DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2022/1301 DER KOMMISSION

vom 31. März 2022

zur Änderung der in der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 festgelegten technischen Regulierungsstandards im Hinblick auf die Informationen, die gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung bei synthetischen Bilanzverbriefungen zu übermitteln sind

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012 ([1]), insbesondere auf Artikel 27 Absatz 6 Unterabsatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) In der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission ([2]) ist festgelegt, welche Informationen die an einer Verbriefung Beteiligten der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) gemäß den Anforderungen an die Meldung einfacher, transparenter und standardisierter (STS-) Verbriefungen im Falle traditioneller „True-Sale"-Verbriefungen im Sinne der Artikel 19 bis 22 und 23 bis 26 der Verordnung (EU) 2017/2402 zu übermitteln haben.

(2) Mit der Verordnung (EU) 2021/557 des Europäischen Parlaments und des Rates ([3]) wurde die Verordnung (EU) 2017/2402 geändert und der Rahmen für STS-Verbriefungen auf synthetische Bilanzverbriefungen ausgeweitet. Deshalb muss festgelegt werden, welche Informationen die Originatoren der ESMA bei synthetischen Bilanzverbriefungen zu übermitteln haben, um die Anforderungen an die STS-Meldung zu erfüllen.

(3) Damit sich Anleger, potenzielle Anleger und zuständige Behörden einen vergleichenden Überblick über alle Arten von STS-Verbriefungen verschaffen können, sollte die Konsistenz der STS-Meldungen sichergestellt werden. Aus diesem Grund sollten die Informationen, die die Originatoren zur Einhaltung der STS-Anforderungen der Artikel 26b bis 26e der Verordnung (EU) 2017/2402 zu übermitteln haben, ähnlichen Standards und einem ähnlichen Detaillierungsgrad folgen, wie sie in den Anhängen I, II und III der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 festgelegt sind. So ist insbesondere bei einigen Kriterien eine einfache Bestätigung der Einhaltung ausreichend, während andere Kriterien zusätzliche Angaben erfordern. Deshalb ist es notwendig, zwischen STS-Kriterien, bei denen eine einfache Bestätigung ausreicht, und STS-Kriterien, bei denen eine kurze oder eine ausführliche Erläuterung notwendig ist, zu unterscheiden.

(4) Synthetische Bilanzverbriefungen, bei denen kein Prospekt gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates ([4]) erstellt werden muss, ermöglichen den Beteiligten den Abschluss von Verbriefungstransaktionen ohne Preisgabe sensibler Geschäftsinformationen. Daher ist es angemessen, die Informationen, die bei STS-Meldungen für solche Verbriefungen zu veröffentlichen sind, auf nicht-sensible Geschäftsinformationen zu beschränken.

([1]) ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

([2]) Delegierte Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission vom 12. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Spezifizierung der gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung zu übermittelnden Informationen (ABl. L 289 vom 3.9.2020, S. 285).

([3]) Verordnung (EU) 2021/557 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 31. März 2021 zur Änderung der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung mit dem Ziel, die Erholung von der COVID-19-Krise zu fördern (ABl. L 116 vom 6.4.2021, S. 1).

([4]) Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Juni 2017 über den Prospekt, der beim öffentlichen Angebot von Wertpapieren oder bei deren Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt zu veröffentlichen ist und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/71/EG (ABl. L 168 vom 30.6.2017, S. 12).

(5) Um den Zugang zu den für die STS-Anforderungen relevanten Informationen zu erleichtern, sollte es den Originatoren gestattet sein, auf den für eine synthetische Bilanzverbriefung gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 erstellten Prospekt oder die sonstige relevante zugehörige Dokumentation im Sinne von Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 zu verweisen. Außerdem sollte es den Originatoren gestattet sein, auf jedes andere Dokument zu verweisen, das die Anleger und Originatoren, die Besicherungsvereinbarung, den Drittpartei-Verifizierer und, soweit verfügbar, die Unterlagen zu einer Transaktion mit synthetischen Unternehmensanleihen („Credit Linked Notes“) betrifft.

(6) Um die Transparenz und Konsistenz der Angaben für miteinander verknüpfte Felder zu verbessern und über die spezifischen Merkmale bestimmter Verbriefungen, insbesondere auch von Master-Trust-Verbriefungen, Klarheit zu schaffen, muss präzisiert werden, welche Informationen bei bestimmten Feldern in den Anhängen I, II und III der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 in den Spalten „Feldbezeichnung“ und „geforderter Meldeinhalt“ anzugeben sind.

(7) Die Delegierte Verordnung (EU) 2020/1226 sollte daher entsprechend geändert werden.

(8) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der ESMA vorgelegt wurde.

(9) Die ESMA hat zu diesem Entwurf öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ([5]) eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Änderung der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226

Die Delegierte Verordnung (EU) 2020/1226 wird wie folgt geändert:

1. Artikel 1 wird wie folgt geändert:

   a) In Absatz 1 wird folgender Buchstabe d angefügt:

      „d) wenn es sich bei der Verbriefung um eine synthetische Bilanzverbriefung handelt, die in Anhang IV der vorliegenden Verordnung genannten Informationen.“

   b) In Absatz 2 wird folgender Buchstabe d eingefügt:

      „d) wenn es sich bei der Verbriefung um eine synthetische Bilanzverbriefung handelt, die in den Feldern STSSY2, STSSY10, STSSY12 und STSSY13 des Anhangs IV der vorliegenden Verordnung genannten Informationen.“

2. Artikel 2 wird wie folgt geändert:

   a) Der einleitende Satz erhält folgende Fassung:

      „Enthalten die folgenden Unterlagen Informationen, die für die STS-Meldung relevant sind, kann in der Spalte ‚Zusätzliche Informationen‘ der Anhänge I, II, III oder IV der vorliegenden Verordnung ein Verweis auf die relevanten Teile dieser Unterlagen angebracht werden, wobei klar anzugeben ist, um welche Art von Dokumentation es sich handelt:“

   b) Buchstabe c erhält folgende Fassung:

      „c) sonstige Unterlagen mit Informationen, die für die STS-Meldung relevant sind, insbesondere im Falle synthetischer Bilanzverbriefungen auch Unterlagen, die einen Originator, einen Anleger, die Besicherungsvereinbarung, den in Artikel 26e Absatz 4 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Drittpartei-Verifizierer, und, soweit verfügbar, die Dokumentation für die in Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 5 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten synthetische Unternehmensanleihen (‚Credit Linked Notes‘) betreffen.“

([5]) Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

3. Die Anhänge I, II und III werden gemäß Anhang I der vorliegenden Verordnung geändert.
4. Der in Anhang II der vorliegenden Verordnung enthaltene Anhang IV wird angefügt.

Artikel 2

Inkrafttreten

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 31. März 2022

Für die Kommission
Die Präsidentin
Ursula VON DER LEYEN

ANHANG I

Die Anhänge I, II und III der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 werden wie folgt geändert:

1. Anhang I wird wie folgt geändert:

a) In der Tabelle „Allgemeine Informationen“ erhalten die Zeilen mit den Feld-Nummern STSS4 und STSS17 folgende Fassung:

„STSS4	Entfällt	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission (*) zugewiesene eindeutige Kennung. Wird mehr als eine STS-Meldung unter Verwendung dieser eindeutigen Verbriefungskennung übermittelt, eine Erklärung, warum dies der Fall ist.	Entfällt
STSS17	Artikel 27 Absatz 3	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) ist ein Kreditinstitut	‚Ja‘ oder ‚Nein‘, je nachdem, ob es sich beim Originator bzw. ursprünglichen Kreditgeber um ein Kreditinstitut oder eine Wertpapierfirma mit Sitz in der Union handelt oder nicht.	Entfällt

(*) Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (ABl. L 289 vom 3.9.2020, S. 1).“

b) In der Tabelle „Spezifische Informationen“ erhalten die Zeilen mit den Feld-Nummern STSS21 und STSS22 folgende Fassung:

„STSS21	Artikel 20 Absatz 2	Unterliegt schwerwiegenden Rückforderungsvereinbarungen		√		Kurze Erläuterung, ob bei der Verbriefung etwaige schwerwiegende Rückforderungsvereinbarungen im Sinne von Artikel 20 Absatz 2 Buchstabe a oder b der Verordnung (EU) 2017/2402 vorliegen.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSS22	Artikel 20 Absatz 3	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht	√			Bestätigung, ob die in Artikel 20 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Rückforderungsvereinbarungen gelten.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980“

2. Anhang II wird wie folgt geändert:

a) In der Tabelle „Allgemeine Informationen“ erhalten die Zeilen mit den Feld-Nummern STSAT4 und STSAT17 folgende Fassung:

„STSAT4	Entfällt	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung. Wird mehr als eine STS-Meldung unter Verwendung dieser eindeutigen Verbriefungskennung übermittelt, eine Erklärung, warum dies der Fall ist.	Entfällt

STSAT17	Artikel 27 Absatz 3	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) ist ein Kreditinstitut	‚Ja' oder ‚Nein', je nachdem, ob es sich beim Originator bzw. ursprünglichen Kreditgeber um ein Kreditinstitut oder eine Wertpapierfirma mit Sitz in der Union handelt oder nicht.	Entfällt“

b) In der Tabelle „Spezifische Informationen“ erhalten die Zeilen mit den Feld-Nummern STSAT21 und STSAT22 folgende Fassung:

„STSAT21	Artikel 24 Absatz 2	Unterliegt schwerwiegenden Rückforderungsvereinbarungen		√		Kurze Erläuterung, ob bei der Verbriefung etwaige schwerwiegende Rückforderungsvereinbarungen im Sinne von Artikel 24 Absatz 2 Buchstabe a oder b der Verordnung (EU) 2017/2402 vorliegen.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSAT22	Artikel 24 Absatz 3	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht	√			Bestätigung, ob die in Artikel 24 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Rückforderungsvereinbarungen gelten.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980“

3. In der Tabelle „Allgemeine Informationen“ des Anhangs III erhält die Zeile mit der Feld-Nummer STSAP4 folgende Fassung:

„STSAP4	Entfällt	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung. Wird mehr als eine STS-Meldung unter Verwendung dieser eindeutigen Verbriefungskennung übermittelt, eine Erklärung, warum dies der Fall ist.	Entfällt“

ANHANG II

„ANHANG IV

Der ESMA bei Bilanzverbriefungen gemäß Artikel 26b bis 26c der Verordnung (EU) 2017/2402 zu übermittelnde Informationen

