.	Ikke relevant
STSS15	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt den.	Ikke relevant
STSS16	Artikel 27, stk. 5	STS-status	En begrundet meddelelse fra det eksponeringsleverende institut og det organiserende institut om, at securitiseringen ikke længere skal anses for at være STS.	Ikke relevant
STSS17	Artikel 27, stk. 3	Eksponeringsleverende institut (eller oprindelig långiver) ikke et kreditinstitut	En erklæring om, hvorvidt det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver er (»Ja«) eller ikke er (»Nej«) et kreditinstitut eller et investeringsselskab etableret i Unionen.	Ikke relevant
STSS18	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af långivningskriterier	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers kriterier for långivning, processer og systemer er i overensstemmelse med artikel 9 i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSS19	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af, at långivningen er omfattet af tilsyn	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at långivningen som omhandlet i artikel 27, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 er omfattet af tilsyn.	Ikke relevant

([1]) Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

([2]) Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980 af 14. marts 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1129 for så vidt angår format, indhold, kontrol og godkendelse af det prospekt, der skal offentliggøres, når værdipapirer udbydes til offentligheden eller optages til handel på et reguleret marked, og om ophævelse af Kommissionens forordning (EF) nr. 809/2004 (EUT L 166 af 21.6.2019, s. 26).

([3]) Kommissionens delegerede forordning (EU) 2020/1224 af 16. oktober 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår reguleringsmæssige forskrifter, som præciserer de oplysninger og de detaljer vedrørende en securitisering, som det eksponeringsleverende institut, det organiserende institut eller SSPE'en skal stille til rådighed (EUT L 289 af 3.9.2020, s. 1)..

([4]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1129 af 14. juni 2017 om det prospekt, der skal offentliggøres, når værdipapirer udbydes til offentligheden eller optages til handel på et reguleret marked, og om ophævelse af direktiv 2003/71/EF (EUT L 168 af 30.6.2017, s. 12).

Specifikke oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES [1]	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS20	Artikel 20, stk. 1	Overførsel af underliggende eksponeringer ved egentligt salg (»true sale«) eller tildeling		√		En koncis redegørelse for, hvordan overførslen af de underliggende eksponeringer foretages ved egentligt salg (»true sale«) eller en overførsel med samme retlige virkning på en måde, som kan håndhæves over for sælger eller enhver tredjepart.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS21	Artikel 20, stk. 2	Ingen strenge tilbagetagelsesklausuler (»severe clawback provisions«)		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt strenge tilbagetagelsesklausuler som omhandlet i artikel 20, stk. 2, litra a) eller b), i forordning (EU) 2017/2402 forefindes i securitiseringen, og en angivelse af, om bestemmelserne i artikel 20, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402 finder anvendelse.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS22	Artikel 20, stk. 3	Undtagelse for tilbagetagelsesklausuler i national lovgivning om insolvens	√			Sammenholdt med STSS21, hvis det er relevant, en bekræftelse af, at ingen omstændigheder kan give anledning til tilbagetagelsesklausuler i overensstemmelse med artikel 20, stk. 1 og 2, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS23	Artikel 20, stk. 4	Overførsel, hvis sælger ikke er den oprindelige långiver	√			Hvis sælger ikke er den oprindelige långiver, en erklæring, som bekræfter, at securitiseringen er i overensstemmelse med artikel 20, stk. 1-3, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS24	Artikel 20, stk. 5	Overførsel sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt		√		Hvis overførslen af de underliggende eksponeringer sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt end ved securitiseringens afslutning, en koncis redegørelse for, hvordan og hvorvidt de hændelser, som udløser en sådan sikring, mindst omfatter de krævede på forhånd fastlagte hændelser som opført i artikel 20, stk. 5, i forordning (EU) 2017/2402. Hvis overførslen sker ved hjælp af alternative mekanismer, en bekræftelse af, at insolvens i forbindelse med det eksponeringsleverende institut ikke vil hindre SSPE'en i at håndhæve sine rettigheder.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSS25	Artikel 20, stk. 6	Erklæringer og garantier		√		En koncis redegørelse for, hvordan og hvorvidt sælger har tilvejebragt erklæringer og garantier for, at de underliggende eksponeringer, der omfattes af securitiseringen, ikke er behæftede eller på anden måde i en tilstand, som må forventes at påvirke håndhævelsen af det egentlige salg (»true sale«) eller tildelingen eller overførslen med samme retlige virkning negativt.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS26	Artikel 20, stk. 7	Kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljeforvaltning af de underliggende eksponeringer på et skønsmæssigt grundlag		√		En koncis redegørelse for, hvordan: — de underliggende eksponeringer, som overføres fra eller tildeles af sælger til SSPE'en, opfylder på forhånd fastsatte, klare og veldokumenterede kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljeforvaltning af nævnte eksponeringer på et skønsmæssigt grundlag — udvælgelsen og overførslen af de underliggende eksponeringer i securitiseringen er baseret på klare processer, som gør det lettere at konstatere, hvilke eksponeringer der udvælges eller overføres til securitiseringen, og at de ikke giver mulighed for aktiv porteføljeforvaltning af dem på et skønsmæssigt grundlag.	Afsnit 2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS27	Artikel 20, stk. 8	Aktivernes homogenitet			√	En detaljeret redegørelse for homogeniteten af den pulje af underliggende eksponeringer, der sikrer securitiseringen. Med henblik herpå indsættes en henvisning til EBA's reguleringsmæssige tekniske standarder homogenitet (Kommissionens delegerede forordning (EU)2019/1851 [2]) og en detaljeret beskrivelse af, hvordan hver af betingelserne i artikel 1 i nævnte delegerede forordning er opfyldt.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS28	Artikel 20, stk. 9	Forpligtelser relateret til underliggende eksponeringer: Ingen resecuritisering	√			En bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer ikke omfatter securitiseringer, og at den meddelte securitisering derfor ikke er en resecuritisering.	Punkt 2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSS29	Artikel 20, stk. 10	Bevillingsstandardens forsvarlighed			√	En detaljeret redegørelse for: — hvorvidt de underliggende eksponeringer blev indgået som led i långivers almindelige virksomhed, og hvorvidt de anvendte bevillingsstandarder ikke var mindre strenge end dem, som blev anvendt på det samme tidspunkt for indgåelse over for eksponeringer, som ikke blev securitiseret — hvorvidt bevillingsstandarderne og eventuelle væsentlige ændringer i forhold til forudgående bevillingsstandarder er eller vil blive gjort fuldt tilgængelige for potentielle investorer uden unødig forsinkelse — hvordan i tilfælde af securitiseringer, hvor de underliggende eksponeringer er boliglån, puljen af underliggende eksponeringer opfylder kravet i artikel 20, stk. 10, andet afsnit, i forordning (EU) 2017/2402 — hvorvidt vurderingen af låntagerens kreditværdighed opfylder kravene i artikel 8 i direktiv 2008/48/EF ([3]) eller artikel 18, stk. 1-4, stk. 5, litra a), og stk. 6, i direktiv 2014/17/EU ([4]) eller, hvis det er relevant, tilsvarende krav i tredjelande.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS30	Artikel 20, stk. 10	Eksponeringsleverende instituts/långivers ekspertise			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver har ekspertise inden for indgåelse af eksponeringer af samme art som de securitiserede.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS31	Artikel 20, stk. 11	Overførte underliggende eksponeringer uden misligholdte eksponeringer			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt: — de overførte underliggende eksponeringer ikke på tidspunktet for udvælgelsen omfatter misligholdte eksponeringer (eller omlagte eksponeringer) som defineret i artikel 20, stk. 11, i forordning (EU) 2017/2402 — kravene i artikel 20, stk. 11, litra a), nr. i) og ii), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt — kravene i artikel 20, stk. 11, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

