# KOMISJONI DELEGEERITUD MÄÄRUS (EL) 2022/1301,

## 31. märts 2022,

## millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2020/1226 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses teabega, mis tuleb bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste puhul esitada kooskõlas standardväärtpaberistamise teate nõuetega

EUROOPA KOMISJON,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Parlamendi ja nõukogu 12. detsembri 2017. aasta määrust (EL) 2017/2402, millega kehtestatakse väärtpaberistamise üldnormid ning luuakse lihtsa, läbipaistva ja standarditud väärtpaberistamise erinormid ning millega muudetakse direktiive 2009/65/EÜ, 2009/138/EÜ ja 2011/61/EL ning määrusi (EÜ) nr 1060/2009 ja (EL) nr 648/2012, ([1]) eriti selle artikli 27 lõike 6 kolmandat lõiku,

ning arvestades järgmist:

(1) Komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2020/1226 ([2]) on sätestatud teave, mille väärtpaberistamise tehingu osalised peavad tavapärase tegelikku müüki hõlmava väärtpaberistamise korral Euroopa Väärtpaberiturujärelevalvele (ESMA) esitama vastavalt lihtsa, läbipaistva ja standarditud väärtpaberistamise (standardväärtpaberistamise) teatega seotud nõuetele, mis on sätestatud määruse (EL) 2017/2402 artiklites 19–22 ja artiklites 23–26.

(2) Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusega (EL) 2021/557 ([3]) muudeti määrust (EL) 2017/2402, laiendades standardväärtpaberistamise raamistikku bilansilistele sünteetilistele väärtpaberistamistele. Seega on vaja täpsustada, millist teavet peavad väärtpaberistamise tehingu algatajad ESMA-le esitama, et bilansilise sünteetilise väärtpaberistamise korral täita standardväärtpaberistamise teatega seotud nõudeid.

(3) Selleks et investorid, potentsiaalsed investorid ja pädevad asutused saaksid võrdleva ülevaate iga liiki standardväärtpaberistamise tehingute kohta, on vaja tagada kõigi standardväärtpaberistamise teadete kooskõlalisus. Seepärast peaks teave, mille väärtpaberistamise tehingu algatajad peavad esitama standardväärtpaberistamise nõuete täitmise kohta vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artiklitele 26b–26e, vastama samasugustele standarditele ja üksikasjalikkuse tasemele, nagu on sätestatud delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 I, II ja III lisas. Mõne kriteeriumi puhul piisab lihtsast vastavuse kinnitamisest, samas kui teiste kriteeriumide puhul on nõutav lisateave. Seega on vaja eristada neid standardväärtpaberistamise kriteeriume, mille puhul piisab lihtsast kinnitusest, kriteeriumidest, mille puhul on vajalik lühiselgitus või üksikasjalik selgitus.

(4) Bilansilised sünteetilised väärtpaberistamised, mille puhul ei ole vaja koostada Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) 2017/1129 ([4]) kohast prospekti, võimaldavad tehinguosalistel teha väärtpaberistamise tehinguid tundlikku äriteavet avaldamata. Seepärast on asjakohane, et selliste väärtpaberistamiste puhul piirduks standardväärtpaberistamise teadetes esitav teave mittetundliku äriteabega.

([1]) ELT L 347, 28.12.2017, lk 35.

([2]) Komisjoni 12. novembri 2019. aasta delegeeritud määrus (EL) 2020/1226, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2017/2402 ja sätestatakse regulatiivsed tehnilised standardid, millega määratakse kindlaks teave, mis tuleb esitada vastavalt standardväärtpaberistamise teatega seotud nõuetele (ELT L 289, 3.9.2020, lk 285).

([3]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 31. märtsi 2021. aasta määrus (EL) 2021/557, millega muudetakse COVID-19 kriisist taastumisele kaasa aitamiseks määrust (EL) 2017/2402, millega kehtestatakse väärtpaberistamise üldnormid ning luuakse lihtsa, läbipaistva ja standarditud väärtpaberistamise erinormid (ELT L 116, 6.4.2021, lk 1).

([4]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 14. juuni 2017. aasta määrus (EL) 2017/1129, mis käsitleb väärtpaberite avalikul pakkumisel või reguleeritud turul kauplemisele võtmisel avaldatavat prospekti ning millega tunnistatakse kehtetuks direktiiv 2003/71/EÜ (ELT L 168, 30.6.2017, lk 12).

(5) Selleks et hõlbustada juurdepääsu standardväärtpaberistamise nõuetega seotud teabele, peaks väärtpaberistamise tehingu algatajatel olema lubatud viidata võimalikule asjakohasele prospektile, mis on koostatud bilansilise sünteetilise väärtpaberistamise kohta kooskõlas määrusega (EL) 2017/1129, või muudele määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punktis b osutatud asjakohastele alusdokumentidele. Lisaks peaks väärtpaberistamise tehingu algatajatel olema lubatud viidata mis tahes muule dokumendile, mis on seotud investorite ja väärtpaberistamise tehingu algatajatega, krediidiriski kaitse lepinguga, kontrolli tegeva kolmanda isikuga ja olemasolu korral krediidiriski vahetustehingut sisaldavate võlakirjade aluseks olevate tehingu dokumentidega.

(6) Selleks et parandada omavahel seotud väljadel esitatava teabe läbipaistvust ja kooskõlalisust ning selgitada teatavate väärtpaberistamiste, sealhulgas ühisusaldusfondi väärtpaberistamise eriomadusi, on vaja täpsustada teavet, mis tuleb delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 I, II ja III lisa teatavate väljade puhul esitada veergudes „Andmevälja nimi“ ja „Esitatav teave“.

(7) Seepärast tuleks delegeeritud määrust (EL) 2020/1226 vastavalt muuta.

(8) Käesolev määrus põhineb ESMA poolt komisjonile esitatud regulatiivsete tehniliste standardite eelnõul.

(9) ESMA on korraldanud käesoleva määruse aluseks oleva regulatiivsete tehniliste standardite eelnõu kohta avalikud konsultatsioonid, analüüsinud võimalikke seonduvaid kulusid ja kasu ning küsinud nõu Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 ([5]) artikli 37 kohaselt loodud väärtpaberituru sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

*Artikkel 1*

**Delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 muudatused**

Delegeeritud määrust (EL) 2020/1226 muudetakse järgmiselt.

1) Artiklit 1 muudetakse järgmiselt:

   a) lõikele 1 lisatakse punkt d järgmises sõnastuses:

      „d) kui väärtpaberistamine on bilansiline sünteetiline väärtpaberistamine, käesoleva määruse IV lisas kindlaks määratud teave.“;

   b) lõikele 2 lisatakse punkt d järgmises sõnastuses:

      „d) kui väärtpaberistamine on bilansiline sünteetiline väärtpaberistamine, käesoleva määruse IV lisa andmeväljadel STSSY2, STSSY10, STSSY12 ja STSSY13 kindlaks määratud teave.“

2) Artiklit 2 muudetakse järgmiselt:

   a) sissejuhatav lause asendatakse järgmisega:

      „Kui järgmised dokumendid sisaldavad standardväärtpaberistamise teate seisukohast olulist teavet, võib käesoleva määruse I, II, III või IV lisa veerus „Lisateave“ esitada viite nende dokumentide asjakohastele osadele ja juhul, kui selline teave esitatakse, tuleb kõnealused dokumendid selgelt märkida:“;

   b) punkt c asendatakse järgmisega:

      „c) mis tahes muu dokument, mis sisaldab standardväärtpaberistamise teate seisukohast asjakohast teavet, sealhulgas bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste korral dokumendid, mis on seotud väärtpaberistamise tehingu algatajaga, investoriga, krediidiriskikaitse lepinguga ja määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõikes 4 osutatud kontrolli tegeva kolmanda isikuga ning olemasolu korral dokumendid, mis on aluseks määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 viiendas lõigus osutatud krediidiriski vahetustehingut sisaldavatele võlakirjadele.“

([5]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 24. novembri 2010. aasta määrus (EL) nr 1095/2010, millega asutatakse Euroopa Järelevalveasutus (Euroopa Väärtpaberiturujärelevalve), muudetakse otsust nr 716/2009/EÜ ning tunnistatakse kehtetuks komisjoni otsus 2009/77/EÜ (ELT L 331, 15.12.2010, lk 84).

3) I, II ja III lisa muudetakse vastavalt käesoleva määruse I lisale.

4) Lisatakse käesoleva määruse II lisas esitatud IV lisa.

*Artikkel 2*

**Jõustumine**

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja vahetult kohaldatav kõikides liikmesriikides.

Brüssel, 31. märts 2022

*Komisjoni nimel*
*president*
Ursula VON DER LEYEN

*I LISA*

Delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 I, II ja III lisa muudetakse järgmiselt.