Allgemeine Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	Feldbezeichnung	Geforderter Meldeinhalt	Weitere Angaben
STSSY1	Artikel 27 Absatz 1 Unterabsatz 3	Erste Anlaufstelle	Rechtsträgerkennung (LEI) der als erste Anlaufstelle benannten Instanz und Name der jeweils zuständigen Behörde.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY2	Entfällt	Meldedatum	Datum der Meldung an die ESMA.	Entfällt
STSSY3	Entfällt	Identifikationsnummer des Finanzinstruments	Falls verfügbar, internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN) bzw. -nummern. Wenn keine ISIN verfügbar ist, andere eindeutige Wertpapier-Kennnummer (einschl. Credit-Linked-Notes), soweit verfügbar.	Falls verfügbar, weitere Angaben nach Punkt 3.1 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY4	Entfällt	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI)	LEI des Originators und des Sponsors bzw. der Originatoren und der Sponsoren und, falls verfügbar, des ursprünglichen Kreditgebers/der ursprünglichen Kreditgeber und der Verbriefungszweckgesellschaft(en).	Punkt 4.2 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY5	Artikel 31 Absatz 3	Sicherungsgeber	LEI, Name und Sitzland des/der ursprünglichen Sicherheitsgeber(s) und Name der zuständigen Behörde.	Entfällt
STSSY6	Entfällt	Kennziffer der Meldung	Bei Übermittlung einer Aktualisierung: einmalige Referenznummer, die die ESMA bei der ursprünglichen STS-Meldung vergeben hat.	Entfällt
STSSY7	Entfällt	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	Entfällt
STSSY8	Entfällt	Verbriefungsregister	Falls verfügbar, Name des registrierten Verbriefungsregisters.	Entfällt
STSSY9	Artikel 18 Unterabsatz 2 und Artikel 27 Absatz 3	Sitzland	Land, in dem der/die Originator(en), Sponsor(en), ursprüngliche(n) Kreditgeber und Verbriefungszweckgesellschaft(en) seinen/ihren Sitz hat/haben.	Entfällt

STSSY10	Entfällt	Klassifizierung der synthetischen Verbriefung	Art der synthetischen Verbriefung: — synthetische Verbriefung mit Besicherung mit Sicherheitsleistung; — synthetische Verbriefung mit Absicherung ohne Sicherheitsleistung.	Entfällt
STSSY11	Entfällt	Synthetische Verbriefung mit Absicherung ohne Sicherheitsleistung	Name des Sicherungsgebers (Staat oder supranationale Einrichtung mit einem Risikogewicht von 0 %).	Entfällt
STSSY12	Entfällt	Genutzte Besicherungsvereinbarung	Art der genutzten Besicherungsvereinbarung: — Kreditderivate; — Finanzgarantien.	Entfällt
STSSY13	Entfällt	Klassifizierung der zugrunde liegenden Risikopositionen	Art der zugrunde liegenden Risikopositionen, unter anderem: 1) Risikopositionen aus Handelsfinanzierungsgeschäften; 2) Kredite an kleine und mittlere Unternehmen (KMU); 3) Verbraucherkredite; 4) Kredite an Großunternehmen; 5) Mischung aus Krediten an KMU und Großunternehmen; 6) Risikopositionen aus Gewerbeimmobilien; 7) Sonstige.	Entfällt
STSSY14	Entfällt	Ausgabedatum	Abschlussstichtag der Transaktion und, falls davon abweichend, das Datum, an dem die Sicherungsvereinbarung wirksam wird.	Entfällt
STSSY15	Artikel 27 Absatz 2 Unterabsatz 2	Zugelassener Dritt-Überprüfer — Erklärung	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: eine Erklärung, dass die Erfüllung der STS-Kriterien durch diesen zugelassenen Dritten bestätigt wurde.	Entfällt
STSSY16	Artikel 27 Absatz 2 Unterabsatz 2	Zugelassener Dritt-Überprüfer — Name und Sitzland	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name und Sitzland dieses Dritten.	Entfällt
STSSY17	Artikel 27 Absatz 2 Unterabsatz 2	Zugelassener Dritt-Überprüfer — zuständige Behörde	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name der zuständigen Behörde, die die Zulassung erteilt hat.	Entfällt

STSSY18	Artikel 27 Absatz 5	STS-Status	Falls anwendbar, eine mit Gründen versehene Meldung des Originators, dass die synthetische Verbriefung nicht mehr als STS anzusehen ist.	Entfällt

Spezifische Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	Feldbezeichnung	Bestätigung	Kurze Erläuterung	Ausführliche Erläuterung	Geforderter Meldeinhalt	Weitere Angaben
STSSY19	Artikel 26b Absatz 1 Unterabsatz 1	Originator ist ein in der Union beaufsichtigtes Unternehmen	√			Bestätigung, dass es sich beim Originator um ein in der Union zugelassenes oder lizenziertes Unternehmen handelt.	Entfällt
STSSY20	Artikel 26b Absatz 1 Unterabsatz 2	Verfahrensweise des Originators mit von Dritten erworbenen Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung, dass der Originator bei Risikopositionen eines Dritten, die er auf eigene Rechnung erworben und dann verbrieft hat, in Bezug auf Kreditvergabe, Inkasso, Forderungsverwertung und Forderungsverwaltung nicht weniger streng verfährt als bei vergleichbaren Risikopositionen, die nicht erworben wurden.	Entfällt
STSSY21	Artikel 26b Absatz 2	Originierung der zugrunde liegenden Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen im Rahmen der Kerngeschäftstätigkeit des Originators originiert werden.	Entfällt
STSSY22	Artikel 26b Absatz 3 Unterabsatz 1	Zum Abschlussstichtag der Transaktion in der Bilanz des Originators gehaltene Vermögenswerte	√			Bestätigung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen zum Abschlussstichtag einer Transaktion in der Bilanz des Originators oder eines Unternehmens gehalten werden, das derselben Gruppe wie der Originator angehört.	Entfällt
STSSY23	Artikel 26b Absatz 3 Unterabsatz 2	Art der Gruppe	√			Für Feld STSSY22 eine Bestätigung, welche der beiden folgenden Arten von Gruppen die relevante ist:	Entfällt

						a) eine Gruppe von juristischen Personen, die der aufsichtsrechtlichen Konsolidierung gemäß Teil 1 Titel II Kapitel 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegt; b) eine Gruppe im Sinne von Artikel 212 Absatz 1 Buchstabe c der Richtlinie 2009/138/EG ([1]).	
STSSY24	Artikel 26b Absatz 4	Keine weitere Absicherung der Risikoposition des Originators	√			Bestätigung, dass der Originator seine Risikoposition gegenüber dem Kreditrisiko der der Verbriefung zugrunde liegenden Risikopositionen nicht über die durch die Besicherungsvereinbarung erzielte Absicherung hinaus absichert.	Entfällt
STSSY25	Artikel 26b Absatz 5	Besicherungsvereinbarung erfüllt Artikel 249 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	√			Bestätigung, dass die Besicherungsvereinbarung die in Artikel 249 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegten Vorgaben zur Kreditrisikominderung erfüllt.	Entfällt
STSSY26	Artikel 26b Absatz 5	Besicherungsvereinbarung, die andere Vorschriften zur Kreditrisikominderung erfüllt		√		Ist Artikel 249 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 nicht anwendbar: Kurze Erläuterung, dass die Erfüllung von Anforderungen gewährleistet ist, die nicht weniger streng sind als die in jenem Artikel genannten.	Entfällt
STSSY27	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe a	Zusicherungen und Gewährleistungen — Eigentumsrecht an den zugrunde liegenden Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass der Originator oder ein Unternehmen der Gruppe, zu der er gehört, über ein uneingeschränktes und gültiges Eigentumsrecht an den zugrunde liegenden Risikopositionen und den damit verbundenen Nebenrechten verfügt.	Entfällt

([1]) Richtlinie 2009/138/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2009 betreffend die Aufnahme und Ausübung der Versicherungs- und der Rückversicherungstätigkeit (ABl. L 335 vom 17.12.2009, S. 1).