						— kravene i artikel 20, stk. 11, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt.	
STSS32	Artikel 20, stk. 12	Mindst én betaling på overførselstidspunktet	√			En bekræftelse af, at låntagerne på det tidspunkt, hvor eksponeringerne overføres, har erlagt mindst én betaling. En bekræftelse af, at undtagelsen i artikel 20, stk. 12, i forordning (EU) 2017/2402 finder eller ikke finder anvendelse.	Punkt 3.3 og 3.4.6 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS33	Artikel 20, stk. 13	Tilbagebetalingen til indehaverne må ikke struktureres således, at den hovedsageligt afhænger af salget af aktiver.			√	En detaljeret redegørelse for det omfang, hvori tilbagebetalingen til indehaverne af securitiseringspositionerne afhænger af salget af aktiver, som sikrer de underliggende eksponeringer.	Punkt 3.4.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS34	Artikel 21, stk. 1	Opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse		√		En koncis redegørelse for, hvordan det eksponeringsleverende institut, det organiserende institut eller den oprindelige långiver i forbindelse med en ikke-ABCP-securitisering opfylder kravet om risikotilbageholdelse som omhandlet i artikel 6 i forordning (EU) 2017/2402. En angivelse af, hvilken enhed der tilbageholder den væsentlige nettoøkonomiske interesse, og af, hvilken mulighed der anvendes til at tilbageholde risikoen: 1) vertikal del i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 2) sælgers andel i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 3) tilfældigt udvalgte eksponeringer på balancen i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 4) first loss-tranche i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 5) first loss-eksponering i hvert aktiv i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra e), i forordning (EU) 2017/2402 6) manglende opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse i artikel 6, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402 7) andre muligheder anvendt.	Punkt 3.1 i bilag 9 og punkt 3.4.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSS35	Artikel 21, stk. 2	Reduktion af rente- (IR) og valutarisici (FX)		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt rente- og valutarisiciene er begrænset på passende vis, og at der er truffet foranstaltninger til at begrænse sådanne risici, og en bekræftelse af, at investorer har adgang til sådanne foranstaltninger.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS36	Artikel 21, stk. 2	Derivater købt/solgt af SSPE		√		En koncis redegørelse for, at SSPE'en kun har indgået derivataftaler under de omstændigheder, der er omhandlet i artikel 21, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS37	Artikel 21, stk. 2	Derivater, som anvender almindelige standarder		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt anvendte afdækningsinstrumenter er tegnet og dokumenteret i overensstemmelse med almindeligt anerkendte standarder.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS38	Artikel 21, stk. 3	Refererede rentebetalinger baseret på almindeligt anvendte rentesatser		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt og hvordan alle refererede rentebetalinger vedrørende aktiver og forpligtelser i securitiseringen er beregnet på grundlag af almindeligt anvendte markedsrentesatser eller almindeligt anvendte sektorbestemte rentesatser, der afspejler finansieringsomkostningerne.	Punkt 2.2.2 og 2.2.13 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS39	Artikel 21, stk. 4	Kontantbeløb tilbageholdes ikke som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse		√		En generel erklæring om, at alle kravene i artikel 21, stk. 4, i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS40	Artikel 21, stk. 4	a) Intet kontantbeløb tilbageholdes	√			Bekræftelse af, at intet kontantbeløb tilbageholdes som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS41	Artikel 21, stk. 4	b) Indtægter fra afdrag videregives til investorerne	√			Bekræftelse af, at indtægter fra afdrag på de underliggende eksponeringer videregives til investorerne via sekventielle afdrag på securitiseringspositionerne i overensstemmelse med securitiseringspositionens rangorden.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSS42	Artikel 21, stk. 4	c) Tilbagebetaling af securitiseringspositioner må ikke ændres i forhold til rangorden	√			Bekræftelse af, at tilbagebetalingen af securitiseringspositionerne ikke må ændres i forhold til disses rangorden.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS43	Artikel 21, stk. 4	c) Ingen bestemmelser må kræve automatisk likvidation af de underliggende eksponeringer til markedsværdi	√			Bekræftelse af, at ingen bestemmelser kræver automatisk likvidation af de underliggende eksponeringer til markedsværdi.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS44	Artikel 21, stk. 5	Securitiseringer med ikkesekventiel prioritering af betalinger	√			Bekræftelse af, at transaktioner kendetegnet ved ikkesekventiel prioritering af betalinger omfatter hændelser, der er relateret til udviklingen i de underliggende eksponeringer, der medfører, at prioriteringen af betalinger igen ændres til sekventiel prioritering af betalinger. Bekræftelse af, at sådanne hændelser som minimum omfatter forringelsen af de underliggende eksponeringers kreditkvalitet, som bringer denne ned under en på forhånd fastlagt tærskel.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS45	Artikel 21, stk. 6	Revolverende securitisering med førtidsindfrielse baseret på forud fastsatte hændelser for afslutning af den revolverende periode		√		En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne i artikel 21, stk. 6, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS46	Artikel 21, stk. 6, litra a)	a) Forringelse af de underliggende eksponeringers kreditkvalitet		√		En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne i artikel 21, stk. 6, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS47	Artikel 21, stk. 6, litra b)	b) Forekomst af en insolvensrelateret hændelse med hensyn til det eksponeringsleverende institut eller administrationsselskabet		√		En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne eller hændelserne i artikel 21, stk. 6, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSS48	Artikel 21, stk. 6, litra c)	c) Værdien af de underliggende eksponeringer, som SSPE'en besidder, når ned under en på forhånd fastlagt tærskel		√		En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne eller hændelserne i artikel 21, stk. 6, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant, ved brug af krydshenvisninger til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS49	Artikel 21, stk. 6, litra d)	d) Der genereres ikke tilstrækkeligt med nye underliggende eksponeringer, som opfylder den på forhånd fastlagte kreditkvalitet (hændelse for afslutning af den revolverende periode)		√		En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne i artikel 21, stk. 6, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS50	Artikel 21, stk. 7, litra a)	a) Oplysninger om aftalemæssige forpligtelser for administrationsselskabet, trustee og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser	√			Bekræftelse af, at transaktionsdokumentationen indeholder en præcisering af alle kravene i artikel 21, stk. 7, litra a), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS51	Artikel 21, stk. 7, litra b)	b) Bestemmelser om kontinuerlig servicering	√			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen udtrykkeligt opfylder kravene i artikel 21, stk. 7, litra b), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS52	Artikel 21, stk. 7, litra c)	c) Bestemmelser om kontinuerlige derivatmodparter	√			Bekræftelse af, at transaktionsdokumentationen indeholder alle de oplysninger, der er omhandlet i artikel 21, stk. 7, litra c), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS53	Artikel 21, stk. 7, litra c)	c) Bestemmelser om kontinuerlige likviditetsstillere og kontinuerlig kontoførende bank	√			Bekræftelse af, at transaktionsdokumentationen indeholder alle de oplysninger, der er omhandlet i artikel 21, stk. 7, litra c), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSS54	Artikel 21, stk. 8	Krav til administrationsselskabet om ekspertise og politikker og passende procedurer og risikostyringskontroller			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan kravene i artikel 21, stk. 8, er opfyldt. Som en del af redegørelsen indsættes der henvisninger til politikker og procedurer, som skal sikre, at disse krav opfyldes.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS55	Artikel 21, stk. 9	Klare og konsekvente definitioner vedrørende behandling af problemlån	√			Bekræftelse af, at den underliggende dokumentation på klar og konsekvent vis fastsætter definitioner, afhjælpende foranstaltninger og foranstaltninger relateret til gældssituationer som omhandlet i artikel 21, stk. 9, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS56	Artikel 21, stk. 9	Prioriteringer af betalinger og hændelser, der udløser tiltag	√			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen angiver prioriteringerne af betalinger og hændelser, der udløser tiltag, i overensstemmelse med artikel 21, stk. 9, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS57	Artikel 21, stk. 10	Rettidig løsning af konflikter mellem investorklasser & det ansvar, som påhviler trustee	√			Bekræftelse af, at bestemmelserne i artikel 21, stk. 10, i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende rettidig løsning af konflikter er overholdt.	Punkt 3.4.7 og 3.4.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS58	Artikel 22, stk. 1	Data vedrørende historisk misligholdelse og tabsudvikling	√			Bekræftelse af, at de data, der skal gøres tilgængelige i henhold til artikel 22, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, er tilgængelige, med en klar angivelse af, hvor oplysningerne kan findes.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS59	Artikel 22, stk. 2	Stikprøve af de underliggende eksponeringer, som skal kontrolleres af en ekstern instans	√			Bekræftelse af, at en stikprøve af de underliggende eksponeringer blev kontrolleret af en relevant og uafhængig ekstern instans forud for udstedelsen af værdipapirerne.	Ikke relevant
STSS60	Artikel 22, stk. 3	»Liability cash flow«-model tilgængelig for potentielle investorer	√			Bekræftelse af, at »liability cash flow«-modellen er tilgængelig for potentielle investorer forud for fastsættelsen af prisen, og en klar angivelse af, hvor disse oplysninger er tilgængelige. Efter prisfastsættelsen bekræftelse af, at sådanne oplysninger er gjort tilgængelige for potentielle investorer efter anmodning.	Ikke relevant