1) I lisa muudetakse järgmiselt:

a) tabelis „Üldine teave“ asendatakse andmeväljadele STSS4 ja STSS17 vastavad read järgmisega:

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| „STSS4 | Ei kohaldata | Kordumatu tunnus | Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 (*) artikli 11 lõikele 1.<br>Kui seda kordumatut väärtpaberistamise tunnust kasutades esitatakse rohkem kui üks standardväärtpaberistamise teade, siis selgitus põhjuse kohta. | Ei kohaldata |
| STSS17 | Artikli 27 lõige 3 | Väärtpaberistamise tehingu algataja (või algne laenuandja) on krediidiasutus | Märge „Jah“ või „Ei“ selle kohta, kas väärtpaberistamise tehingu algataja või algne laenuandja on liidus asutatud krediidiasutus või investeerimisühing. | Ei kohaldata |

(*) 16. oktoobri 2019. aasta delegeeritud määrus (EL) 2020/1224, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2017/2402 regulatiivsete tehniliste standarditega, milles määratakse kindlaks teave ja väärtpaberistamise üksikasjad, mille väärtpaberistamise tehingu algataja, sponsor ja väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja peavad esitama (ELT L 289, 3.9.2020, lk 1).“;

b) tabelis „Konkreetne teave“ asendatakse andmeväljadele STSS21 ja STSS22 vastavad read järgmisega:

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| „STSS21 | Artikli 20 lõige 2 | Kohaldatakse rangeid tagastamissätteid | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, kas väärtpaberistamise puhul kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 20 lõike 2 punktis a või b osutatud rangeid tagastamissätteid. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3 |
| STSS22 | Artikli 20 lõige 3 | Erand siseriiklike maksejõuetust käsitlevate õigusnormide tagastamissätetele | √ | | | Kinnitus selle kohta, kas kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 20 lõikes 3 osutatud tagastamissätteid. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3“ |

2) II lisa muudetakse järgmiselt:

a) tabelis „Üldine teave“ asendatakse andmeväljadele STSAT4 ja STSAT17 vastavad read järgmisega:

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| „STSAT4 | Ei kohaldata | Kordumatu tunnus | Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 artikli 11 lõikele 1.<br>Kui selle väärtpaberistamise kordumatu tunnusega väljastatakse rohkem kui üks standardväärtpaberistamise teade, siis selgitus põhjuse kohta. | Ei kohaldata |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| STSAT17 | Artikli 27 lõige 3 | Väärtpaberistamise tehingu algataja (või algne laenuandja) on krediidiasutus | Märge „Jah“ või „Ei“ selle kohta, kas väärtpaberistamise tehingu algataja või algne laenuandja on liidus asutatud krediidiasutus või investeerimisühing. | Ei kohaldata“ |

b) tabelis „Konkreetne teave“ asendatakse andmeväljadele STSAT21 ja STSAT22 vastavad read järgmisega:

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| „STSAT21 | Artikli 24 lõige 2 | Kohaldatakse rangeid tagastamissätteid | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, kas väärtpaberistamise puhul kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 24 lõike 2 punktis a või b osutatud rangeid tagastamissätteid. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3 |
| STSAT22 | Artikli 24 lõige 3 | Erand siseriiklike maksejõuetust käsitlevate õigusnormide tagastamissätetele | √ | | | Kinnitus selle kohta, kas kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 24 lõikes 3 osutatud tagastamissätteid. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3“ |

3) III lisa tabelis „Üldine teave“ asendatakse andmeväljale STSAP4 vastav rida järgmisega:

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| „STSAP4 | Ei kohaldata | Kordumatu tunnus | Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 artikli 11 lõikele 1.<br>Kui selle väärtpaberistamise kordumatu tunnusega väljastatakse rohkem kui üks standardväärtpaberistamise teade, siis selgitus põhjuse kohta. | Ei kohaldata“ |

*II LISA*

*„IV LISA*

Määruse (EL) 2017/2402 artiklite 26b–26e kohaselt bilansiliste väärtpaberistamiste kohta ESMA-le esitatav teave

**Üldine teave**

| Andmevälja kood | Määruse (EL) 2017/2402 artikkel | Andmevälja nimi | Esitatav teave | Lisateave |
|---|---|---|---|---|
| STSSY1 | Artikli 27 lõike 1 kolmas lõik | Esmane kontaktpunkt | Esmaseks kontaktpunktiks määratud üksuse juriidilise isiku tunnus ja asjaomase pädeva asutuse nimi. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2 |
| STSSY2 | Ei kohaldata | Teate kuupäev | ESMA-le teate esitamise kuupäev. | Ei kohaldata |
| STSSY3 | Ei kohaldata | Finantsinstrumendi tunnuskood | Rahvusvaheline väärtpaberite tunnuskood või -koodid (ISIN kood), kui see või need on olemas. Kui ISIN kood puudub, siis mis tahes muu kordumatu väärtpaberikood, kui see on olemas (sh krediidiriski vahetustehingut sisaldavad võlakirjad). | Olemasolu korral delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkti 3.1 alusel |
| STSSY4 | Ei kohaldata | Juriidilise isiku tunnus | Väärtpaberistamise tehingu algataja(te) ja sponsori(te) ning olemasolu korral algse(te) laenuandja(te) ja väärtpaberistamise eriotstarbelise(te) ettevõtja(te) juriidilise isiku tunnus. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 9. lisa punkt 4.2 |
| STSSY5 | Artikli 31 lõige 3 | Krediidiriski-kaitse müüja | Esmas(t)e krediidiriskikaitse müüja(te) juriidilise isiku tunnus, nimi ja asukohariik ning pädeva asutuse nimi. | Ei kohaldata |
| STSSY6 | Ei kohaldata | Teate tunnus | Ajakohastatud teabe esitamise korral kordumatu viitenumber, mille ESMA on määranud varem esitatud standardväärtpaberistamise teatele. | Ei kohaldata |
| STSSY7 | Ei kohaldata | Kordumatu tunnus | Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 artikli 11 lõikele 1 | Ei kohaldata |
| STSSY8 | Ei kohaldata | Väärtpaberista-mise register | Asjakohasel juhul registreeritud väärtpaberistamise registri nimi. | Ei kohaldata |
| STSSY9 | Artikli 18 teine lõik ja artikli 27 lõige 3 | Asutamise riik | Väärtpaberistamise tehingu algataja(te), sponsori(te), algse(te) laenuandja(te) ja väärtpaberistamise eriotstarbelise(te) ettevõtja(te) asutamise riik. | Ei kohaldata |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| STSSY10 | Ei kohaldata | Sünteetilise väärtpaberistamise liigitus | Sünteetilise väärtpaberistamise liik:<br>— otsese krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine;<br>— kaudse krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine. | Ei kohaldata |
| STSSY11 | Ei kohaldata | Kaudse krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine | Krediidiriskikaitse müüja nimi (valitsus või riigiülene asutus riskikaaluga 0 %) | Ei kohaldata |
| STSSY12 | Ei kohaldata | Kasutatav krediidiriskikaitse leping | Kasutatava krediidiriskikaitse lepingu liik:<br>— krediidituletisinstrumendid;<br>— finantstagatised | Ei kohaldata |
| STSSY13 | Ei kohaldata | Aluspositsioonide liigitus | Aluspositsioonide liik, sealhulgas:<br>1) kaubanduse rahastamise riskipositsioonid<br>2) väikeste ja keskmise suurusega ettevõtjate (VKEd) laenud<br>3) tarbimislaenud<br>4) suurte äriühingute laenud<br>5) nii VKEde kui ka suurte äriühingute laenud<br>6) ärikinnisvaraga seotud riskipositsioonid<br>7) muu | Ei kohaldata |
| STSSY14 | Ei kohaldata | Emiteerimise kuupäev | Tehingu lõpuleviimise kuupäev ja krediidiriskikaitse lepingu jõustumise kuupäev, kui see erineb tehingu lõpuleviimise kuupäevast. | Ei kohaldata |
| STSSY15 | Artikli 27 lõike 2 teine lõik | Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – kinnitus | Kui loa saanud kolmas isik on osutanud standardväärtpaberistamise kontrollimise teenuseid vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 27 lõikele 2, siis kinnitus selle kohta, et see loa saanud kolmas isik on kinnitanud vastavust standardväärtpaberistamise kriteeriumidele. | Ei kohaldata |
| STSSY16 | Artikli 27 lõike 2 teine lõik | Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – asutamise riik | Kui loa saanud kolmas isik on osutanud standardväärtpaberistamise kontrollimise teenuseid vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 27 lõikele 2, siis selle kolmanda isiku nimi ja asutamise riik. | Ei kohaldata |
| STSSY17 | Artikli 27 lõike 2 teine lõik | Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – pädev asutus | Kui loa saanud kolmas isik on osutanud standardväärtpaberistamise kontrollimise teenuseid vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 27 lõikele 2, siis loa andnud pädeva asutuse nimi. | Ei kohaldata |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| STSSY18 | Artikli 27 lõige 5 | Standardväärtpaberistamise staatus | Asjakohasel juhul väärtpaberistamise tehingu algataja põhjendatud teade selle kohta, et sünteetilist väärtpaberistamist ei käsitata enam standardväärtpaberistamisena. | Ei kohaldata |