STSSY28	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe b	Zusicherungen und Gewährleistungen — Originator hält das Kreditrisiko der zugrunde liegenden Risikopositionen in seiner Bilanz		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass — wenn es sich beim Originator um ein Kreditinstitut im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder um ein Versicherungsunternehmen im Sinne von Artikel 13 Nummer 1 der Richtlinie 2009/138/EG handelt — der Originator oder ein Unternehmen, das in die Beaufsichtigung auf konsolidierter Basis einbezogen ist, das Kreditrisiko der zugrunde liegenden Risikopositionen in seiner Bilanz hält.	Entfällt
STSSY29	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe c	Zusicherungen und Gewährleistungen — Risikoposition erfüllt die Anerkennungskriterien		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass jede zugrunde liegende Risikoposition zum Zeitpunkt ihrer Aufnahme in das verbriefte Portfolio die Anerkennungskriterien sowie alle Bedingungen für eine Ausgleichszahlung, mit Ausnahme des Eintritts eines Kreditereignisses im Sinne von Artikel 26e Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402, in Übereinstimmung mit der in den Verbriefungsunterlagen enthaltenen Besicherungsvereinbarung erfüllt.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY30	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe d	Zusicherungen und Gewährleistungen — rechtskräftige und durchsetzbare Verpflichtung für den Schuldner		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass die Vereinbarung nach bestem Wissen des Originators für jede zugrunde liegende Risikoposition eine rechtskräftige, gültige, verbindliche und durchsetzbare Verpflichtung des Schuldners zur Zahlung der in dieser Vereinbarung festgelegten Geldbeträge enthält.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY31	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe e	Zusicherungen und Gewährleistungen — Vergabekriterien		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen Vergabekriterien erfüllen, die nicht weniger streng sind als die vom Originator auf ähnliche, nicht verbriefte Risikopositionen angewandten Standardvergabekriterien.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY32	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe f	Zusicherungen und Gewährleistungen — keine Schuldner mit erheblicher Verletzung oder Ausfall hinsichtlich einer Verpflichtung		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass nach bestem Wissen des Originators zum Zeitpunkt der Aufnahme der zugrunde liegenden Risikoposition in das verbriefte Portfolio für keinen der Schuldner eine erhebliche Verletzung oder ein Ausfall hinsichtlich einer ihrer Verpflichtungen in Bezug auf eine zugrunde liegende Risikoposition vorliegt.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY33	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe g	Zusicherungen und Gewährleistungen — keine falschen Angaben in den Transaktionsunterlagen		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass die Unterlagen zu der Transaktion nach bestem Wissen des Originators keine falschen Angaben zu den Einzelheiten der zugrunde liegenden Risikopositionen enthalten.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY34	Artikel 26b Absatz 6 Buchstabe h	Zusicherungen und Gewährleistungen — Durchsetzbarkeit oder Einbringbarkeit der zugrunde liegenden Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung der Zusicherungen und Gewährleistungen des Originators, dass bei Abschluss der Transaktion oder bei Aufnahme einer zugrunde liegenden Risikoposition in das verbriefte Portfolio die Vereinbarung zwischen dem Schuldner und dem ursprünglichen Kreditgeber in Bezug auf diese zugrunde liegende Risikoposition nicht in einer Art und Weise geändert wurde, die die Durchsetzbarkeit oder Einbringbarkeit dieser zugrunde liegenden Risikoposition beeinträchtigt.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY35	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 1	Anerkennungskriterien, die im Hinblick auf die zugrunde liegenden Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten		√		Kurze Erläuterung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen im Voraus festgelegte, eindeutige und dokumentierte Anerkennungskriterien erfüllen, die im Hinblick auf diese Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY36	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 2	Ausnahme vom Verbot der aktiven Portfolioverwaltung		√		Für Feld STSSY35: Kurze Erläuterung, dass die Substitution von Risikopositionen, die nicht mit den Zusicherungen oder Gewährleistungen im Einklang stehen, oder, wenn die Verbriefung einen Wiederauffüllungszeitraum umfasst, die Hinzufügung von Risikopositionen, die die festgelegten Wiederauffüllungsbedingungen erfüllen, nicht als aktive Portfolioverwaltung angesehen wird.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY37	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 3	Nach dem Abschlussstichtag der Transaktion hinzugefügte Risikoposition erfüllt die Anerkennungskriterien		√		Kurze Erläuterung, dass nach dem Abschlussstichtag der Transaktion hinzugefügte Risikopositionen Anerkennungskriterien erfüllen, die mindestens so streng sind wie die bei der ursprünglichen Auswahl der zugrunde liegenden Risikopositionen angewandten Anerkennungskriterien.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY38	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 4 Buchstabe a	Vollständig zurückgezahlte Risikopositionen		√		Wenn die zugrunde liegenden Risikopositionen aus der Transaktion herausgenommen werden sollen: Kurze Erläuterung, dass sie vollständig zurückgezahlt oder auf andere Weise fällig wurden.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY39	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 4 Buchstabe b	Zugrunde liegende Risikopositionen veräußert		√		Wenn die zugrunde liegende Risikoposition aus der Transaktion herausgenommen werden soll: Kurze Erläuterung, dass sie im Rahmen des ordentlichen Geschäftsgangs des Originators veräußert wurde, sofern diese Veräußerung keine außervertragliche Kreditunterstützung im Sinne von Artikel 250 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 darstellt.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY40	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 4 Buchstabe c	Nicht kreditbedingte Änderung		√		Wenn die zugrunde liegende Risikoposition aus der Transaktion herausgenommen werden soll: Kurze Erläuterung, dass sie Gegenstand einer Änderung wie einer Refinanzierung oder Restrukturierung von Schulden ist, die nicht kreditbedingt ist und im Rahmen der gewöhnlichen Forderungsverwaltung in Bezug auf diese zugrunde liegende Risikoposition erfolgt.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY41	Artikel 26b Absatz 7 Unterabsatz 4 Buchstabe d	Anerkennungskriterien nicht erfüllt		√		Wenn die zugrunde liegende Risikoposition aus der Transaktion herausgenommen werden soll: Kurze Erläuterung, dass sie die Anerkennungskriterien zum Zeitpunkt der Aufnahme in die Transaktion nicht erfüllt hat.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY42	Artikel 26b Absatz 8 Unterabsatz 1	Homogenität der Vermögenswerte			√	Ausführliche·Erläuterung, wie die Verbriefung durch einen Pool zugrunde liegender Risikopositionen unterlegt ist, die im Hinblick auf die Vermögenswertkategorie homogen sind, unter Bezugnahme auf die Delegierte Verordnung (EU) 2019/1851 der Kommission [2].	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY43	Artikel 26b Absatz 8 Unterabsatz 1	Nur eine einzige Vermögenswertkategorie			√	Ausführliche·Erläuterung, wie der Pool zugrunde liegender Risikopositionen nur eine einzige Vermögenswertkategorie enthält.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY44	Artikel 26b Absatz 8 Unterabsatz 2	Vertraglich verbindliche und durchsetzbare Verpflichtungen		√		Kurze Erläuterung, dass die in Feld STSSY42 genannten zugrunde liegenden Risikopositionen vertraglich verbindliche und durchsetzbare Verpflichtungen mit vollem Rückgriffsrecht auf Schuldner sowie gegebenenfalls auf Garantiegeber umfassen.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

[2] Delegierte Verordnung (EU) 2019/1851 der Kommission vom 28. Mai 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Homogenität der einer Verbriefung zugrunde liegenden Risikopositionen (ABl. L 285 vom 6.11.2019, S. 1).

STSSY45	Artikel 26b Absatz 8 Unterabsatz 3	Festgelegte periodische Zahlung			√	Ausführliche·Erläuterung, wie die in Feld STSSY42 genannten zugrunde liegenden Risikopositionen mit festgelegten periodischen Zahlungsströmen, deren Ratenhöhe variieren kann, in Bezug auf Miet-, Tilgungs- oder Zinszahlungen oder mit einem anderen Recht auf Erhalt von Erträgen aus Vermögenswerten, die diese Zahlungen stützen, ausgestattet sind.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY46	Artikel 26b Absatz 8 Unterabsatz 3	Erlöse aus dem Verkauf von Vermögenwerten			√	Ausführliche·Erläuterung, ob und wie durch die in Feld STSSY42 genannten zugrunde liegenden Risikopositionen auch Erlöse aus dem Verkauf von finanzierten oder geleasten Vermögenwerten generiert werden können.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY47	Artikel 26b Absatz 8 Unterabsatz 4	Keine übertragbaren Wertpapiere			√	Ausführliche·Erläuterung, wie die zugrunde liegenden Risikopositionen keine übertragbaren Wertpapiere im Sinne von Artikel 4 Absatz 1 Nummer 44 der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates [3] umfassen, mit Ausnahme von Unternehmensanleihen, die nicht an einem Handelsplatz notiert sind.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY48	Artikel 26b Absatz 9	Keine Wiederverbriefung	√			Bestätigung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen keine Verbriefungspositionen umfassen.	Punkt 2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY49	Artikel 26b Absatz 10 Unterabsatz 1	Vergabestandards werden potenziellen Anlegern offengelegt	√			Bestätigung, dass die Vergabestandards, nach denen die zugrunde liegenden Risikopositionen originiert werden, sowie wesentliche Änderungen gegenüber früheren Vergabestandards potenziellen Anlegern unverzüglich in vollem Umfang offengelegt werden.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

[3] Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).

STSSY50	Artikel 26b Absatz 10 Unterabsatz 1	Volles Rückgriffsrecht auf einen Schuldner	√			Bestätigung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen mit vollem Rückgriffsrecht auf einen Schuldner, bei dem es sich nicht um eine Verbriefungszweckgesellschaft handelt, gezeichnet werden.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY51	Artikel 26b Absatz 10 Unterabsatz 1	Vergabestandards — keine Dritten	√			Bestätigung, dass an den Kredit- oder Vergabeentscheidungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen keine Dritten beteiligt sind.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY52	Artikel 26b Absatz 10 Unterabsatz 2	Vergabestandards — Darlehen für Wohnimmobilien	√			Im Falle von Verbriefungen, bei deren zugrunde liegenden Risikopositionen es sich um Darlehen für Wohnimmobilien handelt: Bestätigung, dass der Pool von Darlehen keine Darlehen enthält, die unter der Annahme vermarktet und gezeichnet wurden, dass der Darlehensantragsteller oder gegebenenfalls die Intermediäre darauf hingewiesen wurde(n), dass die vorliegenden Informationen vom Darlehensgeber möglicherweise nicht geprüft werden.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY53	Artikel 26b Absatz 10 Unterabsatz 3	Vergabestandards — Kreditwürdigkeitsprüfung	√			Bestätigung, dass bei der Prüfung der Kreditwürdigkeit des Kredit- bzw. Darlehensnehmers die Anforderungen des Artikels 8 der Richtlinie 2008/48/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ([4]) oder des Artikels 18 Absätze 1 bis 4, des Artikels 18 Absatz 5 Buchstabe a und des Artikels 18 Absatz 6 der Richtlinie 2014/17/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ([5]) oder gegebenenfalls entsprechende Anforderungen in Drittländern erfüllt sind.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY54	Artikel 26b Absatz 10 Unterabsatz 4	Erfahrung des Originators oder des ursprünglichen Kreditgebers	√			Bestätigung, dass der Originator oder ursprüngliche Kreditgeber über Erfahrung mit der Originierung von Risikopositionen verfügt, die den verbrieften Risikopositionen ähneln.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

([4]) Richtlinie 2008/48/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. April 2008 über Verbraucherkreditverträge und zur Aufhebung der Richtlinie 87/102/EWG des Rates (ABl. L 133 vom 22.5.2008, S. 66).

([5]) Richtlinie 2014/17/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Februar 2014 über Wohnimmobilienkreditverträge für Verbraucher und zur Änderung der Richtlinien 2008/48/EG und 2013/36/EU und der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 (ABl. L 60 vom 28.2.2014, S. 34).