STSS61	Artikel 22, stk. 4	Offentliggørelse af oplysninger om miljøpræstationer for underliggende eksponeringer, som består af boliglån eller billån eller billeasingaftaler		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt oplysningerne om miljøpræstationer for de aktiver, der finansieres via boliglån eller billån eller billeasingaftaler, er tilgængelige i overensstemmelse med artikel 7, stk. 1, litra a), i forordning (EU) 2017/2402, og en angivelse af, hvor disse oplysninger kan findes.	Ikke relevant
STSS62	Artikel 22, stk. 5	Det eksponeringsleverende institut og det organiserende institut ansvarlige for overholdelse af artikel 7	√			Bekræftelse af, at: — det eksponeringsleverende institut og det organiserende institut overholder artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402 — de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, litra a), er forud for prisfastsættelsen gjort tilgængelige for potentielle investorer efter anmodning — de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, litra b)-d), er gjort tilgængelige forud for prisfastsættelsen, i det mindste i udkast eller foreløbig form.	Ikke relevant

([1]) Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

([2]) Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/1851 af 28. maj 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for homogeniteten af de underliggende securitiseringseksponeringer (EUT L 280 af 6.11.2019, s. 1).

([3]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2008/48/EF af 23. april 2008 om forbrugerkreditaftaler og om ophævelse af Rådets direktiv 87/102/EØF (EUT L 133 af 22.5.2008, s. 66).