**Konkreetne teave**

| Andmevälja kood | Määruse (EL) 2017/2402 artikkel | Andmevälja nimi | Kinnitus | Lühiselgitus | Üksikasjalik selgitus | Esitatav teave | Lisateave |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY19 | Artikli 26b lõike 1 esimene lõik | Väärtpaberistamise tehingu algataja on liidus järelevalve alla kuuluv üksus | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja on üksus, millel on liidus tegevusluba või litsents. | Ei kohaldata |
| STSSY20 | Artikli 26b lõike 1 teine lõik | Põhimõtted, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab ostetud kolmanda isiku riskipositsioonide suhtes | | √ | | Lühiselgitus krediidi-, sissenõudmise, võla ümberkujundamise ja haldamise põhimõtete kohta, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab enda arvel ostetud ja seejärel väärtpaberistatud kolmanda isiku riskipositsioonide suhtes ning mis ei või olla leebemad kui need, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab võrreldavate ostmata riskipositsioonide suhtes. | Ei kohaldata |
| STSSY21 | Artikli 26b lõige 2 | Aluspositsioonide algatamine | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonid algatatakse väärtpaberistamise tehingu algataja põhitegevuse käigus. | Ei kohaldata |
| STSSY22 | Artikli 26b lõike 3 esimene lõik | Väärtpaberistamise tehingu algataja bilansis hoitavad varad tehingu sulgemisel | √ | | | Kinnitus selle kohta, et tehingu sulgemisel hoitakse aluspositsioone väärtpaberistamise tehingu algataja või väärtpaberistamise tehingu algatajaga samasse gruppi kuuluva üksuse bilansis. | Ei kohaldata |
| STSSY23 | Artikli 26b lõike 3 teine lõik | Grupi kategooria | √ | | | Seoses andmeväljaga STSSY22 kinnitus selle kohta, milline kahest järgmisest grupist on asjakohane: | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | a) sellistest juriidilistest isikutest koosnev grupp, mille suhtes kohaldatakse usaldatavusnõuete kohast konsolideerimist vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 I osa II jaotise 2. peatükile;<br>b) direktiivi 2009/138/EÜ ([1]) artikli 212 lõike 1 punktis c määratletud konsolideerimisgrupp. | |
| STSSY24 | Artikli 26b lõige 4 | Väärtpaberistamise tehingu algataja riskipositsiooni täiendavat maandamist ei toimu | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja ei maanda väärtpaberistamise aluspositsioonide krediidiriski rohkem, kui see on maandatud kaitsega, millele saab krediidiriskikaitse lepingu kaudu. | Ei kohaldata |
| STSSY25 | Artikli 26b lõige 5 | Krediidiriskikaitse lepingu kooskõla määruse (EL) nr 575/2013 artikliga 249 | √ | | | Kinnitus selle kohta, et krediidiriskikaitse leping on kooskõlas krediidiriski maandamise normidega, mis on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 249. | Ei kohaldata |
| STSSY26 | Artikli 26b lõige 5 | Krediidiriskikaitse lepingu kooskõla muude krediidiriski maandamise normidega | | √ | | Kui määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 249 ei ole kohaldatav, siis lühiselgitus selle kohta, et on tagatud vastavus nõuetele, mis ei ole leebemad kui nimetatud artiklis sätestatud nõuded. | Ei kohaldata |
| STSSY27 | Artikli 26b lõike 6 punkt a | Kinnitused ja tagatised – aluspositsioonide omandiõigus | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaberistamise tehingu algatajal või temaga ühte konsolideerimisgruppi kuuluval üksusel on täielik ja kehtiv aluspositsioonide omandiõigus ja seonduvad lisaõigused. | Ei kohaldata |

([1]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 25. novembri 2009. aasta direktiiv 2009/138/EÜ kindlustus- ja edasikindlustustegevuse alustamise ja jätkamise kohta (ELT L 335, 17.12.2009, lk 1).

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY28 | Artikli 26b lõike 6 punkt b | Kinnitused ja tagatised – alusvara krediidirisk jääb väärtpaberistamise tehingu algataja bilanssi | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et kui väärtpaberistamise tehingu algataja on määruse (EL) nr 575/2013 artikli 4 lõike 1 punktis 1 määratletud krediidiasutus või direktiivi 2009/138/EÜ artikli 13 punktis 1 määratletud kindlustusandja, jääb aluspositsioonide krediidirisk väärtpaberistamise tehingu algataja või selle üksuse bilanssi, mille üle tehakse järelevalvet konsolideeritud alusel. | Ei kohaldata |
| STSSY29 | Artikli 26b lõike 6 punkt c | Kinnitused ja tagatised – vastavus sobivuskriteeriumidele | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaberistamise portfelli lisamise kuupäeval vastab iga aluspositsioon sobivuskriteeriumidele ja kõigile krediidiriskikaitse makse tegemise tingimustele kooskõlas väärtpaberistamisdokumentide hulka kuuluva krediidiriskikaitse lepinguga, välja arvatud määruse (EL) 2017/2402 artiklis 26e lõikes 1 osutatud krediidisündmuse toimumine. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |
| STSSY30 | Artikli 26b lõike 6 punkt d | Kinnitused ja tagatised – võlgniku seaduslik ja täitmisele pööratav kohustus | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja parima teadmise kohaselt on iga aluspositsiooni kohta sõlmitud lepingus sätestatud, et võlgnikul on juriidiline, kehtiv ja siduv kohustus lepingus kindlaks määratud rahasummad tasuda, millele saab pöörata sissenõude. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY31 | Artikli 26b lõike 6 punkt e | Kinnitused ja tagatised – laenude väljastamise kriteeriumid | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et aluspositsioonid vastavad laenude väljastamise kriteeriumidele, mis ei ole leebemad kui standardsed laenude väljastamise kriteeriumid, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab samalaadsete väärtpaberistamata riskipositsioonide suhtes. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |
| STSSY32 | Artikli 26b lõike 6 punkt f | Kinnitused ja tagatised – võlgnikud ei ole kohustust oluliselt rikkunud ega jätnud kohustust täitmata | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja parima teadmise kohaselt ei ole ükski võlgnik selle kuupäeva seisuga, mil aluspositsioon väärtpaberistamise portfelli lisatakse, ühtki aluspositsiooniga seotud kohustust oluliselt rikkunud ega jätnud kohustust täitmata. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |
| STSSY33 | Artikli 26b lõike 6 punkt g | Kinnitused ja tagatised – tehingu dokumentides valeinfo puudumine | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja parima teadmise kohaselt ei sisalda tehingu dokumendid aluspositsioonide üksikasjade kohta valeinfot. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |
| STSSY34 | Artikli 26b lõike 6 punkt h | Kinnitused ja tagatised – aluspositsioonide täidetavus või sissenõutavus | | √ | | Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et tehingu sulgemise või aluspositsiooni väärtpaberistamise portfelli lisamise ajal ei ole võlgniku ja algse laenuandja vahelist lepingut asjaomase aluspositsiooni kohta muudetud viisil, mis oleks aluspositsiooni täidetavust või sissenõudmist mõjutanud. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY35 | Artikli 26b lõike 7 esimene lõik | Sobivuskriteeriumid, mis ei võimalda aluspositsioonide puhul aktiivset portfelli valitsemist kaalutlusõiguse alusel | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonid vastavad eelnevalt kindlaks määratud, selgetele ja dokumenteeritud sobivuskriteeriumidele, mis ei võimalda nende riskipositsioonide puhul aktiivset portfelli valitsemist kaalutlusõiguse alusel. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |
| STSSY36 | Artikli 26b lõike 7 teine lõik | Erand aktiivse portfellivalitsemise keelust | | √ | | Seoses andmeväljaga STSSY35 lühiselgitus selle kohta, et portfelli aktiivse valitsemisena ei käsitata selliste riskipositsioonide asendamist, mis on vastuolus kinnituste või tagatistega, ja vahendite täiendamise perioodi hõlmavate väärtpaberistamiste puhul selliste riskipositsioonide lisamist, mis vastavad kindlaks määratud täiendamistingimustele. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |
| STSSY37 | Artikli 26b lõike 7 kolmas lõik | Pärast tehingu sulgemise kuupäeva lisatud riskipositsioonide vastavus sobivuskriteeriumidele | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et pärast tehingu sulgemise kuupäeva lisatud riskipositsioonid vastavad sobivuskriteeriumidele, mis ei ole leebemad kui need, mida kohaldati aluspositsioonide algsel valimisel. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |
| STSSY 38 | Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt a | Täielikult tagasimakstud riskipositsioon | | √ | | Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et see on täielikult tagasi makstud või muul viisil lunastatud. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |
| STSSY 39 | Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt b | Likvideeritud aluspositsioonid | | √ | | Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioon on väärtpaberistamise tehingu algataja tavapärase äritegevuse käigus likvideeritud, tingimusel et likvideerimine ei kujuta endast määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 250 osutatud kaudset toetust. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 40 | Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt c | Krediidist tulenevate muudatuste puudumine | | √ | | Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et aluspositsiooni muudetakse muul kui krediidist tuleneval põhjusel, nagu võla refinantseerimine või restruktureerimine, ning muudatus tehakse asjaomase aluspositsiooni tavapärase haldamise käigus. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |
| STSSY 41 | Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt d | Mittevastavus sobivuskriteeriumidele | | √ | | Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et see aluspositsioon ei vastanud tehingusse kaasamise ajal sobivuskriteeriumidele. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu |
| STSSY 42 | Artikli 26b lõike 8 esimene lõik | Varade homogeensus | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaberistamine on tagatud selliste aluspositsioonide kogumiga, mis on vara liigilt homogeensed. Seejuures viidatakse komisjoni delegeeritud määrusele (EL) 2019/1851 ([2]). | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 43 | Artikli 26b lõike 8 esimene lõik | Üksnes üht liiki varad | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas aluspositsioonide kogum koosneb üksnes üht liiki varadest. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 44 | Artikli 26b lõike 8 teine lõik | Lepinguliselt siduvad ja täitmisele pööratavad kohustused | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY42 osutatud aluspositsioonid sisaldavad lepinguliselt siduvaid ja täitmisele pööratavaid kohustusi, mis annavad võlgnike ja vajaduse korral garantiiandjate suhtes täieliku regressiõiguse. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |

([2]) Komisjoni 28. mai 2019. aasta delegeeritud määrus (EL) 2019/1851, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2017/2402 regulatiivsete tehniliste standarditega väärtpaberistamise aluspositsioonide homogeensuse kohta (ELT L 285, 6.11.2019, lk 1).