STSSY55	Artikel 26b Absatz 11 Buchstabe a	Keine ausgefallenen Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen zum Zeitpunkt der Auswahl weder ausgefallene Risikopositionen im Sinne von Artikel 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 umfassen noch Risikopositionen gegenüber Schuldnern oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Auswahl der zugrunde liegenden Risikopositionen ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Auswahl der zugrunde liegenden Risikopositionen stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, oder ii) in den vom Originator nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i der Verordnung (EU) 2017/2402 übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung und ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind. Falls eine dieser beiden Ausnahmen vorliegt: Kurze Erläuterung.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY56	Artikel 26b Absatz 11 Buchstabe b	Keine negative Bonitätsgeschichte		√		Kurze Erläuterung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen zum Zeitpunkt der Auswahl weder ausgefallene Risikopositionen im Sinne von Artikel 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 umfassen noch Risikopositionen gegenüber Schuldnern oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers zum Zeitpunkt der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren.	Entfällt
STSSY57	Artikel 26b Absatz 11 Buchstabe c	Risiko, dass Zahlungen nicht geleistet werden, nicht höher als bei nicht verbrieften Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen zum Zeitpunkt der Auswahl weder ausgefallene Risikopositionen im Sinne von Artikel 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 umfassen noch Risikopositionen gegenüber Schuldnern oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktebewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.	Entfällt
STSSY58	Artikel 26b Absatz 12	Zum Zeitpunkt der Aufnahme der zugrunde liegenden Risikopositionen mindestens eine Zahlung geleistet	√			Bestätigung, dass die Schuldner zum Zeitpunkt der Aufnahme der zugrunde liegenden Risikopositionen mindestens eine Zahlung geleistet haben, außer wenn a) es sich bei der Verbriefung um eine revolvierende Verbriefung handelt, die durch Risikopositionen unterlegt ist, die in einer einzigen Rate zu zahlen sind oder eine Laufzeit von weniger als einem Jahr haben, darunter auch, ohne Einschränkungen, monatliche Zahlungen für revolvierende Kredite; oder	Punkte 3.3 und 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

						b) die Risikoposition die Refinanzierung einer Risikoposition darstellt, die bereits in der Transaktion enthalten ist. Falls eine dieser beiden Ausnahmen vorliegt: Kurze Erläuterung.	
STSSY59	Artikel 26c Absatz 1	Erfüllung der Anforderung in Bezug auf den Risikoselbstbehalt			√	Ausführliche Erläuterung, wie der Originator oder der ursprüngliche Kreditgeber die Anforderungen in Bezug auf den Risikoselbstbehalt im Sinne von Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt.	Punkt 3.1 von Anhang 9 und Punkt 3.4.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY60	Artikel 26c Absatz 2 Unterabsatz 1	Minderung von Zins- und Währungsrisiken	√			Bestätigung, dass a) die Zins- und Währungsrisiken, die sich aus einer Verbriefung ergeben, und ihre möglichen Auswirkungen auf die Zahlungen an den Originator und die Anleger in den Unterlagen zu der Transaktion beschrieben werden, b) diese Risiken in angemessener Weise gemindert und alle diesbezüglich ergriffenen Maßnahmen offengelegt werden.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY61	Artikel 26c Absatz 2 Unterabsatz 1	Sicherheiten im Rahmen von Besicherungsvereinbarung und Ausgleichszahlung lauten auf dieselbe Währung	√			Bestätigung, dass etwaige Sicherheiten zur Besicherung der Verpflichtungen des Anlegers gemäß der Besicherungsvereinbarung auf dieselbe Währung lauten wie die Ausgleichszahlung.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY62	Artikel 26c Absatz 2 Unterabsatz 2	Verbindlichkeiten der Verbriefungszweckgesellschaft gleich hoch oder niedriger als Einnahmen der Verbriefungszweckgesellschaft		√		Kurze Erläuterung, dass im Falle einer Verbriefung unter Nutzung einer Verbriefungszweckgesellschaft der Betrag der Verbindlichkeiten der Verbriefungszweckgesellschaft im Zusammenhang mit den Zinszahlungen an die Anleger zu jedem Zahlungstermin gleich hoch oder niedriger ist als der Betrag der Einnahmen der Verbriefungszweckgesellschaft, die vom Originator und aus etwaigen Sicherheitenvereinbarungen stammen.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY63	Artikel 26c Absatz 2 Unterabsatz 3	Keine Derivate, außer zur Absicherung von Zins- oder Währungsrisiken	√			Bestätigung, dass der Pool der zugrunde liegenden Risikopositionen keine Derivate umfasst, sofern diese nicht zur Absicherung von Zins- oder Währungsrisiken der zugrunde liegenden Risikopositionen dienen.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY64	Artikel 26c Absatz 2 Unterabsatz 3	Verwendung von Derivaten auf der Grundlage gemeinsamer Standards		√		Kurze Erläuterung, dass im Falle der in Feld STSSY63 genannten Ausnahme jedes verwendete Derivat auf der Grundlage allgemein akzeptierter Standards gezeichnet und dokumentiert wird.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY65	Artikel 26c Absatz 3 Unterabsätze 1 und 2	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen und sind nicht an komplexe Formeln gebunden		√		Wenn Zinszahlungen im Zusammenhang mit der Transaktion an einen Referenzwert gebunden sind: Kurze Erläuterung, worauf die an einen Referenzwert gebundenen Zinszahlungen basieren: a) auf marktüblichen Zinssätzen oder den die Refinanzierungskosten widerspiegelnden üblichen sektoralen Sätzen, und dass sie nicht an komplexe Formeln oder Derivate gebunden sind; oder b) auf von Sicherheiten zur Besicherung der Verpflichtungen des Anlegers gemäß der Besicherungsvereinbarung generierten Erträgen.	Punkte 2.2.2 und 2.2.13 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

						Kurze Erläuterung, dass alle an einen Referenzwert gebundenen Zinszahlungen, die in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen fällig werden, auf marktüblichen Zinssätzen oder auf den üblichen sektoralen Sätzen, die die Refinanzierungskosten widerspiegeln, basieren und nicht an komplexe Formeln oder Derivate gebunden sind.	
STSSY66	Artikel 26c Absatz 4 Unterabsatz 1	Durchsetzungsmaßnahmen des Anlegers im Verwertungs- bzw. Beendigungsfall		√		Kurze Erläuterung, dass es dem Anleger nach Eintritt eines Verwertungs- bzw. Beendigungsfalls in Bezug auf den Originator gestattet ist, Durchsetzungsmaßnahmen zu ergreifen.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY67	Artikel 26c Absatz 4 Unterabsatz 2	Durchsetzung der Besicherungsvereinbarung — keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen in der Verbriefungszweckgesellschaft		√		Kurze Erläuterung, dass — falls bei einer Verbriefung unter Nutzung einer Verbriefungszweckgesellschaft ein Beitreibungsbescheid oder eine Kündigung der Besicherungsvereinbarung zugestellt wird — in der Verbriefungszweckgesellschaft keine Geldbeträge zurückbehalten werden, die das übersteigen, was notwendig ist, um den operativen Fortbestand dieser Verbriefungszweckgesellschaft, die Leistung der Ausgleichszahlungen für ausgefallene zugrunde liegende Risikopositionen, die zum Zeitpunkt der Kündigung noch verwertet werden, oder die ordnungsgemäße Rückzahlung an die Anleger gemäß den Vertragsbedingungen der Verbriefung sicherzustellen.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY68	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 1	Zuweisung der Verluste in der Reihenfolge der Seniorität		√		Kurze Erläuterung, dass die Verluste den Inhabern einer Verbriefungsposition, beginnend mit der nachrangigsten Tranche, in der Reihenfolge der Seniorität der Tranchen zugewiesen werden.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY69	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 2	Sequenzielle Amortisierung		√		Kurze Erläuterung, dass im Rahmen einer sequentiellen Amortisierung aller Tranchen beginnend mit der vorrangigsten Tranche zu jedem Zahlungstermin der ausstehende Betrag der Tranchen bestimmt wird.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY70	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 3	Nichtsequentielle Zahlungsrangfolge		√		Abweichend von Feld STSSY69 kurze Erläuterung, dass Transaktionen mit nichtsequentieller Zahlungsrangfolge auslösende Ereignisse umfassen, die sich auf die Wertentwicklung der zugrunde liegenden Risikopositionen beziehen, die dann zu einer Zahlungsrangfolge führen, bei der eine Rückkehr zu sequentiellen Zahlungen in der Reihenfolge ihrer Seniorität erfolgt.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY71	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 3 Buchstabe a	Wertentwicklungsbezogene auslösende Ereignisse			√	Ausführliche Erläuterung des vorgeschriebenen, in Feld STSSY70 genannten wertentwicklungsbezogenen auslösenden Ereignisses, bei dem es sich entweder um die Erhöhung des kumulierten Betrags der ausgefallenen Risikopositionen handelt oder um die Erhöhung der kumulierten Verluste, die einen bestimmten Prozentsatz des ausstehenden Betrages des zugrunde liegenden Portfolios übersteigt.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY72	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 3 Buchstabe b	Wertentwicklungsbezogene auslösende Ereignisse			√	Ausführliche Erläuterung des in Feld STSSY70 genannten zusätzlichen rückwärts gerichteten auslösenden Ereignisses.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY73	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 3 Buchstabe c	Wertentwicklungsbezogene auslösende Ereignisse			√	Ausführliche Erläuterung des in Feld STSSY70 genannten vorwärts gerichteten auslösenden Ereignisses.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY74	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 7	Sicherheiten in der Höhe des Amortisierungsbetrags		√		Kurze Erläuterung, dass im Zuge der Amortisierung der Tranchen Sicherheiten in der Höhe des Amortisierungsbetrags dieser Tranchen an die Anleger zurückgegeben werden, sofern die Anleger diese Tranchen besichert haben.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY75	Artikel 26c Absatz 5 Unterabsatz 8	Eingetretenes Kreditereignis und zu einem beliebigen Zahlungstermin verbleibender Betrag der Besicherung		√		Kurze Erläuterung, dass — für den Fall, dass ein in den Feldern STSSY100 oder STSSY101 genanntes Kreditereignis in Bezug auf zugrunde liegende Risikopositionen eingetreten und die Forderungsverwertung für diese Risikopositionen noch nicht abgeschlossen ist — der zu einem beliebigen Zahlungstermin verbleibende Betrag der Besicherung mindestens dem ausstehenden Nominalbetrag dieser zugrunde liegenden Risikopositionen abzüglich des Betrags etwaiger vorläufiger Zahlungen entspricht, die in Bezug auf diese zugrunde liegenden Risikopositionen geleistet wurden.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY76	Artikel 26c Absatz 6 Buchstabe a	Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösende Ereignisse — Kreditqualität		√		Handelt es sich bei einer Verbriefung um eine revolvierende Verbriefung: Kurze Erläuterung, dass die Unterlagen zu der Transaktion geeignete Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösende Ereignisse für die Beendigung der revolvierenden Periode für den Fall einer Verschlechterung der Kreditqualität der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. unter einen im Voraus festgelegten Schwellenwert umfassen.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY77	Artikel 26c Absatz 6 Buchstabe b	Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösende Ereignisse — Verluste		√		Handelt es sich bei einer Verbriefung um eine revolvierende Verbriefung: Kurze Erläuterung, dass die Unterlagen zu der Transaktion geeignete Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösende Ereignisse für die Beendigung der revolvierenden Periode für den Fall eines Anstiegs der Verluste über einen im Voraus festgelegten Schwellenwert umfassen.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY78	Artikel 26c Absatz 6 Buchstabe c	Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösende Ereignisse — Neue Risikopositionen		√		Handelt es sich bei einer Verbriefung um eine revolvierende Verbriefung: Kurze Erläuterung, dass die Unterlagen zu der Transaktion geeignete Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösende Ereignisse für die Beendigung der revolvierenden Periode für den Fall einer nicht hinreichenden Generierung neuer zugrunde liegender Risikopositionen, die über die im Voraus festgelegte Kreditqualität verfügen, während eines bestimmten Zeitraums umfassen.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY79	Artikel 26c Absatz 7 Buchstabe a	Vertragliche Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten — Forderungsverwalter		√		Kurze Erläuterung, dass die vertraglichen Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten des Forderungsverwalters in den Unterlagen zu der Transaktion eindeutig festgelegt sind.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY80	Artikel 26c Absatz 7 Buchstabe a	Vertragliche Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten — Treuhänder		√		Kurze Erläuterung, dass die vertraglichen Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten des Treuhänders und anderer Anbieter von Nebenleistungen, soweit anwendbar, in den Unterlagen zu der Transaktion eindeutig festgelegt sind.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY81	Artikel 26c Absatz 7 Buchstabe a	Vertragliche Pflichten, Pflichten und Verantwortlichkeiten — Drittpartei-Verifizierer		√		Kurze Erläuterung, dass die vertraglichen Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten des in Feld STSSY126 genannten Drittpartei-Verifizierers in den Unterlagen zu der Transaktion eindeutig festgelegt sind.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY82	Artikel 26c Absatz 7 Buchstabe b	Ersatz von Dienstleistern bei Ausfall oder Insolvenz		√		Kurze Erläuterung, dass in den Unterlagen zu der Transaktion eindeutig Bestimmungen festgelegt sind, die den Ersatz von Forderungsverwalter, Treuhänder, anderen Anbietern von Nebenleistungen oder gegebenenfalls des in Feld STSSY126 genannten Drittpartei-Verifizierers vorsehen, damit ein Ausfall oder eine Insolvenz eines dieser Dienstleister nicht zur Beendigung der Erbringung dieser Dienstleistungen führt, sofern es sich bei diesen Dienstleistern nicht um den Originator handelt.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY83	Artikel 26c Absatz 7 Buchstabe c	Verfahren für die Forderungsverwaltung		√		Kurze Erläuterung, dass die für die zugrunde liegenden Risikopositionen zum Abschlussstichtag der Transaktion und danach geltenden Verfahren für die Forderungsverwaltung und die Umstände, unter denen diese Verfahren geändert werden können, in den Unterlagen zu der Transaktion eindeutig festgelegt sind.	Punkt 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980