([4]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/17/EU af 4. februar 2014 om forbrugerkreditaftaler i forbindelse med fast ejendom til beboelse og om ændring af direktiv 2008/48/EF og 2013/36/EU og forordning (EU) nr. 1093/2010 (EUT L 60 af 28.2.2014, s. 34).

BILAG II

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 24 i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende ABCP-securitiseringer

Generelle oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES [1]	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT0	Artikel 27, stk. 1	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT1	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	Det eller de internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-nummer), hvis et sådant nummer foreligger. Hvis et sådant ikke foreligger, et andet entydigt værdipapirnummer tildelt ABCP-securitiseringen.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980.
STSAT2	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de eksponeringsleverende institutter og/eller det eller de organiserende institutter, hvis en sådan kode foreligger.	Punkt 4.2 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT3	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSAT4	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed til denne ABCP-transaktion i overensstemmelse med artikel 11, stk. 2, i delegeret forordning (EU) 2020/1224.	Ikke relevant
STSAT5	Ikke relevant	Prospektidentifikator	Prospektidentifikator som tildelt af den relevante kompetente myndighed, hvis en sådan identifikator foreligger.	Ikke relevant
STSAT6	Ikke relevant	Securitiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSAT7	Ikke relevant	Securitiseringens navn	Securitiseringens navn, hvis et sådant foreligger, eller hvis et sådant ikke foreligger, kodenavnet og det anvendte navn.	Afsnit 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT8	Artikel 18 og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de eksponeringsleverende institutter, det eller de organiserende institutter, SSPE'en eller SSPE'erne, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSAT9	Ikke relevant	Securitiseringsklassifikation	Securitiseringstype: — ikkeABCP — ABCP; — ABCP-program.	Ikke relevant

STSAT10	Ikke relevant	Underliggende eksponeringers klassifikation	Type underliggende eksponeringer, herunder: 1. boliglån, som enten er sikret ved et eller flere panter i beboelsesejendom, eller som fuldt ud garanteres af en anerkendt udbyder af kreditrisikoafdækning, jf. artikel 201, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013, der kan henføres til kreditkvalitetstrin 2 eller derover som fastsat i nævnte forordnings tredje del, afsnit II, kapitel 2 2. kommercielle lån, som er sikret ved et eller flere panter i erhvervsejendom, herunder kontorer eller andre forretningslokaler 3. kreditfaciliteter til enkeltpersoner til personligt, familiemæssigt eller husholdningsmæssigt forbrug 4. kreditfaciliteter, herunder lån og leasing, til alle typer virksomheder eller selskaber 5. billån og -leasing 6. kreditkorttilgodehavender 7. tilgodehavender fra salg 8. andre underliggende eksponeringer, der af det eksponeringsleverende eller organiserende institut anses for at svare til en bestemt aktivtype på grundlag af interne metoder og parametre.	Ikke relevant
STSAT11	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Hvis der er udfærdiget et prospekt i overensstemmelse med forordning (EU) 2017/1129, datoen for prospektets godkendelse. Hvis ikke, ABCP-securitiseringens udstedelsesdato.	Ikke relevant
STSAT12	Ikke relevant	Meddelelsesdato	Datoen for meddelelse til ESMA.	Ikke relevant
STSAT13	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepartsvirksomhed.	Ikke relevant
STSAT14	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemsted.	Ikke relevant

STSAT15	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i securitiseringsforordningen, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt denne.	Ikke relevant
STSAT16	Artikel 27, stk. 5	STS-status	Hvorvidt det eksponeringsleverende institut og/eller det organiserende institut har meddelt, at ABCP-securitiseringen ikke længere skal anses for at være STS, og begrundelsen for en sådan meddelelse.	Ikke relevant
STSAT17	Artikel 27, stk. 3	Eksponeringsleverende institut (eller oprindelig långiver) ikke et kreditinstitut	En erklæring om, hvorvidt det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver er (»Ja«) eller ikke er (»Nej«) et kreditinstitut eller et investeringsselskab etableret i Unionen.	Ikke relevant
STSAT18	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af långivningskriterier	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers kriterier for långivning, processer og systemer er i overensstemmelse med artikel 9 i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAT19	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af, at långivningen er omfattet af tilsyn	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at långivningen som omhandlet i artikel 27, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 er omfattet af tilsyn.	Ikke relevant