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 45 | Artikli 26b lõike 8 kolmas lõik | Kindlapiirilised perioodilised maksed | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas andmeväljal STSSY42 osutatud aluspositsioonidega kaasnevad kindlapiirilised perioodilised maksevood, mille osamaksete summad võivad erineda ning mis on seotud rendi-, põhisumma- või intressimaksetega või muu õigusega saada neid makseid toetavatelt varadelt tulu. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 46 | Artikli 26b lõike 8 kolmas lõik | Tulu vara müügist | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kas ja kuidas andmeväljal STSSY42 osutatud aluspositsioonid võivad tulu anda ka finantseeritud või liisitud vara müügist. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 47 | Artikli 26b lõike 8 neljas lõik | Vabalt võõrandatavate väärtpaberite puudumine | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas aluspositsioonid ei sisalda Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL ([3]) artikli 4 lõike 1 punktis 44 määratletud muid vabalt võõrandatavaid väärtpabereid kui äriühingute võlakirjad, mis ei ole kauplemiskohas noteeritud. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 48 | Artikli 26b lõige 9 | Edasiväärtpaberistamise keeld | √ | | | Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonid ei sisalda väärtpaberistamise positsioone. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2 |
| STSSY 49 | Artikli 26b lõike 10 esimene lõik | Laenude väljastamise standardite avalikustamine potentsiaalsetele investoritele | √ | | | Kinnitus selle kohta, et laenude väljastamise standardid, mille kohaselt aluspositsioonid algatatakse, ning olulised muutused võrreldes varasemate laenude väljastamise standarditega tehakse potentsiaalsetele investoritele põhjendamatu viivituseta täielikult teatavaks. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |

([3]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 50 | Artikli 26b lõike 10 esimene lõik | Täielik regressiõigus võlgniku vastu | √ | | | Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonide väljastamisel antakse täielik regressiõigus võlgniku suhtes, kes ei ole väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 51 | Artikli 26b lõike 10 esimene lõik | Laenude väljastamise standardid – kolmandate isikute osalemise puudumine | √ | | | Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonidega seotud krediidi- või väljastamisotsuste tegemisel ei osale kolmandad isikud. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 52 | Artikli 26b lõike 10 teine lõik | Laenude väljastamise standardid – eluasemelaenud | √ | | | Selliste väärtpaberistamiste korral, mille aluspositsioonid on eluasemelaenud, kinnitus selle kohta, et laenukogum ei sisalda laene, mille turustamisel ja väljastamisel on tuginetud eeldusele, et laenu taotlejale, või kui see on kohaldatav, siis vahendajatele, on teada antud, et laenuandja ei pruugi esitatud teavet kontrollida. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 53 | Artikli 26b lõike 10 kolmas lõik | Laenude väljastamise standardid – laenuvõtja hindamine | √ | | | Kinnitus selle kohta, et laenuvõtja krediidivõimelisuse hindamine vastab Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2008/48/EÜ ([4]) artiklis 8 sätestatud nõuetele või Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/17/EL ([5]) artikli 18 lõigetes 1–4, artikli 18 lõike 5 punktis a ja artikli 18 lõikes 6 sätestatud nõuetele, või kui see on kohaldatav, kolmandate riikide samaväärsetele nõuetele. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |
| STSSY 54 | Artikli 26b lõike 10 neljas lõik | Väärtpaberistamise tehingu algataja või algse laenuandja asjatundlikkus | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algatajal või algsel laenuandjal on asjatundlikkus väärtpaberistatavate riskipositsioonidega samalaadsete riskipositsioonide algatamise alal. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7 |

([4]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 23. aprilli 2008. aasta direktiiv 2008/48/EÜ, mis käsitleb tarbijakrediidilepinguid ja millega tunnistatakse kehtetuks nõukogu direktiiv 87/102/EMÜ (ELT L 133, 22.5.2008, lk 66).

([5]) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 4. veebruari 2014. aasta direktiiv 2014/17/EL elamukinnisvaraga seotud tarbijakrediidilepingute kohta ning millega muudetakse direktiive 2008/48/EÜ ja 2013/36/EL ja määrust (EL) nr 1093/2010 (ELT L 60, 28.2.2014, lk 34).