STSSY84	Artikel 26c Absatz 7 Buchstabe d	Forderungsverwaltungsstandards		√		Kurze Erläuterung, dass die Forderungsverwaltungsstandards, die der Forderungsverwalter bei der Verwaltung der zugrunde liegenden Risikopositionen während der gesamten Laufzeit der Verbriefung einhalten muss, in den Unterlagen zu der Transaktion eindeutig festgelegt sind.	Punkt 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY85	Artikel 26c Absatz 8 Unterabsatz 1	Erforderliche Erfahrung des Forderungsverwalters		√		Kurze Erläuterung, dass der Forderungsverwalter über Erfahrung mit der Verwaltung von Risikopositionen verfügt, die den verbrieften Risikopositionen ähneln.	Punkt 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY86	Artikel 26c Absatz 8 Unterabsatz 1	Gut dokumentierte und angemessene Strategien, Verfahren und Kontrollen	√			Bestätigung, dass der Forderungsverwalter über gut dokumentierte und angemessene Strategien, Verfahren und Kontrollen des Risikomanagements für die Verwaltung von Risikopositionen verfügt.	Punkt 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY87	Artikel 26c Absatz 8 Unterabsatz 2	Mindestens ebenso strenge Verfahren für die Forderungsverwaltung wie für ähnliche, nicht verbriefte Risikopositionen	√			Kurze Erläuterung, dass der Forderungsverwalter auf die zugrunde liegenden Risikopositionen Verfahren für die Forderungsverwaltung anwendet, die mindestens ebenso streng sind wie diejenigen, die der Originator auf ähnliche, nicht verbriefte Risikopositionen anwendet.	Punkt 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY88	Artikel 26c Absatz 9	Referenzregister			√	Ausführliche·Erläuterung, wie der Originator ein stets auf dem neuesten Stand zu haltendes Referenzregister führt, damit die zugrunde liegenden Risikopositionen jederzeit identifiziert sind.	Entfällt
STSSY89	Artikel 26c Absatz 9	Referenzregister — Inhalt		√		Kurze Erläuterung, dass in dem in Feld STSSY88 genannten Referenzregister die Referenzschuldner, die Referenzverbindlichkeiten, die die zugrunde liegenden Risikopositionen begründen, und für jede zugrunde liegende Risikoposition der abgesicherte und ausstehende Nominalbetrag angegeben sind.	Entfällt

STSSY90	Artikel 26c Absatz 10	Zeitnahe Lösung von Konflikten zwischen den verschiedenen Kategorien von Anlegern	√			Bestätigung, dass die Unterlagen zu der Transaktion eindeutige Bestimmungen enthalten, die eine zeitnahe Lösung von Konflikten zwischen den verschiedenen Kategorien von Anlegern ermöglichen.	Punkte 3.4.7 und 3.4.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY91	Artikel 26c Absatz 10	Verbriefungszweckgesellschaft — Stimmrechte klar definiert	√			Bestätigung, dass im Falle einer Verbriefung unter Nutzung einer Verbriefungszweckgesellschaft die Stimmrechte klar definiert und Inhabern von Schuldverschreibungen zugeordnet und die Zuständigkeiten des Treuhänders und anderer Stellen mit treuhänderischen Pflichten gegenüber den Anlegern eindeutig dargelegt werden.	Entfällt
STSSY92	Artikel 26d Absatz 1	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste	√			Bestätigung, dass potenziellen Anlegern vor der Bepreisung Daten über die historische statische und dynamische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste wie beispielsweise Daten zu Zahlungsverzügen und Ausfällen (über einen Zeitraum von mindestens fünf Jahren) für Risikopositionen, die den verbrieften Risikopositionen im Wesentlichen ähneln, und die jeweiligen Datenquelle und die Grundlage für die Geltendmachung der Ähnlichkeit zwischen den Risikopositionen zugänglich gemacht werden.	Punkt 2.2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980
STSSY93	Artikel 26d Absatz 2	Externe Überprüfung einer Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen	√			Bestätigung, dass vor dem Abschluss der Transaktion eine Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen einer externen Überprüfung durch eine geeignete und unabhängige Stelle unterzogen wird, wobei unter anderem überprüft wird, ob die zugrunde liegenden Risikopositionen für eine Besicherung im Rahmen der Besicherungsvereinbarung infrage kommen.	Entfällt
STSSY94	Artikel 26d Absatz 3	Liability-Cashflow-Modell für potenzielle Anleger	√			Bestätigung, dass der Originator potenziellen Anlegern vor der Bepreisung der Verbriefung ein Liability-Cashflow-Modell zur Verfügung stellt, das genau das vertragliche Verhältnis zwischen den zugrunde liegenden Risikopositionen und den Zahlungen abbildet, die zwischen dem Originator,	Entfällt

						den Anlegern, sonstigen Dritten und gegebenenfalls der Verbriefungszweckgesellschaft getätigt werden, und dass dieses Modell nach der Bepreisung den Anlegern fortlaufend und den potenziellen Anlegern auf Verlangen zur Verfügung gestellt wird.	
STSSY95	Artikel 26d Absatz 4 Unterabsatz 1	Veröffentlichung der Umweltbilanz von zugrunde liegenden Risikopositionen, bei denen es sich um Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder Kfz-Leasinggeschäfte handelt		√		Im Falle einer Verbriefung, bei deren zugrunde liegenden Risikopositionen es sich um Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder Kfz-Leasinggeschäfte handelt, und außer im Falle der in Feld STSSY96 genannten Ausnahme: Kurze Erläuterung, dass der Originator die vorhandenen Informationen über die Umweltbilanz der durch diese Darlehen finanzierten Vermögenswerte im Rahmen der nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 offengelegten Informationen veröffentlicht.	Entfällt
STSSY96	Artikel 26d Absatz 4 Unterabsatz 2	Abweichung von der vorgeschriebenen Veröffentlichung der Umweltbilanz von zugrunde liegenden Risikopositionen, bei denen es sich um Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder Kfz-Leasinggeschäfte handelt		√		Falls der Originator beschließt, von der Anforderung in Feld STSSY95 abzuweichen: Kurze Erläuterung, dass der Originator die verfügbaren Informationen über die wichtigsten nachteiligen Auswirkungen der durch die zugrunde liegenden Risikopositionen finanzierten Vermögenswerte auf die Nachhaltigkeitsfaktoren veröffentlicht.	Entfällt
STSSY97	Artikel 26d Absatz 5	Verantwortlichkeit des Originators für die Einhaltung von Artikel 7 der Verordnung (EU) 2017/2402	√			Bestätigung, dass der Originator für die Einhaltung der Bestimmungen des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 verantwortlich ist.	Entfällt
STSSY98	Artikel 26d Absatz 5	Informationen hinsichtlich Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 werden den potenziellen Anlegern zur Verfügung gestellt	√			Bestätigung, dass die nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 erforderlichen Informationen den potenziellen Anlegern auf Verlangen vor der Bepreisung zur Verfügung gestellt werden.	Entfällt