([1]) Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

Specifikke oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ([1])	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT20	Artikel 24, stk. 1	Underliggende eksponeringer erhvervet ved egentligt salg (»true sale«)		√		En koncis redegørelse for, hvordan overførslen af de underliggende eksponeringer foretages ved egentligt salg (»true sale«) eller tildeling med samme retlige virkning på en måde, som kan håndhæves over for sælger eller enhver tredjepart.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT21	Artikel 24, stk. 2	Ingen strenge tilbagetagelsesklausuler (»severe clawback provisions«)		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt strenge tilbagetagelsesklausuler som omhandlet i artikel 24, stk. 2, litra a) eller b), i forordning (EU) 2017/2402 forefindes i securitiseringen, og hvorvidt bestemmelserne i artikel 24, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402 finder anvendelse.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSAT22	Artikel 24, stk. 3	Undtagelse for tilbagetagelsesklausuler i national lovgivning om insolvens	√			Sammenholdt med STSS21, hvis det er relevant, en bekræftelse af, at ingen omstændigheder kan give anledning til tilbagetagelsesklausuler i overensstemmelse med artikel 24, stk. 1 og 2, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT23	Artikel 24, stk. 4	Overførsel, hvis sælger ikke er den oprindelige långiver	√			Hvis sælger ikke er den oprindelige långiver, en erklæring, som bekræfter, at securitiseringen er i overensstemmelse med artikel 24, stk. 1-3, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT24	Artikel 24, stk. 5	Overførsel sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt.		√		Hvis overførslen af de underliggende eksponeringer sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt end ved securitiseringens afslutning, gives der en koncis redegørelse for, hvordan og hvorvidt de hændelser, som udløser en sådan sikring, mindst omfatter de krævede på forhånd fastlagte hændelser som opført i artikel 24, stk. 5, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT25	Artikel 24, stk. 6	Erklæringer og garantier		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt sælger har tilvejebragt erklæringer og garantier for, at de aktiver, der omfattes af securitiseringen, ikke er behæftede eller på anden måde i en tilstand, som må forventes at påvirke håndhævelsen af det egentlige salg (»true sale«) eller tildelingen eller overførslen med samme retlige virkning negativt.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT26	Artikel 24, stk. 7	Kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljeforvaltning af de underliggende eksponeringer på et skønsmæssigt grundlag		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt: — de underliggende eksponeringer, som overføres fra eller tildeles af sælger til SSPE'en, opfylder på forhånd fastsatte, klare og veldokumenterede kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljeforvaltning af nævnte eksponeringer på et skønsmæssigt grundlag — udvælgelsen og overførslen af de underliggende eksponeringer i securitiseringen er baseret på klare processer, som gør det lettere at konstatere, hvilke eksponeringer der udvælges eller overføres til securitiseringen, og at de ikke giver mulighed for aktiv porteføljeforvaltning af dem på et skønsmæssigt grundlag.	Afsnit 2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSAT27	Artikel 24, stk. 8	Ingen resecuritisering	√			Bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer ikke omfatter securitiseringspositioner, og at den meddelte securitisering derfor ikke er en resecuritisering.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT28	Artikel 24, stk. 9	Overførte underliggende eksponeringer uden misligholdte eksponeringer			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan de overførte underliggende eksponeringer ikke omfatter på tidspunktet for udvælgelsen misligholdte eksponeringer eller omlagte eksponeringer som omhandlet i artikel 24, stk. 9, i forordning (EU) 2017/2402, hvis det er relevant. En klar redegørelse for, hvorvidt securitiseringen omfatter kreditsvage tilstande på securitiseringstidspunktet som omhandlet i artikel 24, stk. 9, litra a), nr. i), i forordning EU 2017/2402, hvis det er relevant. Bekræftelse af, at: — på tidspunktet for indgåelse er kravene i artikel 24, stk. 9, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 opfyldt — på tidspunktet for udvælgelse er kravene i artikel 24, stk. 9, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 opfyldt.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT29	Artikel 24, stk. 10	Mindst én betaling på overførselstidspunktet	√			Bekræftelse af, at låntagerne på det tidspunkt, hvor eksponeringerne overføres, har erlagt mindst én betaling. Hvis der ikke er erlagt betalinger, en redegørelse for, hvorfor dette er tilfældet, herunder en angivelse af, hvorvidt årsagen er den, at en af de undtagelser, der er tilladt i henhold til artikel 20, stk. 12, i forordning (EU) 2017/2402, finder anvendelse.	Punkt 3.3 og 3.4.6 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT30	Artikel 24, stk. 11	Tilbagebetalingen til indehaverne må ikke struktureres således, at den hovedsageligt afhænger af salget af aktiver.			√	En detaljeret redegørelse for det omfang, hvori tilbagebetalingen til indehaverne af securitiseringspositionerne afhænger af salget af aktiver, som sikrer de underliggende eksponeringer. En detaljeret redegørelse for, hvorvidt tilbagebetalinger til investorerne ikke anses for at afhænge af salget af aktiver som omhandlet i artikel 24, stk. 11, andet afsnit, i forordning (EU) 2017/2402, hvis det er relevant.	Punkt 3.4.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

STSAT31	Artikel 24, stk. 12	Reduktion af rente- (IR) og valutarisici (FX)		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt og hvordan rente- og valutarisiciene er begrænset på passende vis, og en bekræftelse af, at de foranstaltninger, der er truffet med henblik herpå, er offentliggjort. En koncis redegørelse for, hvorvidt anvendte afdækningsinstrumenter er tegnet og dokumenteret i overensstemmelse med almindeligt anerkendte standarder.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT32	Artikel 24, stk. 12	Derivater købt/solgt af SSPE		√		Medmindre disse tjener til afdækning af rente- eller valutarisici, en koncis redegørelse for, hvorvidt SSPE'en ikke har indgået derivataftaler.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT33	Artikel 24, stk. 12	Derivater i underliggende eksponeringer		√		En koncis redegørelse for tilstedeværelsen af derivater i puljen af underliggende eksponeringer.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT34	Artikel 24, stk. 12	Derivater, som anvender almindelige standarder		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt derivater, som kan tillades i henhold til artikel 24, stk. 12, er tegnet og dokumenteret i overensstemmelse med almindelige standarder for international finansiering.	Punkt 3.4.7 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT35	Artikel 24, stk. 13	Klare og konsekvente definitioner vedrørende behandling af problemlån	√			Bekræftelse af, at den underliggende dokumentation på klar og konsekvent vis fastsætter definitioner, afhjælpende foranstaltninger og foranstaltninger relateret til gældssituationer som omhandlet i artikel 24, stk. 13, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT36	Artikel 24, stk. 13	Prioriteringer af betalinger og hændelser, der udløser tiltag	√			Bekræftelse af, at transaktionsdokumentationen angiver prioriteringerne af betalinger og hændelser, der udløser tiltag, i overensstemmelse med artikel 24, stk. 13, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.7 og 3.4.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT37	Artikel 24, stk. 14	Data vedrørende historisk misligholdelse og tabsudvikling	√			Bekræftelse af, at de data, der skal gøres tilgængelige i henhold til artikel 24, stk. 14, i forordning (EU) 2017/2402, er tilgængelige, og en klar angivelse af, hvor oplysningerne er tilgængelige for potentielle investorer forud for prisfastsættelsen. Hvis det organiserende institut ikke har adgang til sådanne data, bekræftelse af, at sælgeren har givet adgang til data som omhandlet i artikel 24, stk. 14, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