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 55 | Artikli 26b lõike 11 punkt a | Makseviivituses olevate riskipositsioonide puudumine | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonide valimise ajal ei kuulu nende hulka makseviivituses olevaid riskipositsioone määruse (EL) nr 575/2013 artikli 178 lõike 1 tähenduses ega riskipositsioone halvenenud krediidikvaliteediga võlgniku või garantiiandja suhtes, kes väärtpaberistamise tehingu algataja või algse laenuandja parima teadmise kohaselt on kolme aasta jooksul enne algatamise kuupäeva kuulutatud maksejõuetuks või kelle võlausaldajatele on kohus andnud lõpliku ja edasikaebamisele mittekuuluva nõudeõiguse või õiguse saada makse tegemata jätmise tulemusel tekkinud kahju eest hüvitist või kelle suhtes on kolme aasta jooksul enne aluspositsioonide valimist toimunud seoses viivisnõuetega võla restruktureerimise protsess, välja arvatud juhul, kui i) restruktureeritud aluspositsiooniga ei ole kaasnenud uusi võlgnevusi alates kuupäevast, mil toimus restruktureerimine, mis peab olema toimunud vähemalt üks aasta enne aluspositsioonide valimise kuupäeva; või ii) algataja poolt vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punktile a ja punkti e alapunktile i esitatud teabes on sõnaselgelt esitatud restruktureeritud aluspositsioonide osakaal, restruktureerimise aeg ja üksikasjad ning nende tulemusnäitajad alates restruktureerimise kuupäevast. Kui mõni neist kahest erandist on kohaldatav, tuleb esitada selle kohta lühiselgitus. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 56 | Artikli 26b lõike 11 punkt b | Varasema halva krediidiajaloo puudumine | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonide valimise ajal ei kuulu nende hulka makseviivituses olevaid riskipositsioone määruse (EL) nr 575/2013 artikli 178 lõike 1 tähenduses ega riskipositsioone halvenenud krediidikvaliteediga võlgniku või garantiiandja suhtes, kes väärtpaberistamise tehingu algataja või algse laenuandja parima teadmise kohaselt oli aluspositsiooni algatamise ajal, kui see on kohaldatav, kantud avalikku halva krediidiajalooga isikute krediidiregistrisse, või kui sellist avalikku krediidiregistrit ei eksisteerinud, muusse krediidiregistrisse, mis on algatajale või algsele laenuandjale kättesaadav. | Ei kohaldata |
| STSSY 57 | Artikli 26b lõike 11 punkt c | Maksmata jätmise risk ei ole suurem kui väärtpaberistamata riskipositsioonide puhul | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonide valimise ajal ei kuulu nende hulka makseviivituses olevaid riskipositsioone määruse (EL) nr 575/2013 artikli 178 lõike 1 tähenduses ega riskipositsioone halvenenud krediidikvaliteediga võlgniku või garantiiandja suhtes, kes väärtpaberistamise tehingu algataja või algse laenuandja parima teadmise kohaselt on saanud krediidikvaliteedi hinnangu või krediidikvaliteedi astme, mis näitab, et lepingus kokkulepitud maksete tegemata jätmise risk on palju suurem kui algataja hoitavate võrreldavate väärtpaberistamata riskipositsioonide puhul. | Ei kohaldata |
| STSSY 58 | Artikli 26b lõige 12 | Alusvara lisamisel vähemalt üks makse | √ | | | Kinnitus selle kohta, et võlgnikud on aluspositsioonide lisamise ajaks teinud vähemalt ühe makse, välja arvatud juhul, kui:<br>a) tegemist on uueneva väärtpaberistamisega, mis on tagatud ühes osas tasutavate riskipositsioonidega või mille lõpptähtaeg on lühem kui üks aasta, sealhulgas vaba tagasimaksega krediidiga seonduvad igakuised piiranguteta maksed; või | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.3 ja 3.4.6 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | b) riskipositsioon kujutab endast sellise riskipositsiooni refinantseerimist, mis on juba tehinguga hõlmatud.<br>Kui mõni neist kahest erandist on kohaldatav, tuleb esitada selle kohta lühiselgitus. | |
| STSSY 59 | Artikli 26c lõige 1 | Riski säilitamise nõude täitmine | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaberistamise tehingu algataja või algne laenuandja täidab riski säilitamise nõude vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artiklile 6. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 9. lisa punkt 3.1 ja 19. lisa punkt 3.4.3 |
| STSSY 60 | Artikli 26c lõike 2 esimene lõik | Intressimäära- ja valuutariskide maandamine | √ | | | Kinnitus selle kohta, et:<br>a) tehingu dokumentides kirjeldatakse väärtpaberistamisest tulenevaid intressimäära- ja valuutariske ning nende võimalikku mõju väärtpaberistamise tehingu algatajale ja investoritele tehtavatele maksetele,<br>b) need riskid maandatakse asjakohaselt ja kõik sel otstarbel võetud meetmed avalikustatakse investoritele. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8 |
| STSSY61 | Artikli 26c lõike 2 esimene lõik | Krediidiriskikaitse tagatis ja krediidiriskikaitse makse on nomineeritud samas valuutas | √ | | | Kinnitus selle kohta, et kõik tagatised, millega tagatakse investori kohustused krediidiriskikaitse lepingu alusel, on nomineeritud samas valuutas, milles on nomineeritud krediidiriskikaitse makse. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 62 | Artikli 26c lõike 2 teine lõik | Väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja kohustused on võrdsed tema tuluga või sellest väiksemad | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et kui väärtpaberistamisel kasutatakse väärtpaberistamise eriotstarbelist ettevõtjat, on väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja poolt investoritele tehtavate intressimaksetega seotud kohustuste summa igal maksekuupäeval võrdne tuluga, mida väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja saab väärtpaberistamise tehingu algatajalt ja tagatiskokkulepetest, või sellest väiksem. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8 |
| STSSY 63 | Artikli 26c lõike 2 kolmas lõik | Tuletisinstrumentide kasutamine ainult intressimäära- või valuutariski maandamiseks | √ | | | Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonide kogum ei sisalda tuletisinstrumente, välja arvatud juhul, kui eesmärk on aluspositsioonide intressimäära- või valuutariski maandamine. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8 |
| STSSY 64 | Artikli 26c lõike 2 kolmas lõik | Tuletisinstrumentide kasutamine vastavalt üldtunnustatud standarditele | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY63 osutatud erandi korral on kasutatavate tuletisinstrumentide emissioon tagatud ja need on dokumenteeritud vastavalt üldtunnustatud standarditele. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8 |
| STSSY 65 | Artikli 26c lõike 3 esimene ja teine lõik | Üldkasutatavatel intressimäärадel põhinevad viiteintressimaksed ilma keerukate valemite või tuletisinstrumentideta | | √ | | Tehinguga seoses tehtavate viiteintressimääraga seotud maksete korral lühiselgitus selle kohta, kummal järgmistest need põhinevad:<br>a) üldkasutatavad turu intressimäärad või üldkasutatavad sektoripõhised määrad, mis kajastavad vahendite kulusid, mitte aga keerukad valemid ega tuletisinstrumendid; või<br>b) tulu, mis tuleneb tagatisest, millega investori kohustused on krediidiriskikaitse lepingu alusel tagatud. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.2.2 ja 2.2.13 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | Lühiselgitus selle kohta, et kõik aluspositsioonidega seoses tasumisele kuuluvad viiteintressimääraga seotud maksed põhinevad üldkasutatavatel turu intressimääradel või üldkasutatavatel sektoripõhistel määradel, mis kajastavad vahendite kulusid, mitte aga keerukatel valemitel ega tuletisinstrumentidel. | |
| STSSY 66 | Artikli 26c lõike 4 esimene lõik | Täitmisele pööramise sündmus ei piira investori täitemeetmeid | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et investoril on lubatud võtta täitemeetmeid pärast täitmisele pööramise sündmust väärtpaberistamise tehingu algataja suhtes. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 67 | Artikli 26c lõike 4 teine lõik | Krediidiriski-kaitse lepingu täitmisele pööramine – ükski rahasumma ei jää väärtpaberista-mise eriotstarbelisest ettevõtjast üle kandmata | | √ | | Kui väärtpaberistamisel kasutatakse väärtpaberistamise eriotstarbelist ettevõtjat ja täitmise teade või krediidiriskikaitse lepingu lõpetamise teade on kätte toimetatud, siis lühiselgitus selle kohta, et ükski rahasumma ei jää väärtpaberistamise eriotstarbelisest ettevõtjast üle kandmata, välja arvatud see, mis on vajalik väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja toimimiseks, selliste makseviivituses aluspositsioonide eest kaitsemaksete tegemiseks, mis olid lõpetamise ajal veel ümberkujundamisel, ja investoritele korrapäraste tagasimaksete tegemiseks kooskõlas väärtpaberistamise lepingu tingimustega. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 68 | Artikli 26c lõike 5 esimene lõik | Kahjude jaotamine nõudeõiguse järgu alusel | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et kahjud jaotatakse väärtpaberistamise positsiooni omanikele vastavalt väärtpaberistamise seeria nõudeõiguse järgule, alustades kõige madalama nõudeõiguse järguga väärtpaberistamise seeriast. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 69 | Artikli 26c lõike 5 teine lõik | Järjestikune amortiseeri-mine | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et igal maksekuupäeval väärtpaberistamise seeriate tagasimaksmata summa kindlakstegemiseks kohaldatakse kõigi väärtpaberistamise seeriate suhtes järjestikust amortiseerimist, alustades kõige kõrgema nõudeõiguse järguga väärtpaberistamise seeriast. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 70 | Artikli 26c lõike 5 kolmas lõik | Mittejärjestikune maksehierarhia | | √ | | Erandina andmeväljast STSSY 69 lühiselgitus selle kohta, et tehingutes, mille puhul kohaldatakse mittejärjestikust maksehierarhiat, nähakse ette aluspositsioonide tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid, mis tingivad maksehierarhia ümberpööramise nii, et amortiseerimisel hakatakse makseid tegema vastavalt nõudeõiguse järgule. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 71 | Artikli 26c lõike 5 kolmanda lõigu punkt a | Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid | | | √ | Üksikasjalik selgitus andmeväljal STSSY70 osutatud kohustusliku tulemusnäitajatega seotud käivitava teguri kohta, milleks on kas makseviivituses olevate riskipositsioonide kumulatiivse summa suurenemine või kumulatiivse kahju suurenemine üle teatava protsendi alusportfelli tagasimaksmata summast. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 72 | Artikli 26c lõike 5 kolmanda lõigu punkt b | Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid | | | √ | Üksikasjalik selgitus andmeväljal STSSY70 osutatud möödunud perioodiga seotud käivitava lisateguri kohta. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 73 | Artikli 26c lõike 5 kolmanda lõigu punkt c | Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid | | | √ | Üksikasjalik selgitus andmeväljal STSSY70 osutatud eesseisva perioodiga seotud käivitava teguri kohta. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 74 | Artikli 26c lõike 5 seitsmes lõik | Amortiseeritavate väärtpaberistamise seeriate summaga võrdne tagatise summa | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise seeriate amortiseerudes tagastatakse investoritele tagatise summa, mis on võrdne nende seeriate amortisatsiooni summaga, eeldusel et investorid on nende seeriate kohta tagatise esitanud. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 75 | Artikli 26c lõike 5 kaheksas lõik | Toimunud krediidisündmus ja krediidiriskikaitse summa igal maksekuupäeval | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et kui seoses aluspositsioonidega on toimunud andmeväljadel STSSY100 või STSSY101 osutatud krediidisündmus ja võla ümberkujundamine ei ole nende puhul lõpule viidud, peab järelejäänud krediidiriskikaitse summa olema igal maksekuupäeval vähemalt võrdne nende aluspositsioonide tagasimaksmata nimiväärtusega, millest on maha arvatud kõigi nende aluspositsioonidega seoses tehtud vahepealsete maksete summa. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5 |