STSSY99	Artikel 26d Absatz 5	Informationen hinsichtlich Artikel 7 Absatz 1 Buchstaben b, c und d der Verordnung (EU) 2017/2402 werden den potenziellen Anlegern zumindest im Entwurf oder in vorläufiger Form zur Verfügung gestellt	√			Bestätigung, dass die nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstaben b, c und d der Verordnung (EU) 2017/2402 erforderlichen Informationen vor der Bepreisung zumindest im Entwurf oder in vorläufiger Form zur Verfügung gestellt werden und dass die endgültigen Unterlagen den Anlegern spätestens 15 Tage nach Abschluss der Transaktion zur Verfügung gestellt werden.	Entfällt
STSSY100	Artikel 26e Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a	Kreditereignisse und Verwendung von Garantien		√		wenn die Risikoübertragung durch die Verwendung von Garantien erreicht wird: Kurze Erläuterung, dass die Besicherungsvereinbarung mindestens die in Artikel 215 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Kreditereignisse abdeckt.	Entfällt
STSSY101	Artikel 26e Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe b	Kreditereignisse und Verwendung von Kreditderivaten		√		Wenn die Risikoübertragung durch die Verwendung von Kreditderivaten erreicht wird: Kurze Erläuterung, dass die Besicherungsvereinbarung mindestens die in Artikel 216 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Kreditereignisse abdeckt.	Entfällt
STSSY102	Artikel 26e Absatz 1 Unterabsatz 2	Besicherungsvereinbarung dokumentiert		√		Kurze Erläuterung, dass alle Kreditereignisse dokumentiert werden.	Entfällt
STSSY103	Artikel 26e Absatz 1 Unterabsatz 3	Stundungsmaßnahmen schließen Auslösung eines zulässigen Kreditereignisses nicht aus		√		Kurze Erläuterung, dass auf die zugrunde liegenden Risikopositionen angewandte Stundungsmaßnahmen im Sinne von Artikel 47b der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 die Auslösung eines zulässigen Kreditereignisses nicht ausschließen.	Entfällt

STSSY104	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 1	Ausgleichszahlung nach Eintritt von Kreditereignis auf Grundlage des tatsächlich realisierten Verlusts und nach Standardregeln und -verfahren		√		Kurze Erläuterung, dass die Ausgleichszahlung nach Eintritt eines Kreditereignisses auf der Grundlage des tatsächlich realisierten Verlusts des Originators oder des ursprünglichen Kreditgebers berechnet wird, der im Einklang mit ihren Standardregeln und -verfahren für die betreffenden Arten von Risikopositionen verwertet und zum Zeitpunkt der Leistung der Zahlung in ihren Abschlüssen erfasst wurde.	Entfällt
STSSY105	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 1	Ausgleichszahlung innerhalb eines bestimmten Zeitraums		√		Kurze Erläuterung, dass die endgültige Ausgleichszahlung innerhalb eines bestimmten Zeitraums nach der Forderungsverwertung für die betreffende zugrunde liegende Risikoposition zu leisten ist, wenn die Forderungsverwertung vor der planmäßigen rechtlichen Fälligkeit oder vor der vorzeitigen Beendigung der Besicherungsvereinbarung abgeschlossen wurde.	Entfällt
STSSY106	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 1	Vorläufige Ausgleichszahlung spätestens sechs Monate nach Eintritt eines Kreditereignisses		√		Falls die Forderungsverwertung aus den Verlusten für die betreffende zugrunde liegende Risikoposition nicht bis zum Ablauf des in Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Sechsmonatszeitraums abgeschlossen wurde: Kurze Erläuterung, dass spätestens sechs Monate nach Eintritt eines in den Feldern STSSY100 und STSSY101 genannten Kreditereignisses eine vorläufige Ausgleichszahlung geleistet wird.	Entfällt
STSSY107	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 2 Buchstaben a und b	Vorläufige Ausgleichszahlung höher als der betreffende erwartete Verlustbetrag		√		Kurze Erläuterung, dass die vorläufige Ausgleichszahlung mindestens dem höheren der folgenden Beträge entspricht:	Entfällt

						a) dem erwarteten Verlustbetrag, der der Wertminderung entspricht, die vom Originator gemäß dem geltenden Rechnungslegungsrahmen zum Zeitpunkt der vorläufigen Zahlung in seinem Abschluss erfasst wurde, wobei davon ausgegangen wird, dass die Besicherungsvereinbarung nicht existiert und keine Verluste deckt; oder b) gegebenenfalls dem erwarteten Verlustbetrag, der gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 zu bestimmen ist.	
STSSY108	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 3	Bedingungen der vorläufigen Ausgleichszahlung		√		Wenn eine vorläufige Ausgleichszahlung geleistet wird: Kurze Erläuterung, dass die in Feld STSSY106 genannte endgültige Ausgleichszahlung erfolgt, um die vorläufige Abrechnung von Verlusten an den tatsächlich realisierten Verlust anzupassen.	Entfällt
STSSY109	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 4	Methode zur Berechnung der vorläufigen und endgültigen Ausgleichzahlungen		√		Kurze Erläuterung, dass die Methode zur Berechnung der vorläufigen und endgültigen Ausgleichszahlungen in der Besicherungsvereinbarung festgelegt ist.	Entfällt
STSSY110	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 5	Höhe der Ausgleichszahlung proportional zum Anteil des ausstehenden Nominalbetrags		√		Kurze Erläuterung, dass die Höhe der Ausgleichszahlung proportional ist zum Anteil des ausstehenden Nominalbetrags an der entsprechenden zugrunde liegenden Risikoposition, die durch die Besicherungsvereinbarung abgedeckt ist.	Entfällt

STSSY111	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 6	Durchsetzbarkeit der Ausgleichszahlung		√		Kurze Erläuterung, dass das Recht des Originators auf Erhalt der Ausgleichszahlung durchsetzbar ist.	Entfällt
STSSY112	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 6	Im Rahmen der Besicherungsvereinbarung von den Anlegern zu zahlender Betrag in der Besicherungsvereinbarung festgelegt		√		Kurze Erläuterung, dass die von den Anlegern im Rahmen der Besicherungsvereinbarung zu zahlenden Beträge in der Besicherungsvereinbarung klar festgelegt und begrenzt sind.	Entfällt
STSSY113	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 6	Berechnung der Beträge unter allen Umständen		√		Kurze Erläuterung, dass die Berechnung der von den Anlegern im Rahmen der Besicherungsvereinbarung zu zahlenden Beträge unter allen Umständen möglich ist.	Entfällt
STSSY114	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 6	Umstände, unter denen Anleger Zahlungen zu leisten haben, in der Besicherungsvereinbarung festgelegt		√		Kurze Erläuterung, dass in der Besicherungsvereinbarung klar festgelegt ist, unter welchen Umständen die Anleger Zahlungen zu leisten haben.	Entfällt
STSSY115	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 6	Eintritt der Umstände für Zahlungen durch die Anleger durch Drittpartei-Verifizierer bewertet		√		Kurze Erläuterung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei Verifizierer bewertet, ob die in der Besicherungsvereinbarung festgelegten Umstände, unter denen die Anleger Zahlungen zu leisten haben, eingetreten sind.	Entfällt
STSSY116	Artikel 26e Absatz 2 Unterabsatz 7	Ausgleichszahlung auf der Ebene der einzelnen zugrunde liegenden Risikoposition berechnet		√		Kurze Erläuterung, dass der Betrag der Ausgleichszahlung auf der Ebene der einzelnen zugrunde liegenden Risikoposition berechnet wird, in Bezug auf die ein Kreditereignis eingetreten ist.	Entfällt

STSSY117	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 1	Festlegung des maximalen Verlängerungszeitraums für die Forderungsverwertung		√		Kurze Erläuterung, dass in der Besicherungsvereinbarung der maximale Verlängerungszeitraum festgelegt wird, der für die Forderungsverwertung für die zugrunde liegenden Risikopositionen gilt, in Bezug auf die ein Kreditereignis im Sinne von Artikel 26e Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 eingetreten ist, und die Forderungsverwertung zum Zeitpunkt der planmäßigen rechtlichen Fälligkeit oder der vorzeitigen Beendigung der Besicherungsvereinbarung noch nicht abgeschlossen ist.	Entfällt
STSSY118	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 1	Verlängerungszeitraum weniger als zwei Jahre		√		Kurze Erläuterung, dass der in Feld STSSY117 genannte Verlängerungszeitraum zwei Jahre nicht überschreitet.	Entfällt
STSSY119	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 1	Endgültige Ausgleichszahlung auf der Grundlage der endgültigen Abschätzung des Verlusts des Originators		√		Kurze Erläuterung, dass in der Besicherungsvereinbarung vorgesehen ist, dass auf der Grundlage der endgültigen Abschätzung des Verlusts, die der Originator zu diesem Zeitpunkt in seinem Abschluss erfassen müsste, bis zum Ende des in Feld STSSY117 genannten Verlängerungszeitraums eine endgültige Ausgleichszahlung geleistet wird, wobei davon ausgegangen wird, dass die Besicherungsvereinbarung nicht existiert und keine Verluste deckt.	Entfällt
STSSY120	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 2	Beendigung der Besicherungsvereinbarung		√		Für den Fall einer Beendigung der Besicherungsvereinbarung: Kurze Erläuterung, dass die Forderungsverwertung in Bezug auf alle ausstehenden Kreditereignisse, die vor dieser Beendigung eingetreten sind, wie in Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 beschrieben, fortgesetzt wird.	Entfällt

STSSY121	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 3	Besicherungsprämien vom ausstehenden Nominalbetrag abhängig		√		Kurze Erläuterung, dass die im Rahmen der Besicherungsvereinbarung zu zahlenden Besicherungsprämien so strukturiert sind, dass sie vom zum Zeitpunkt der Zahlung ausstehenden Nominalbetrag der nicht notleidenden verbrieften Risikopositionen abhängen und das Risiko der besicherten Tranche widerspiegeln.	Entfällt
STSSY122	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 3	In der Besicherungsvereinbarung keine Mechanismen, die die tatsächliche Zuweisung von Verlusten an die Anleger vermeiden oder verringern können		√		Kurze Erläuterung, dass in der Besicherungsvereinbarung für die Zwecke von Feld STSSY117 keine garantierten Prämien, Prämienvorauszahlungen, Nachlass- oder anderen Mechanismen vorgesehen sind, die die tatsächliche Zuweisung von Verlusten an die Anleger vermeiden oder verringern oder zur Erstattung eines Teils der gezahlten Prämien nach der Fälligkeit der Transaktion an den Originator führen können.	Entfällt
STSSY123	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 4	Ausnahme für Prämienvorauszahlungen		√		Abweichend von den Feldern STSSY121 und STSSY122 für den Fall, dass das Garantiesystem im nationalen Recht eines Mitgliedstaats ausdrücklich vorgesehen ist und von einer der in Artikel 214 Absatz 2 Buchstaben a bis d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufgeführten Einrichtungen eine Rückbürgschaft gestellt wird: Kurze Erläuterung, dass Prämienvorauszahlungen unter der Voraussetzung, dass die Vorschriften über staatliche Beihilfen eingehalten werden, zulässig sind.	Entfällt
STSSY124	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 5	Beschreibung der Besicherungsprämie in den Transaktionsunterlagen		√		Kurze Erläuterung, dass in den Unterlagen zu der Transaktion erläutert wird, wie die Besicherungsprämie und etwaige Kupons für jeden Zahlungstermin während der gesamten Laufzeit der Verbriefung berechnet werden.	Entfällt