						Bekræftelse af, at dataene er tilgængelige, og en klar angivelse af, hvor oplysningerne er tilgængelige, og at dataene omfatter en periode på mindst fem år, undtagen for data, der vedrører tilgodehavender fra salg og andre kortfristede tilgodehavender, hvis historiske periode ikke er kortere end tre år.	
STSAT38	Artikel 24, stk. 15	Aktivernes homogenitet			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan securitiseringen er sikret ved en pulje af underliggende eksponeringer, som er homogene, idet der tages hensyn til de særlige karakteristika, der er forbundet med de forskellige aktivtypers pengestrømme, herunder deres karakteristika med hensyn til kontrakter, kreditrisiko og forudbetaling.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT39	Artikel 24, stk. 15	Forpligtelser relateret til underliggende eksponeringer	√			Bekræftelse af, at puljen af underliggende eksponeringer har en vægtet gennemsnitlig restløbetid på højst ét år, og at ingen af de underliggende eksponeringer har en restløbetid på over tre år. Bekræftelse af, hvorvidt undtagelsen vedrørende puljer af billån, billeasing eller leasingtransaktioner vedrørende udstyr finder anvendelse i overensstemmelse med artikel 24, stk. 15, tredje afsnit, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT40	Artikel 24, stk. 15	Forpligtelser relateret til underliggende eksponeringer	√			Bekræftelse af, hvis det er relevant, at de underliggende eksponeringer: — ikke omfatter lån sikret ved pant i beboelses- eller erhvervsejendom eller boliglån med fuld garanti som omhandlet i artikel 129, stk. 1, første afsnit, litra e), i forordning (EU) nr. 575/2013 [2] — indeholder forpligtelser, som er kontraktmæssigt bindende, og som kan håndhæves med fuld regresret over for låntagerne og er forbundet med fastsatte betalingsstrømme, som er betalinger vedrørende leje, hovedstol og renter, eller som er relateret til eventuelle andre rettigheder til at modtage indkomst fra aktiver, som garanterer sådanne betalinger	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

						— ikke omfatter værdipapirer som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 44), i direktiv 2014/65/EU ([3]), bortset fra erhvervsobligationer, som ikke er opført i et handelssystem.	
STSAT41	Artikel 24, stk. 16	Refererede rentebetalinger baseret på almindeligt anvendte rentesatser		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt og hvordan alle refererede rentebetalinger vedrørende aktiver og forpligtelser i ABCP-securitiseringen er beregnet på grundlag af almindeligt anvendte markedsrentesatser eller almindeligt anvendte sektorbestemte rentesatser, der afspejler finansieringsomkostningerne.	Punkt 2.2.2 og 2.2.13 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT42	Artikel 24, stk. 17	Kontantbeløb tilbageholdes ikke som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt de enkelte krav i artikel 24, stk. 17, i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt, herunder en koncis redegørelse for tilfælde, hvor kontantbeløb kan tilbageholdes.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT43	Artikel 24, stk. 17	a) Kontantbeløb tilbageholdes ikke som følge af påkrav eller opsigelse	√			Bekræftelse af, at intet kontantbeløb tilbageholdes som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT44	Artikel 24, stk. 17	b) Indtægter fra afdrag videregives til investorerne	√			Bekræftelse af, at indtægter fra afdrag på de underliggende eksponeringer videregives til investorer via sekventielle afdrag på securitiseringspositionerne i overensstemmelse med securitiseringspositionens rangorden.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT45	Artikel 24, stk. 17	c) Ingen bestemmelser må kræve automatisk likvidation af de underliggende eksponeringer til markedsværdi	√			Bekræftelse af, at ingen bestemmelser kræver automatisk likvidation af de underliggende eksponeringer til markedsværdi.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT46	Artikel 24, stk. 18	Bevillingsstandardernes forsvarlighed			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt de underliggende eksponeringer blev indgået som led i sælgers almindelige virksomhed, og det præciseres, hvorvidt bevillingsstandarderne ikke er mindre strenge end dem, som blev anvendt over for eksponeringer, som ikke blev securitiseret.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

						En detaljeret redegørelse for, hvorvidt eventuelle væsentlige ændringer i forhold til forudgående bevillingsstandarder har været tilgængelige for det organiserende institut og andre parter, der er direkte eksponeret mod ABCP-securitiseringen.	
STSAT47	Artikel 24, stk. 18	Sælgers ekspertise			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt sælger har den fornødne ekspertise inden for indgåelse af eksponeringer af samme art som de securitiserede.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT48	Artikel 24, stk. 19	Revolverende ABCP-securitisering/hændelse relateret til kreditkvalitet.			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan bestemmelserne eller hændelserne i artikel 24, stk. 19, i forordning (EU) 2017/2402 indgår i securitiseringsdokumentationen.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT49	Artikel 24, stk. 20	Pligter relateret til securitiseringsdeltagere	√			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter de aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar for det organiserende institut, administrationsselskabet og trustee, hvis det er relevant, og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT50	Artikel 24, stk. 20	Bestemmelser om kontinuerlig servicering	√			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter processer og ansvar, som er nødvendige for at sikre, at misligholdelse fra administrationsselskabets side eller dettes insolvens ikke medfører, at varetagelsen af forvaltningsopgaven ophører.	Punkt 3.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT51	Artikel 24, stk. 20	Bestemmelser om kontinuerlig derivatmodpart og kontoførende bank	√			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter bestemmelser, der sikrer udskiftning af derivatmodparter og kontoførende bank i tilfælde af misligholdelse fra disses side, disses insolvens og andre angivne hændelser, hvis det er relevant.	Punkt 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT52	Artikel 24, stk. 20	Det eksponeringsleverende instituts robusthed	√			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter bestemmelser om, hvordan det organiserende institut opfylder kravene i artikel 25, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

([1]) Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.
([2]) Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 af 26. juni 2013 om tilsynsmæssige krav til kreditinstitutter og investeringsselskaber og om ændring af forordning (EU) nr. 648/2012 (EUT L 176 af 27.6.2013, s. 1).
([3]) Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af direktiv 2002/92/EF og direktiv 2011/61/EU (EUT L 173 af 12.6.2014, s. 349).