| STSSY 76 | Artikli 26c lõike 6 punkt a | Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – krediidikvaliteet | | √ | | Kui väärtpaberistamise puhul on tegemist uueneva väärtpaberistamisega, siis lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad asjakohaseid ennetähtaegse amortiseerimise klausleid või käivitavaid tegureid, mis tingivad uueneva väärtpaberistamise perioodi lõppemise, kui aluspositsioonide krediidikvaliteet halveneb eelnevalt kindlaks määratud künniseni või sellest allapoole. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.3 ja 2.4 |
| STSSY 77 | Artikli 26c lõike 6 punkt b | Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – kahju | | √ | | Kui väärtpaberistamise puhul on tegemist uueneva väärtpaberistamisega, siis lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad asjakohaseid ennetähtaegse amortiseerimise klausleid või käivitavaid tegureid, mis tingivad uueneva väärtpaberistamise perioodi lõppemise, kui kahju suureneb üle eelnevalt kindlaks määratud künnise. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.3 ja 2.4 |
| STSSY 78 | Artikli 26c lõike 6 punkt c | Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – uued aluspositsioonid | | √ | | Kui väärtpaberistamise puhul on tegemist uueneva väärtpaberistamisega, siis lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad asjakohaseid ennetähtaegse amortiseerimise klausleid või käivitavaid tegureid, mis tingivad uueneva väärtpaberistamise perioodi lõppemise, kui kindlaksmääratud ajavahemikul ei looda piisaval hulgal uusi aluspositsioone, mis vastaksid eelnevalt kindlaks määratud krediidikvaliteedile. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.3 ja 2.4 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 79 | Artikli 26c lõike 7 punkt a | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – nõudehaldaja | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt märgitud nõudehaldaja lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2 |
| STSSY 80 | Artikli 26c lõike 7 punkt a | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – usaldusisik | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et asjakohasel juhul on tehingu dokumentides selgelt märgitud usaldusisiku ja muude kõrvalteenuste osutajate lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2 |
| STSSY 81 | Artikli 26c lõike 7 punkt a | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – kontrolli tegev kolmas isik | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt märgitud andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegeva kolmanda isiku lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2 |
| STSSY 82 | Artikli 26c lõike 7 punkt b | Teenuseosutajate asendamine nende makseviivituse või maksejõuetuse korral | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt kindlaks määratud sätted, mis tagavad nõudehaldaja, usaldusisiku, muude kõrvalteenuste osutajate või andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegeva kolmanda isiku asendamise, kui üks nimetatud teenuseosutajatest on makseviivituses või maksejõuetu ning kui teenuseosutaja ei ole väärtpaberistamise tehingu algataja, nii et kõnealuste teenuste osutamine ei lõpe. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2 |
| STSSY 83 | Artikli 26c lõike 7 punkt c | Nõuete haldamise protseduurid | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt kindlaks määratud nõuete haldamise protseduurid, mida rakendatakse aluspositsioonide suhtes tehingu sulgemise kuupäeval ja pärast seda, ning asjaolud, mille korral võib selliseid protseduure muuta. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 84 | Artikli 26c lõike 7 punkt d | Nõuete haldamise standardid | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt kindlaks määratud nõuete haldamise standardid, mida nõudehaldaja on kohustatud aluspositsioonide haldamise käigus järgima kogu väärtpaberistamise kestuse jooksul. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6 |
| STSSY 85 | Artikli 26c lõike 8 esimene lõik | Nõudehaldaja nõutav asjatundlikkus | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et nõudehaldajal on asjatundlikkus väärtpaberistatud positsioonidega samalaadsete positsioonide haldamise alal. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6 |
| STSSY 86 | Artikli 26c lõike 8 esimene lõik | Hästi dokumenteeritud ja asjakohased põhimõtted, protseduurid ja riskijuhtimise kontrollimeetmed | √ | | | Kinnitus selle kohta, et nõudehaldajal on seoses riskipositsioonide haldamisega olemas hästi dokumenteeritud ja asjakohased põhimõtted, protseduurid ja riskijuhtimise kontrollimeetmed. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6 |
| STSSY 87 | Artikli 26c lõike 8 teine lõik | Vähemalt sama ranged haldamise protseduurid kui need, mida kohaldatakse sarnaste väärtpaberistamata riskipositsioonide suhtes | √ | | | Lühiselgitus selle kohta, et nõudehaldaja kohaldab aluspositsioonide haldamise protseduure, mis on vähemalt sama ranged kui protseduurid, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab samalaadsete väärtpaberistamata riskipositsioonide suhtes. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6 |
| STSSY 88 | Artikli 26c lõige 9 | Alusvara registri olemasolu | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaberistamise tehingu algataja peab ajakohastatud alusvara registrit, et aluspositsioone igal ajal kindlaks teha. | Ei kohaldata |
| STSSY 89 | Artikli 26c lõige 9 | Alusvara register – sisu | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 88 osutatud alusvara register sisaldab andmeid krediidituletisinstrumendi tingimuste aluseks oleva võlainstrumendi emiteerinud võlgnike kohta ja selle krediidituletisinstrumendi tingimuste aluseks oleva võlainstrumendi kohta, millest aluspositsioonid tulenevad, ning iga aluspositsiooni puhul nimiväärtust, mis on kaitstud ja tagasimaksmata. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 90 | Artikli 26c lõige 10 | Eri kategooria investorite vaheliste konfliktide õigeaegne lahendamine | √ | | | Kinnitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad selgeid sätteid, mis võimaldavad aegsasti lahendada konflikte eri kategooria investorite vahel. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.7 ja 3.4.8 |
| STSSY 91 | Artikli 26c lõige 10 | Väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja – selgelt kindlaks määratud hääleõigused | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja kasutamise korral on hääleõigused selgelt kindlaks määratud ja võlakirjaomanike vahel jaotatud ning usaldusisiku ja muude investorite ees usaldusülesandeid täitvate üksuste kohustused on selgelt kindlaks määratud. | Ei kohaldata |
| STSSY 92 | Artikli 26d lõige 1 | Varasemad makseviivituse ja kahjumi tulemusnäitajad | √ | | | Kinnitus selle kohta, et enne hinnakujundust tehakse potentsiaalsetele investoritele kättesaadavaks andmed varasemate staatiliste ja dünaamiliste makseviivituse ja kahjumi tulemusnäitajate kohta (mis hõlmavad vähemalt viieaastast perioodi), nagu viivisseisundit ja makseviivitust kajastavad andmed, selliste riskipositsioonide puhul, mis on üldjoontes sarnased väärtpaberistatavate positsioonidega; samuti nende andmete allikad ja asjaolud, mille alusel peetakse positsioone sarnaseks. | Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.2 |
| STSSY 93 | Artikli 26d lõige 2 | Aluspositsioonide valimi väliskontroll | √ | | | Kinnitus selle kohta, et enne tehingu sulgemist teeb asjakohane sõltumatu isik aluspositsioonide valimi väliskontrolli ja kontrollib muu hulgas, kas aluspositsioonid kvalifitseeruvad krediidiriskikaitse lepingu alusel krediidiriskikaitse saamiseks. | Ei kohaldata |
| STSSY 94 | Artikli 26d lõige 3 | Kohustiste rahavoo mudeli kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja teeb potentsiaalsetele investoritele enne väärtpaberistamise hinnakujundust kättesaadavaks kohustiste rahavoo mudeli, mis kajastab täpselt lepingul põhinevat seost aluspositsioonide ning väärtpaberistamise tehingu | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | algataja, investorite, muude kolmandate isikute, ja kui see on asjakohane, väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja vahel liikuvate maksete vahel, ning teeb selle mudeli pärast hinnakujundust kättesaadavaks investoritele jooksvalt ja potentsiaalsetele investoritele nende taotluse korral. | |
| STSSY 95 | Artikli 26d lõike 4 esimene lõik | Eluasemelaenudest või autolaenudest või -liisingutest koosnevate aluspositsioonide keskkonnatoime avaldamine | | √ | | Väärtpaberistamise puhul, mille aluspositsioonid on eluasemelaenud või autolaenud või -liisingud, ja kui ei kohaldata andmeväljal STSSY 96 osutatud erandit, lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja teeb määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punkti a kohaselt avalikustatava teabe osana kättesaadavaks teabe laenudega rahastatavate varade keskkonnatoime kohta. | Ei kohaldata |
| STSSY 96 | Artikli 26d lõike 4 teine lõik | Erand eluasemelaenudest või autolaenudest või -liisingutest koosnevate aluspositsioonide keskkonnatoime avaldamise nõudest | | √ | | Kui väärtpaberistamise tehingu algataja otsustab teha erandi andmevälja STSSY 95 nõudest, siis lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja avaldab kättesaadava teabe aluspositsioonidest rahastatavate varade põhilise negatiivse mõju kohta kestlikkusteguritele. | Ei kohaldata |