STSSY125	Artikel 26e Absatz 3 Unterabsatz 6	Durchsetzbarkeit der Anlegerrechte		√		Kurze Erläuterung, dass die Rechte der Anleger auf Besicherungsprämien durchsetzbar sind.	Entfällt
STSSY126	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1	Bestellung von Drittpartei-Verifizierer vor Abschlussstichtag der Transaktion	√			Bestätigung, dass der Originator vor dem Abschlussstichtag der Transaktion einen Drittpartei-Verifizierer bestellt.	Entfällt
STSSY127	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstabe a	Verifizierung durch Drittpartei-Verifizierer — in der Mitteilung genanntes Kreditereignis gemäß den Bestimmungen der Besicherungsvereinbarung	√			Bestätigung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer für jede zugrunde liegende Risikoposition, in Bezug auf die eine Mitteilung über ein Kreditereignis erfolgt, verifiziert, ob es sich bei dem in der Mitteilung genannten Kreditereignis um ein Kreditereignis gemäß den Bestimmungen des Besicherungsvertrags handelt.	Entfällt
STSSY128	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstabe b	Verifizierung durch Drittpartei-Verifizierer — zugrunde liegende Risikoposition im Referenzportfolio enthalten	√			Bestätigung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer für jede zugrunde liegende Risikoposition, in Bezug auf die eine Mitteilung über ein Kreditereignis erfolgt, verifiziert, dass die zugrunde liegende Risikoposition zum Zeitpunkt des Eintritts des betreffenden Kreditereignisses im Referenzportfolio enthalten war.	Entfällt
STSSY129	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstabe c	Verifizierung durch Drittpartei-Verifizierer — Anerkennungskriterien bei Aufnahme in das Referenzportfolio erfüllt	√			Bestätigung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer für jede zugrunde liegende Risikoposition, in Bezug auf die eine Mitteilung über ein Kreditereignis erfolgt, verifiziert, dass die zugrunde liegende Risikoposition zum Zeitpunkt ihrer Aufnahme in das Referenzportfolio die Anerkennungskriterien erfüllte.	Entfällt

STSSY130	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstabe d	Verifizierung durch Drittpartei-Verifizierer — Erfüllung der Bedingungen für Wiederauffüllungen	√			Bestätigung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer für jede zugrunde liegende Risikoposition, in Bezug auf die eine Mitteilung über ein Kreditereignis erfolgt, verifiziert, dass eine Wiederauffüllung die Bedingungen für Wiederauffüllungen erfüllte, wenn der Verbriefung infolge einer Wiederauffüllung eine zugrunde liegende Risikoposition hinzugefügt wurde.	Entfällt
STSSY131	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstabe e	Verifizierung durch Drittpartei-Verifizierer — Verluste stimmt mit Gewinn- und Verlustrechnung des Originators überein	√			Bestätigung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer für jede zugrunde liegende Risikoposition, in Bezug auf die eine Mitteilung über ein Kreditereignis erfolgt, verifiziert, dass der endgültige Verlustbetrag mit den vom Originator in seiner Gewinn- und Verlustrechnung verbuchten Verlusten übereinstimmt.	Entfällt
STSSY132	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstabe f	Verifizierung durch Drittpartei-Verifizierer — Verluste den Anlegern ordnungsgemäß zugewiesen	√			Bestätigung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer für jede zugrunde liegende Risikoposition, in Bezug auf die eine Mitteilung über ein Kreditereignis erfolgt, verifiziert, dass die Verluste im Zusammenhang mit den zugrunde liegenden Risikopositionen den Anlegern zum Zeitpunkt der Leistung der endgültigen Ausgleichszahlung ordnungsgemäß zugewiesen wurden.	Entfällt
STSSY133	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 2	Drittpartei-Verifizierer unabhängig von Originator, Anlegern und (gegebenenfalls) Verbriefungszweckgesellschaft		√		Kurze Erläuterung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer vom Originator und den Anlegern sowie gegebenenfalls von der Verbriefungszweckgesellschaft unabhängig ist.	Entfällt

STSSY134	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 2	Bestellung des Drittpartei-Verifizierers bis zum Abschlussstichtag		√		Kurze Erläuterung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer die Bestellung als Drittpartei-Verifizierer bis zum Abschlussstichtag der Transaktion angenommen hat.	Entfällt
STSSY135	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 3	Stichprobenartige Überprüfung durch Drittpartei-Verifizierer		√		Kurze Erläuterung, dass der in Feld STSSY126 genannte Drittpartei-Verifizierer die Überprüfung stichprobenartig und nicht auf der Grundlage jeder einzelnen zugrunde liegenden Risikoposition, für die eine Ausgleichszahlung beantragt wird, durchführt.	Entfällt
STSSY136	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 3	Möglichkeit für Anleger, die Überprüfung einer zugrunde liegenden Risikoposition durch den Drittpartei-Verifizierer zu verlangen		√		Kurze Erläuterung, ob und wie die Anleger die Überprüfung der Anerkennungsfähigkeit einer bestimmten zugrunde liegenden Risikoposition verlangen können, wenn sie mit der stichprobenartigen Überprüfung nicht zufrieden sind.	Entfällt
STSSY137	Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 4	Möglichkeit des Drittpartei-Verifizierers, auf alle relevanten Informationen zuzugreifen		√		Kurze Erläuterung, dass sich der Originator in den Unterlagen zu der Transaktion verpflichtet, dem in Feld STSSY126 genannten Drittpartei-Verifizierer alle Informationen zur Verfügung zu stellen, die für die Überprüfung der in Artikel 26e Absatz 4 Unterabsatz 1 Buchstaben a bis f der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erforderlich sind.	Entfällt
STSS138	Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 1 Buchstaben a bis f	Beendigung auslösende Ereignisse		√		Kurze Erläuterung, dass der Originator eine Transaktion nur bei einem der in Artikel 26e Absatz 5 Buchstaben a bis f der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Ereignisse vor ihrer planmäßigen Fälligkeit beenden darf.	Entfällt

STSS139	Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 2	Transaktionsunterlagen — Kündigungsrechte		√		Kurze Erläuterung, dass in den Unterlagen zu der Transaktion angegeben ist, ob eines der in Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 1 Buchstaben d und e der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Kündigungsrechte in der betreffenden Transaktion vorgesehen ist und wie diese Kündigungsrechte strukturiert sind.	Entfällt
STSS140	Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 3	Transaktionsunterlagen — zeitbasiertes Kündigungsrecht nicht im Hinblick darauf strukturiert, Zuweisung von Verlusten zu Bonitätsverbesserungspositionen zu vermeiden		√		Für die Zwecke von Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402 kurze Erläuterung, dass das zeitbasierte Kündigungsrecht nicht im Hinblick darauf strukturiert sein, die Zuweisung von Verlusten zu Bonitätsverbesserungspositionen oder anderen von den Anlegern gehaltenen Positionen zu vermeiden, und auch nicht anderweitig im Hinblick auf eine Bonitätsverbesserung strukturiert ist.	Entfällt
STSS141	Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 4	Zeitbasiertes Kündigungsrecht		√		Wenn die Transaktion ein zeitbasiertes Kündigungsrecht beinhaltet: Kurze Erläuterung, dass die in STSS139 und STSS140 genannten Anforderungen erfüllt werden, einschließlich einer Begründung für die Verwendung des zeitbasierten Kündigungsrechts und einer plausiblen Erklärung, aus der hervorgeht, dass der Grund für die Ausübung des Kündigungsrechts nicht die Verschlechterung der Qualität der zugrunde liegenden Vermögenswerte ist.	Entfällt
STSS142	Artikel 26e Absatz 5 Unterabsatz 5	Besicherung mit Sicherheitsleistung — Rückgabe der Sicherheiten an die Anleger in der Reihenfolge der Seniorität der Tranchen		√		Im Falle einer Besicherung mit Sicherheitsleistung: Kurze Erläuterung. dass die Sicherheiten bei Beendigung der Besicherungsvereinbarung, vorbehaltlich der für den Originator geltenden Bestimmungen des einschlägigen Insolvenzrechts, in der Reihenfolge der Seniorität der Tranchen an die Anleger zurückgegeben werden.	Entfällt