BILAG III

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 25 og 26 i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende ABCP-programmer

Generelle oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES [1]	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP0	Artikel 27, stk. 1	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP1	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	De internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-numre), der er tildelt ABCP-programmerne, hvis det er relevant.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980.
STSAP2	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de organiserende institutter og/eller ABCP-programmet eller -programmerne.	Punkt 4.2 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP3	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSAP4	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed til dette ABCP-program i overensstemmelse med artikel 11, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2020/1224.	Ikke relevant
STSAP5	Ikke relevant	Prospektidentifikator	Prospektidentifikator som tildelt af den relevante kompetente myndighed, hvis en sådan identifikator foreligger.	Ikke relevant
STSAP6	Ikke relevant	Securitiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSAP7	Ikke relevant	Securitiseringens navn	ABCP-programmets navn	Afsnit 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP8	Artikel 18 og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de organiserende institutter.	Punkt 4.3 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP9	Ikke relevant	Securitiseringsklassifikation	Type securitisering (ikkeABCP, ABCP, ABCP-program)	Ikke relevant

STSAP10	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Datoen for ABCP-programmets første udstedelse	Punkt 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP11	Ikke relevant	Meddelelsesdato	Datoen for STS-meddelelse til ESMA	Ikke relevant
STSAP12	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepartsvirksomhed.	Ikke relevant
STSAP13	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemsted.	Ikke relevant
STSAP14	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt den.	Ikke relevant
STSAP15	Artikel 27, stk. 5	STS-status	Meddelelse fra det organiserende institut om, at ABCP-programmet ikke længere skal anses for at være STS, og begrundelsen for denne ændring.	Ikke relevant

([1]) Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

Specifikke oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ([1])	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP16	Artikel 25, stk. 1	Det organiserende institut skal være et kreditinstitut under tilsyn	√			Bekræftelse af, at det organiserende institut for programmet er et kreditinstitut under tilsyn, og et link til et dokument, som dokumenterer en sådan status.	Ikke relevant
STSAP17	Artikel 25, stk. 2	Støtte fra det eksponeringsleverende institut som udbyder af en likviditetsfacilitet	√			Bekræftelse af, at det organiserende institut for ABCP-programmet udbyder en likviditetsfacilitet, og at det understøtter alle securitiseringspositioner på ABCP-programniveau, herunder en beskrivelse af likviditetsfaciliteten og et link til dokumenter, der tjener som bevis for, at en sådan er stillet til rådighed.	Ikke relevant

STSAP18	Artikel 25, stk. 3	Godtgørelse over for kreditinstituttets kompetente myndighed	√			Bekræftelse af, at kreditinstituttet i sin rolle som organiserende institut ikke bringer sin solvens og likviditet i fare, og et link, hvis et sådant findes, til det dokument, der tjener som bevis for, at kreditinstituttet har godtgjort denne stilling over for sin kompetente myndighed.	Ikke relevant
STSAP19	Artikel 25, stk. 4	Opfyldelse af kravene til det eksponeringsleverende institut om rettidig omhu	√			Bekræftelse af, at det organiserende institut opfylder kravene om at udvise rettidig omhu som omhandlet i artikel 5, stk. 1 og 3, i forordning 2017/2402, alt efter tilfældet. Bekræftelse af, at det organiserende institut har kontrolleret, at sælger har indført de påkrævede muligheder for gældsafvikling samt inddrivelsesprocedurer, som opfylder kravene i artikel 265, stk. 2, litra i)-p), i forordning (EU) nr. 575/2013 eller tilsvarende krav i tredjelande.	Ikke relevant
STSAP20	Artikel 25, stk. 5	Sælger skal (på transaktionsniveauet) eller det organiserende institut (på ABCP-programniveauet) opfylde de i artikel 6 omhandlede krav om risikotilbageholdelse.		√		En koncis redegørelse for, hvordan sælger (ABCP-securitisering) og det organiserende institut (ABCP-program) opfylder kravene om risikotilbageholdelse som omhandlet i artikel 6 i forordning (EU) 2017/2402, og det angives nærmere, hvilken mulighed der er anvendt til at tilbageholde risikoen, herunder: 1) vertikal del — dvs. artikel 6, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 2) sælgers andel — dvs. artikel 6, stk. 3, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 3) tilfældigt udvalgte eksponeringer på balancen — dvs. artikel 6, stk. 3, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 4) first loss-tranchen — dvs. artikel 6, stk. 3, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 5) first loss-eksponeringen i hvert aktiv — dvs. artikel 6, stk. 3, litra e), i forordning (EU) 2017/2402 6) manglende opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse i forordning (EU) 2017/2402 7) andet.	Punkt 3.4.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP21	Artikel 25, stk. 6	Overholdelse på ABCP-programniveau af artikel 7 (transparenskrav)	√			Bekræftelse af, at: — det organiserende institut er ansvarligt for overholdelse af artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402 — det organiserende institut overholder artikel 7 på ABCP-programniveau	Ikke relevant

						— det organiserende institut har stillet følgende til rådighed for potentielle investorer efter anmodning og forud for prisfastsættelsen: de samlede oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra a), i forordning (EU) 2017/2402, og de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra b)-e), i forordning (EU) 2017/2402, som minimum i udkast eller foreløbig form.	
STSAP22	Artikel 25, stk. 7	Træk på likviditetsfaciliteten, hvis det organiserende institut ikke fornyer finansieringstilsagn om likviditetsfaciliteten		√		En koncis redegørelse fra det organiserende institut for, hvorvidt der vil ske træk på likviditetsfaciliteten, og de værdipapirer, som udløber, vil blive tilbagebetalt, hvis det organiserende institut ikke fornyer finansieringstilsagnet om likviditetsfaciliteten inden dets udløbsdato.	Ikke relevant
STSAP23	Artikel 26, stk. 1	ABCP-securitiseringer i et ABCP-program opfylder kravene i artikel 24, stk. 1-8 og 12-20	√			Bekræftelse af, at alle ABCP-securitiseringer i programmet opfylder følgende krav: — Artikel 24, stk. 1-8, i forordning (EU) 2017/2402. — Artikel 24, stk. 12-20, i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAP24	Artikel 26, stk. 1, andet og tredje afsnit	Højst 5 % af det samlede beløb af de eksponeringer, der ligger til grund for ABCP, kan midlertidigt være i modstrid med visse krav.			√	En detaljeret redegørelse for, hvilke krav i artikel 24, stk. 9, 10 eller 11, i forordning (EU) 2017/2402 der eventuelt midlertidigt ikke opfyldes, hvilken procentdel af det samlede beløb af de eksponeringer, der ligger til grund for ABCP-securitiseringerne, dette svarer til, og hvorfor programmet midlertidigt er i modstrid med disse krav. Bekræftelse af, at en stikprøve af de underliggende eksponeringer kontrolleres regelmæssigt af en relevant, uafhængig ekstern instans.	Ikke relevant
STSAP25	Artikel 26, stk. 2	Den vægtede gennemsnitlige restløbetid (WAL) for de underliggende eksponeringer i et ABCP-program må ikke være mere end to år.	√			Bekræftelse af, at den vægtede gennemsnitlige restløbetid for de underliggende eksponeringer i et ABCP-program ikke er mere end to år.	Ikke relevant