| STSSY97 | Artikli 26d lõige 5 | Väärtpaberistamise tehingu algataja vastutus määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 täitmise eest | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja vastutab määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 täitmise eest. | Ei kohaldata |
| STSSY 98 | Artikli 26d lõige 5 | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punkti a kohase teabe kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele | √ | | | Kinnitus selle kohta, et määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punktis a nõutud teave tehakse potentsiaalsetele investoritele taotluse korral enne hinnakujundust kättesaadavaks. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 99 | Artikli 26d lõige 5 | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punktide b, c ja d kohase teabe kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele vähemalt kavandina või esialgsel kujul | √ | | | Kinnitus selle kohta, et määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punktides b, c ja d nõutud teave tehakse enne hinnakujundust kättesaadavaks vähemalt kavandina või esialgsel kujul ning seejärel tehakse lõplikud dokumendid investoritele kättesaadavaks hiljemalt 15 päeva jooksul pärast tehingu sulgemist. | Ei kohaldata |
| STSSY 100 | Artikli 26e lõike 1 esimese lõigu punkt a | Krediidisündmused ja garantiide kasutamine | | √ | | Kui riski ülekandmiseks kasutatakse garantiisid, siis lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse leping hõlmab vähemalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 215 lõike 1 punktis a osutatud krediidisündmusi. | Ei kohaldata |
| STSSY 101 | Artikli 26e lõike 1 esimese lõigu punkt b | Krediidisündmused ja krediidituletisinstrumentide kasutamine | | √ | | Kui riski ülekandmiseks kasutatakse krediidituletisinstrumente, siis lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse leping hõlmab vähemalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 216 lõike 1 punktis a osutatud krediidisündmusi. | Ei kohaldata |
| STSSY 102 | Artikli 26e lõike 1 teine lõik | Krediidiriskikaitse lepingu dokumenteerimine | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et kõik krediidisündmused dokumenteeritakse. | Ei kohaldata |
| STSSY 103 | Artikli 26e lõike 1 kolmas lõik | Võla restruktureerimise meetmed ei välista sobivate krediidisündmuste käivitumist | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et määruse (EL) nr 575/2013 artikli 47b tähenduses võla restruktureerimise meetmed, mida kohaldatakse aluspositsioonide suhtes, ei välista sobivate krediidisündmuste käivitumist. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 104 | Artikli 26e lõike 2 esimene lõik | Krediidiriski-kaitse makse põhineb tegelikul realiseerunud kahjumil ning standardsetel sissenõudmis-põhimõtetel ja -menetlustel | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et pärast krediidisündmuse toimumist arvutatakse krediidiriskikaitse makse väärtpaberistamise tehingu algataja või algse laenuandja asjaomast liiki riskipositsioonidest tegelikult realiseerunud kahjumi põhjal, milleni jõuti tema standardsete sissenõudmispõhimõtete ja -menetlustega kooskõlas toimunud ümberkujundamise järel ning mis on makse tegemise ajal kajastatud tema finantsaruannetes. | Ei kohaldata |
| STSSY 105 | Artikli 26e lõike 2 esimene lõik | Kindlaksmääratud aja jooksul tasutav krediidiriski-kaitse makse | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et lõplik krediidiriskikaitse makse tasutakse kindlaksmääratud ajavahemiku jooksul pärast asjaomast riskipositsiooni puudutava võla ümberkujundamise lõppu, kui võla ümberkujundamine lõpeb enne graafikujärgset õiguslikku tähtaega või krediidiriskikaitse lepingu ennetähtaegset lõpetamist. | Ei kohaldata |
| STSSY 106 | Artikli 26e lõike 2 esimene lõik | Vahepealne krediidiriski-kaitse makse hiljemalt kuus kuud pärast krediidisünd-must | | √ | | Kui kahjumliku võla ümberkujundamist ei ole asjaomase aluspositsiooni puhul lõpule viidud määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 2 teises lõigus osutatud kuuekuulise perioodi lõpuks, siis lühiselgitus selle kohta, et vahepealne krediidiriskikaitse makse tehakse hiljemalt kuue kuu möödumisel andmeväljadel STSSY100 ja STSSY101 osutatud krediidisündmuse toimumisest. | Ei kohaldata |
| STSSY 107 | Artikli 26e lõike 2 teise lõigu punktid a ja b | Vahepealne krediidiriski-kaitse makse on suurem kui asjakohane oodatav kahju | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et vahepealne krediidiriskikaitse makse katab vähemalt järgmistest summadest suurema: | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | a) oodatava kahju summa, mis võrdub väärtuse langusega, mille väärtpaberistamise tehingu algataja on kandnud vahepealse makse tegemise ajal kooskõlas kohaldatava raamatupidamistavaga oma finantsaruannetesse, eeldusel et krediidiriskikaitse lepingut ei ole olemas ja see ei kata kahjumit; või<br>b) kui see on asjakohane, siis oodatava kahju summa, mis on määratud kindlaks vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 3. peatükile. | |
| STSSY 108 | Artikli 26e lõike 2 kolmas lõik | Vahepealse krediidiriskikaitse makse tingimused | | √ | | Vahepealse krediidiriskikaitse makse tegemise korral lühiselgitus selle kohta, et tehakse ka andmeväljal STSSY106 osutatud lõplik krediidiriskikaitse makse, millega kohandatakse kahju vahepealset arveldamist vastavalt tegelikule realiseerunud kahjumile. | Ei kohaldata |
| STSSY 109 | Artikli 26e lõike 2 neljas lõik | Vahepealse ja lõpliku krediidiriskikaitse makse arvutamise meetod | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus määratakse kindlaks vahepealse ja lõpliku krediidiriskikaitse makse arvutamise meetod. | Ei kohaldata |
| STSSY 110 | Artikli 26e lõike 2 viies lõik | Krediidiriskikaitse makse on proportsionaalne tagasimaksmata osa nimiväärtusega | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse makse on proportsionaalne krediidiriskikaitse lepinguga hõlmatud vastava aluspositsiooni tagasimaksmata osa nimiväärtusega. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 111 | Artikli 26e lõike 2 kuues lõik | Krediidiriski-kaitse makse täitmisele pööratavus | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja õigus krediidiriskikaitse maksele on täitmisele pööratav. | Ei kohaldata |
| STSSY 112 | Artikli 26e lõike 2 kuues lõik | Krediidiriski-kaitse lepingu kohaselt investorite makstav summa on krediidiriski-kaitse lepingus kindlaks määratud | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu kohaselt investori makstavad summad on krediidiriskikaitse lepingus selgelt kindlaks määratud ja piiratud. | Ei kohaldata |
| STSSY 113 | Artikli 26e lõike 2 kuues lõik | Summade arvutamine kõikidel juhtudel | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu alusel investorite makstavaid summasid on võimalik igal juhul arvutada. | Ei kohaldata |
| STSSY 114 | Artikli 26e lõike 2 kuues lõik | Investorite maksete asjaolud on krediidiriski-kaitse lepingus kindlaks määratud | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus on selgelt määratud kindlaks asjaolud, mille korral investorid on kohustatud makseid tegema. | Ei kohaldata |
| STSSY 115 | Artikli 26e lõike 2 kuues lõik | Kontrolli tegeva kolmanda isiku hinnang asjaoludele, mis tingivad investorite maksed | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik hindab, kas on tekkinud krediidiriskikaitse lepingus sätestatud asjaolud, mille korral investorid on kohustatud makseid tegema. | Ei kohaldata |
| STSSY 116 | Artikli 26e lõike 2 seitsmes lõik | Krediidiriski-kaitse makse summa arvutamine üksiku alluspositsiooni tasandil | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse makse summa arvutatakse selle üksiku alluspositsiooni tasandil, mille puhul on toimunud krediidisündmus. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 117 | Artikli 26e lõike 3 esimene lõik | Võla ümberkujundamise maksimaalse pikendusperioodi kindlaksmääramine | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus on kindlaks määratud maksimaalne pikendusperiood, mida kohaldatakse võla ümberkujundamisele selliste aluspositsioonide puhul, millega seoses on toimunud määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõikes 1 osutatud krediidisündmus, kuid võla ümberkujundamist ei ole graafikujärgsel õiguslikul tähtajal või krediidiriskikaitse lepingu ennetähtaegsel lõpetamisel lõpule viidud. | Ei kohaldata |
| STSSY 118 | Artikli 26e lõike 3 esimene lõik | Pikendusperiood on lühem kui kaks aastat | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 117 osutatud pikendusperiood ei ole pikem kui kaks aastat. | Ei kohaldata |
| STSSY 119 | Artikli 26e lõike 3 esimene lõik | Lõplik krediidiriskikaitse makse väärtpaberistamise tehingu algataja lõpliku kahju hinnangu alusel | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus nähakse ette, et andmeväljal STSSY 117 osutatud pikendusperioodi lõpuks tehakse viimane krediidiriskikaitse makse väärtpaberistamise tehingu algataja lõpliku kahju hindamise põhjal, mille väärtpaberistamise tehingu algataja kajastab selleks ajaks oma finantsaruannetes eeldusel, et krediidiriskikaitse lepingut ei ole olemas ja see ei kata kahjumit. | Ei kohaldata |
| STSSY 120 | Artikli 26e lõike 3 teine lõik | Krediidiriskikaitse lepingu lõpetamine | | √ | | Kui krediidiriskikaitse leping lõpetatakse, siis lühiselgitus selle kohta, et võla ümberkujundamine seoses enne lõpetamist toimunud võimalike lahendamata krediidisündmustega jätkub samal viisil, nagu on kirjeldatud määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 3 esimeses lõigus. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY121 | Artikli 26e lõike 3 kolmas lõik | Krediidiriski-kaitse preemiad sõltuvad tagasimaksmata osa nimiväärtusest | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu alusel makstavad krediidiriskikaitse preemiad on struktureeritud nii, et need sõltuvad nõuetekohaselt teenindatavate nõuete tagasimaksmata osa nimiväärtusest maksmise ajal ja kajastavad kaitstud väärtpaberistamise seeria riski. | Ei kohaldata |
| STSSY122 | Artikli 26e lõike 3 kolmas lõik | Krediidiriski-kaitse lepingus ei määrata kindlaks mehhanisme, mis võivad ära hoida või vähendada kahju tegelikku jaotamist investoritele | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et seoses andmeväljal STSSY117 osutatuga ei määrata krediidiriskikaitse lepingus kindlaks garanteeritud preemiaid, preemiate ettemakseid, hinnaalandusmehhanisme ega muid mehhanisme, mis võivad ära hoida või vähendada kahju tegelikku jaotamist investoritele või mille abil tagastatakse väärtpaberistamise tehingu algatajale osa makstud preemiatest pärast tehingu lõpptähtaega. | Ei kohaldata |