STSS143	Artikel 26e Absatz 6	Beendigung der Transaktion bei Nichtzahlung der Besicherungs-sprämie		√		Kurze Erläuterung, dass Anleger eine Transaktion nicht aus anderen Gründen als der Nichtzahlung der Besicherungsprämie oder einer sonstigen wesentlichen Verletzung vertraglicher Verpflichtungen durch den Originator vor ihrer planmäßigen Fälligkeit beenden dürfen.	Entfällt
STSSY144	Artikel 26e Absatz 7 Buchstabe a	Betrag des synthetischen Zinsüberschus-ses für Anleger in Transaktion-sunterlagen angegeben und als fester Prozentsatz des ausstehenden Gesamtsaldos des Portfolios ausgedrückt		√		Wenn sich der Originator zu einem synthetischen Zinsüberschuss verpflichtet, der zur Bonitätsverbesserung für Anleger zur Verfügung steht: Kurze Erläuterung, dass der Betrag des synthetischen Zinsüberschusses, zu dessen Verwendung zur Bonitätsverbesserung sich der Originator in jedem Zahlungszeitraum verpflichtet, in den Unterlagen zu der Transaktion angegeben und als fester Prozentsatz des zu Beginn des betreffenden Zahlungszeitraums ausstehenden Gesamtsaldos des Portfolios ausgedrückt wird (fester synthetischer Zinsüberschuss).	Entfällt
STSSY145	Artikel 26e Absatz 7 Buchstabe b	Nicht verwendeter synthetischer Zinsüberschuss geht an Originator zurück		√		Wenn sich der Originator zu einem synthetischen Zinsüberschuss verpflichtet, der zur Bonitätsverbesserung für Anleger zur Verfügung steht: Kurze Erläuterung, dass der synthetische Zinsüberschuss, der nicht zur Deckung von Kreditverlusten verwendet wird, die während jedes Zahlungszeitraums eintreten, an den Originator zurückgeht.	Entfällt
STSSY146	Artikel 26e Absatz 7 Buchstabe c	Originatoren, die den IRB-Ansatz verwenden — Zugesagter Gesamtbetrag pro Jahr nicht höher als einjährigen regulatorischen erwarteten Verlustbeträge		√		Wenn sich der Originator zu einem synthetischen Zinsüberschuss verpflichtet, der zur Bonitätsverbesserung für Anleger zur Verfügung steht: Kurze Erläuterung, dass bei Originatoren, die den in Artikel 143 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten IRB-Ansatz verwenden, der zugesagte Gesamtbetrag pro Jahr nicht höher ist als die einjährigen regulatorischen	Entfällt

						erwarteten Verlustbeträge aller zugrunde liegenden Risikopositionen für das betreffende Jahr, berechnet gemäß Artikel 158 jener Verordnung.	
STSSY147	Artikel 26e Absatz 7 Buchstabe d	Originatoren, die den IRB-Ansatz nicht verwenden — Berechnung des einjährigen erwarteten Verlusts des zugrunde liegenden Portfolios in den Unterlagen zu der Transaktion klar festgelegt		√		Wenn sich der Originator zu einem synthetischen Zinsüberschuss verpflichtet, der zur Bonitätsverbesserung für Anleger zur Verfügung steht: Kurze Erläuterung, dass bei Originatoren, die den in Artikel 143 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten IRB-Ansatz nicht verwenden, die Berechnung des einjährigen erwarteten Verlusts des zugrunde liegenden Portfolios in den Unterlagen zu der Transaktion klar festgelegt ist.	Entfällt
STSSY148	Artikel 26e Absatz 7 Buchstabe e	Bedingungen des synthetischen Zinsüberschusses in Transaktionsunterlagen aufgeführt		√		Wenn sich der Originator zu einem synthetischen Zinsüberschuss verpflichtet, der zur Bonitätsverbesserung für Anleger zur Verfügung steht: Kurze Erläuterung, dass die in Artikel 26e Absatz 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 festgelegten Bedingungen in den Unterlagen zu der Transaktion aufgeführt sind.	Entfällt
STSS149	Artikel 26e Absatz 8 Buchstaben a, b und c	Genutzte Besicherungsvereinbarung		√		Kurze Erläuterung, welche der folgenden Formen die Besicherungsvereinbarung annimmt: a) Garantie, die die in Teil 3 Titel II Kapitel 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegten Anforderungen erfüllt, durch die das Kreditrisiko auf eine der in Artikel 214 Absatz 2 Buchstaben a bis d der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 aufgeführten Stellen übertragen wird, sofern die Risikopositionen gegenüber dem Anleger nach Teil 3 Titel II Kapitel 2 jener Verordnung für ein Risikogewicht von 0 % in Betracht kommen;	Entfällt

						b) Garantie, die die in Teil 3 Titel II Kapitel 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 festgelegten Anforderungen erfüllt und von einer Rückbürgschaft einer der unter Buchstabe a dieses Absatzes genannten Stellen profitiert; c) sonstige nicht unter den Buchstaben a und b aufgeführte Besicherungen in Form einer Garantie, eines Kreditderivats oder synthetischer Unternehmensanleihen (‚Credit Linked Notes'), die die Anforderungen des Artikels 249 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 erfüllen, sofern die Verpflichtungen des Anlegers durch Sicherheiten gesichert sind, die die Anforderungen von Artikel 26e Absätze 9 und 10 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllen.	
STSSY150	Artikel 26e Absatz 9 Unterabsatz 1 Buchstabe a	Durchsetzbarkeit des Rechts des Originators, die Sicherheit zur Erfüllung der Verpflichtungen der Anleger zur Leistung der Ausgleichszahlung zu verwenden, durch geeignete Sicherheitenvereinbarungen			√	Im Falle einer in Artikel 26e Absatz 8 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Besicherung: Ausführliche Erläuterung, wie das Recht des Originators, die Sicherheiten zur Erfüllung der Verpflichtungen der Anleger zur Leistung der Ausgleichszahlung zu verwenden, durchsetzbar ist, und wie die Durchsetzbarkeit dieses Rechts durch geeignete Sicherheitenvereinbarungen sichergestellt ist.	Entfällt
STSSY151	Artikel 26e Absatz 9 Unterabsatz 1 Buchstabe b	Recht der Anleger auf Erhalt nicht verwendeter Sicherheiten bei Auflösung der Verbriefung oder entsprechend der Amortisierung der Tranchen		√		Im Falle einer in Artikel 26e Absatz 8 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Besicherung: Kurze Erläuterung, dass das Recht der Anleger durchsetzbar ist, bei Auflösung der Verbriefung oder entsprechend der Amortisierung der Tranchen Sicherheiten, die nicht zur Erfüllung von Ausgleichszahlungen verwendet wurden, zurückzuerhalten.	Entfällt

STSSY152	Artikel 26e Absatz 9 Unterabsatz 1 Buchstabe c	In Wertpapiere investierte Sicherheiten — Anerkennungskriterien und Verwahrungsvereinbarung in Transaktionsunterlagen festgelegt			√	Im Falle einer in Artikel 26e Absatz 8 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Besicherung: Ausführliche Erläuterung, wie im Fall, dass die Sicherheiten in Wertpapiere investiert sind, die Anerkennungskriterien und die Verwahrungsvereinbarung für diese Wertpapiere in den Unterlagen zu der Transaktion festgelegt sind.	Entfällt
STSSY153	Artikel 26e Absatz 9 Unterabsatz 2	Anleger, die dem Kreditrisiko des Originators ausgesetzt sind		√		Kurze Erläuterung, dass in den Transaktionsunterlagen angegeben ist, ob die Anleger weiterhin dem Kreditrisiko des Originators ausgesetzt sind.	Entfällt
STSSY154	Artikel 26e Absatz 9 Unterabsatz 3	Gutachten eines qualifizierten Rechtsberaters zur Bestätigung der Durchsetzbarkeit der Besicherung in allen Hoheitsgebieten	√			Bestätigung, dass der Originator ein Gutachten eines qualifizierten Rechtsberaters eingeholt hat, in dem die Durchsetzbarkeit der Besicherung in allen relevanten Hoheitsgebieten bestätigt wird.	Entfällt
STSSY155	Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 1 Buchstabe a	Hochwertige Sicherheiten — Schuldverschreibungen mit einem Risikogewicht von 0 %		√		Wenn eine Besicherung gemäß Artikel 26e Absatz 10 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 in Form von Schuldverschreibungen mit einem Risikogewicht von 0 % im Sinne von Teil 3 Titel II Kapitel 2 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gestellt wird: Kurze Erläuterung, dass alle folgenden Bedingungen erfüllt sind: i) diese Schuldverschreibungen haben eine Restlaufzeit von höchstens drei Monaten, die nicht länger ist als der verbleibende Zeitraum bis zum nächsten Zahlungstermin; ii) diese Schuldverschreibungen können in Höhe des offenen Saldos der besicherten Tranche in bar eingelöst werden;	Entfällt

						iii) diese Schuldverschreibungen werden von einem vom Originator und den Anlegern unabhängigen Verwahrer gehalten.	
STSSY156	Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 1 Buchstabe b	Hochwertige Sicherheiten — Barmitteln bei einem Drittkreditinstitut mit einer Bonitätsstufe von mindestens 3		√		Wenn eine Besicherung gemäß Artikel 26e Absatz 10 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 gestellt wird: Kurze Erläuterung, dass der Originator und der Anleger nach der Sicherheitenvereinbarung Rückgriff auf Sicherheiten in Form von Barmitteln haben, die bei einem Drittkreditinstitut mit einer Bonitätsstufe von mindestens 3 gemäß der in Artikel 136 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 dargelegten Zuordnung gehalten werden.	Entfällt
STSSY157	Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 2	Abweichung — Sicherheiten in Form einer Bareinlage beim Originator			√	Im Falle einer abweichenden Regelung nach Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402: Ausführliche·Erläuterung, dass nach der Sicherheitenvereinbarung mit Zustimmung des Anlegers nur der Originator Rückgriff auf hochwertige Sicherheiten in Form einer Bareinlage beim Originator oder einem mit ihm verbundenen Unternehmen hat.	Entfällt
STSSY158	Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 3	Sicherheiten in Form einer Bareinlage beim Originator — Genehmigung der zuständigen Behörden			√	Ausführliche·Erläuterung, dass die gemäß Artikel 29 Absatz 5 der Verordnung (EU) 2017/2402 benannten zuständigen Behörden Sicherheiten in Form einer Bareinlage beim Originator oder einem mit ihm verbundenen Unternehmen, wenn der Originator oder ein verbundenes Unternehmen eine Bonitätsstufe von 3 erfüllt, zulassen, sofern Marktschwierigkeiten, objektive Hindernisse im Zusammenhang mit der Bonitätsstufe, die dem Mitgliedstaat des Instituts zugewiesen wurde, oder erhebliche potenzielle Konzentrationsprobleme in dem betreffenden Mitgliedstaat	Entfällt

						aufgrund der Anwendung der Anforderung der Bonitätsstufe von mindestens 2 gemäß Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 dokumentiert werden können.	
STSSY159	Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 4	Übertragung der Sicherheiten, wenn das Drittkreditinstitut oder der Originator die Mindestbonitätsstufe nicht mehr erfüllt			√	Ausführliche·Erläuterung, wie die Sicherheiten gemäß Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 4 der Verordnung (EU) 2017/2402 übertragen werden, wenn die Sicherheiten in Form einer Bareinlage bei einem Institut gehalten wurde, das die Mindestbonitätsstufe nicht mehr erfüllt.	Entfällt
STSSY160	Artikel 26e Absatz 10 Unterabsatz 5	Erfüllung der Anforderungen an die Sicherheiten bei Anlagen in vom Originator ausgegebenen synthetischen Unternehmensanliehen (Credit Linked Notes)	√			Bestätigung, dass eine Anlage in synthetische Unternehmensanleihen (‚Credit Linked Notes') erfolgt, die gemäß Artikel 218 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 vom Originator ausgegeben werden.	Entfällt“