STSAP26	Artikel 26, stk. 3	Fuldt ud understøttet ABCP-program (støtte fra eksponeringsleverende institut)		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt ABCP-programmet er fuldt ud understøttet af et organiserende institut i overensstemmelse med artikel 25, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAP27	Artikel 26, stk. 4	Ingen resecuritisering og ingen kreditforbedringen, som etablerer en trancheopdeling i andet lag på ABCP-programniveau	√			Bekræftelse af, at ABCP-programmet ikke indeholder en resecuritisering, og at kreditforbedringen ikke etablerer en trancheopdeling i andet lag på programniveau..	Ikke relevant
STSAP28	Artikel 26, stk. 5	Ingen call-optioner	√			Bekræftelse af, at ABCP-programmet ikke indeholder call-optioner, bestemmelser eller klausuler, som påvirker værdipapirernes endelige udløbstidspunkt, når sådanne optioner eller klausuler kan udøves efter sælgerens, det organiserende instituts eller SSPE'ens skøn.	Ikke relevant
STSAP29	Artikel 26, stk. 6	Rente- og valutarisici på ABCP-programniveau begrænset på passende vis og dokumenteret.			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt og hvordan rente- og valutarisici, som opstår på ABCP-programniveau, er begrænset på passende vis, og de foranstaltninger, der træffes med henblik på at begrænse sådanne risici, herunder, hvorvidt SSPE'en indgår derivataftaler af andre årsager end dem, der er omhandlet i artikel 26, stk. 6, i forordning (EU) 2017/2402, og en beskrivelse af, hvordan disse derivater tegnes og dokumenteres, navnlig om dette sker i overensstemmelse med almindelige standarder for international finansiering.	Ikke relevant
STSAP30	Artikel 26, stk. 7, litra a)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (ansvar, som påhviler trustee over for investorer)	√			Bekræftelse af, at det ansvar, som påhviler trustee og andre enheder med betroede opgaver, hvis det er relevant, over for investorer, er nærmere angivet i dokumentationen vedrørende ABCP-programmet.	Ikke relevant
STSAP31	Artikel 26, stk. 7, litra b)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (det eksponeringsleverende instituts aftalemæssige forpligtelser)	√			Bekræftelse af, at de aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar for det organiserende institut, trustee og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser, hvis det er relevant, er nærmere angivet i dokumentationen vedrørende ABCP-programmet.	Ikke relevant

STSAP32	Artikel 26, stk. 7, litra c)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (proces og ansvar i tilfælde af misligholdelse fra administrationsselskabets side)	√			Bekræftelse af, at dokumentationen vedrørende ABCP-programmet beskriver processer og ansvar, som omfatter misligholdelse fra administrationsselskabets side eller dettes insolvens, for at sikre, at varetagelsen af forvaltningsopgaven videreføres.	Ikke relevant
STSAP33	Artikel 26, stk. 7, litra d)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (bestemmelser vedrørende udskiftning af derivatmodparter og den kontoførende bank)	√			Bekræftelse af, at kravene i artikel 26, stk. 7, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt for så vidt angår bestemmelser vedrørende udskiftning af derivatmodparter og kontoførende bank på ABCP-programniveau i tilfælde af misligholdelse fra disses side, disses insolvens og andre angivne hændelser, hvis likviditetsfaciliteten ikke dækker sådanne hændelser.	Ikke relevant
STSAP34	Artikel 26, stk. 7, litra e)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (foranstaltninger med henblik på sikkerhedsstillelse for finansieringstilsagnet)	√			Bekræftelse af, at dokumentationen vedrørende ABCP-programmet omfatter procedurer, som sikrer, at der i forbindelse med angivne hændelser samt misligholdelse fra det organiserende instituts side eller dettes insolvens vil blive truffet afhjælpende foranstaltninger med henblik på sikkerhedsstillelse for finansieringstilsagnet eller udskiftning af udbyderen af likviditetsfaciliteten, hvis det er nødvendigt. En erklæring med angivelse af de relevante sider i prospektet eller anden underliggende dokumentation, der indeholder oplysninger, som er relevante for kravene i artikel 26, stk. 7, litra e), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAP35	Artikel 26, stk. 7, litra f)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (likviditetsfacilitet & værdipapirer, som udløber, og som skal tilbagebetales, hvis det eksponeringsleverende institut ikke fornyer finansieringstilsagnet om likviditetsfaciliteten inden dets udløbsdato)	√			Bekræftelse af, at dokumentationen vedrørende ABCP-programmet omfatter bestemmelser, som sikrer, at der vil ske træk på likviditetsfaciliteten, og de værdipapirer, som udløber, vil blive tilbagebetalt, hvis det organiserende institut ikke fornyer finansieringstilsagnet om likviditetsfaciliteten inden dets udløbsdato. En erklæring med angivelse af de relevante sider i prospektet eller anden underliggende dokumentation, der indeholder oplysninger, som er relevante for kravene i artikel 26, stk. 7, litra f), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant

STSAP36	Artikel 26, stk. 8	Administrationsselskabets ekspertise			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan kravene i artikel 26, stk. 8, i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt, herunder de politikker og procedurer, som sikrer, at disse krav opfyldes. En erklæring med angivelse af de relevante sider i prospektet eller anden underliggende dokumentation, der indeholder de gældende forklaringer i forhold til at opfylde kravene i artikel 26, stk. 8, i forordning (EU) 2017/2402 (hvis det er relevant) (»administrationsselskabets ekspertise, politikker, procedurer og risikostyring«).	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

([1]) Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.