| STSSY123 | Artikli 26e lõike 3 neljas lõik | Erand seoses preemiate ettemaksetega | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et erandina andmeväljadest STSSY121 ja STSSY122 on preemiate ettemaksed lubatud juhul, kui garantiiskeem on liikmesriigi õiguses konkreetselt ette nähtud ja sellele on andnud edasigarantii mõni määruse (EL) nr 575/2013 artikli 214 lõike 2 punktides a–d loetletud üksus, tingimusel et järgitakse riigiabi eeskirju. | Ei kohaldata |
| STSSY124 | Artikli 26e lõike 3 viies lõik | Krediidiriski-kaitse preemia kirjeldus tehingu dokumentides | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides kirjeldatakse, kuidas arvutatakse krediidiriskikaitse preemiad ja võimalikud võlakirjakupongid iga maksekuupäeva puhul kogu väärtpaberistamise tehingu kestuse jooksul. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 125 | Artikli 26e lõike 3 kuues lõik | Investorite õiguste täitmisele pööratavus | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et investorite õigus saada krediidiriskikaitse preemiaid on täitmisele pööratav. | Ei kohaldata |
| STSSY 126 | Artikli 26e lõike 4 esimene lõik | Kontrolli tegeva kolmanda isiku määramine enne tehingu sulgemise kuupäeva | √ | | | Kinnitus selle kohta, et enne tehingu sulgemise kuupäeva määrab väärtpaberistamise tehingu algataja kontrolli tegeva kolmanda isiku. | Ei kohaldata |
| STSSY 127 | Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt a | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – krediidiriski-kaitse lepingu tingimustes osutatud krediidisünd-mus | √ | | | Kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kas tegemist on krediidiriskikaitse lepingu tingimustes osutatud krediidisündmusega. | Ei kohaldata |
| STSSY 128 | Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt b | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – aluspositsiooni kuulumine alusportfelli | √ | | | Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas aluspositsioon oli asjaomase krediidisündmuse toimumise ajal alusportfellis. | Ei kohaldata |
| STSSY 129 | Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt c | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – vastavus sobivuskriteer-iumidele alusportfelli lisamise ajal | √ | | | Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas aluspositsioon vastas alusportfelli lisamise ajal sobivuskriteeriumidele. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY130 | Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt d | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – vastavus täiendamistingimustele | √ | | | Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas täiendamine vastas täiendamistingimustele, kui aluspositsioon lisati väärtpaberistamisele täiendamise tulemusel. | Ei kohaldata |
| STSSY131 | Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt e | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – kahju vastavus väärtpaberistamise tehingu algataja kasumiaruandele | √ | | | Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas lõpliku kahjumi summa vastab väärtpaberistamise tehingu algataja kasumiaruandes kajastatud kahjumile. | Ei kohaldata |
| STSSY132 | Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt f | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – kahjude õige jagamine investorite vahel | √ | | | Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas viimase krediidiriskikaitse makse tasumise ajal on aluspositsioonidega seotud kahjud investorite vahel õigesti jagatud. | Ei kohaldata |
| STSSY133 | Artikli 26e lõike 4 teine lõik | Kontrolli tegev kolmas isik on väärtpaberistamise tehingu algatajast, investoritest ja (asjakohasel juhul) väärtpaberistamise eriotstarbelisest ettevõtjast sõltumatu | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik on väärtpaberistamise tehingu algatajast ja investoritest ning asjakohasel juhul väärtpaberistamise eriotstarbelisest ettevõtjast sõltumatu. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 134 | Artikli 26e lõike 4 teine lõik | Kontrolli tegeva kolmanda isiku määramine tehingu sulgemise kuupäevaks | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik on andnud tehingu sulgemise kuupäevaks nõusoleku kontrolli tegevaks kolmandaks isikuks määramisele. | Ei kohaldata |
| STSSY 135 | Artikli 26e lõike 4 kolmas lõik | Kontrolli tegeva kolmanda isiku valimipõhine kontroll | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik teeb kontrolli valimi alusel, mitte iga üksiku aluspositsiooni alusel, mille jaoks krediidiriskikaitse makset nõutakse. | Ei kohaldata |
| STSSY 136 | Artikli 26e lõike 4 kolmas lõik | Investorite võimalus taotleda, et kontrolli tegev kolmas isik kontrolliks konkreetseid aluspositsioone | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, kas ja kuidas investorid võivad taotleda mis tahes konkreetse aluspositsiooni sobivuse kontrollimist, kui nad ei ole valimipõhise kontrolliga rahul. | Ei kohaldata |
| STSSY 137 | Artikli 26e lõike 4 neljas lõik | Kontrolli tegeva kolmanda isiku juurdepääs kogu asjakohasele teabele | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja lisab tehingu dokumentidesse kohustuse edastada andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegevale kolmandale isikule kogu teave, mis on vajalik määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punktides a–f sätestatud nõuete täitmise kontrollimiseks. | Ei kohaldata |
| STSS 138 | Artikli 26e lõike 5 esimese lõigu punktid a–f | Lõpetamissündmused | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja ei või tehingut lõpetada enne selle graafikujärgset lõpptähtaega ühelgi muul põhjusel kui määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 5 punktides a–f loetletud sündmused. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSS 139 | Artikli 26e lõike 5 teine lõik | Tehingu dokumendid – ostuoptsioonid | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on täpsustatud, kas asjaomane tehing hõlmab mõnda määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 5 esimese lõigu punktides d ja e osutatud ostuoptsiooni ja kuidas sellised optsioonid on struktureeritud. | Ei kohaldata |
| STSS 140 | Artikli 26e lõike 5 kolmas lõik | Tehingu dokumendid – ajaline ostuoptsioon ei ole struktureeritud eesmärgiga vältida kahju jaotamist krediidikvaliteedi parandamise positsioonidele | | √ | | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 5 esimese lõigu punkti d kohaldamisel lühiselgitus selle kohta, et ajaline ostuoptsioon ei ole struktureeritud eesmärgiga vältida kahju jaotamist krediidikvaliteedi parandamise positsioonidele või muudele investorite omatavatele positsioonidele ega muul viisil struktureeritud krediidikvaliteedi parandamise võimaldamiseks. | Ei kohaldata |
| STSS 141 | Artikli 26e lõike 5 neljas lõik | Ostuoptsioon | | √ | | Kui tehing hõlmab ajalist ostuoptsiooni, siis lühiselgitus selle kohta, et andmeväljadel STSS139 ja STSS 140 osutatud nõuded on täidetud, sealhulgas ajalise ostuoptsiooni kasutamise põhjendus ja usutav teave, millest nähtub, et ostuoptsiooni kasutamise põhjuseks ei ole alusvara kvaliteedi halvenemine. | Ei kohaldata |
| STSS 142 | Artikli 26e lõike 5 viies lõik | Otsene krediidiriski-kaitse – tagatise tagastamine investoritele vastavalt väärtpaberista-mise seeriate nõudeõiguse järgule | | √ | | Otsese krediidiriskikaitse korral lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu lõpetamisel tagastatakse tagatis investoritele vastavalt väärtpaberistamise seeriate nõudeõiguse järgule, kohaldades väärtpaberistamise tehingu algataja suhtes kohaldatavaid asjakohaseid maksejõuetust käsitlevaid õigusnorme. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSS 143 | Artikli 26e lõige 6 | Tehingu lõpetamine investorite poolt, kui krediidiriski-kaitse preemia jäetakse maksmata | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et investorid ei või lõpetada tehingut enne selle kavandatud lõpptähtaega ühelgi muul põhjusel kui krediidiriskikaitse preemia maksmata jätmine või muu lepingulise kohustuse oluline rikkumine väärtpaberistamise tehingu algataja poolt. | Ei kohaldata |
| STSSY 144 | Artikli 26e lõike 7 punkt a | Investoritele pakutava sünteetilise ületulu summa on kindlaks määratud tehingu dokumentides ja väljendatud kindla protsendina portfelli tagasimaksmata summast | | √ | | Kui väärtpaberistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediidikvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et sünteetilise ületulu summa, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohustub kasutama krediidikvaliteedi parandamiseks igal makseperioodil, on kindlaks määratud tehingu dokumentides ja väljendatud kindla protsendina portfelli tagasimaksmata summast asjaomase makseperioodi alguses (fikseeritud sünteetiline ületulu). | Ei kohaldata |
| STSSY 145 | Artikli 26e lõike 7 punkt b | Kasutamata sünteetilise ületulu tagastamine väärtpaberista-mise tehingu algatajale | | √ | | Kui väärtpaberistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediidikvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et sünteetiline ületulu, mida ei kasutata selleks, et katta igal makseperioodil realiseerunud krediidikahjum, tagastatakse väärtpaberistamise tehingu algatajale. | Ei kohaldata |
| STSSY 146 | Artikli 26e lõike 7 punkt c | Sisereitingute meetodit kasutavad väärtpaberista-mise tehingu algatajad – aasta kohta ette nähtud summa ei ole suurem kui regulatiivne aastane oodatav kahju | | √ | | Kui väärtpaberistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediidikvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 143 osutatud sisereitingute meetodi kasutamise korral ei ole ette nähtud kogusumma aasta kohta suurem kui kõigi aluspositsioonide asjaomase | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | aasta oodatava kahju summa, mis on arvutatud vastavalt nimetatud määruse artiklile 158. | |
| STSSY 147 | Artikli 26e lõike 7 punkt d | Väärtpaberistamise tehingu algatajad, kes ei kasuta sisereitingute meetodit – alusportfelli ühe aasta oodatava kahju arvutamine määratakse selgelt kindlaks tehingu dokumentides | | √ | | Kui väärtpaberistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediidikvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et kui väärtpaberistamise tehingu algataja ei kasuta määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 143 osutatud sisereitingute meetodit, määratakse alusportfelli ühe aasta oodatava kahju arvutamine selgelt kindlaks tehingu dokumentides. | Ei kohaldata |
| STSSY 148 | Artikli 26e lõike 7 punkt e | Sünteetilise ületulu tingimuste sätestamine tehingu dokumentides | | √ | | Kui väärtpaberistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediidikvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõikes 7 ette nähtud tingimused on sätestatud tehingu dokumentides. | Ei kohaldata |
| STSS 149 | Artikli 26e lõike 8 punktid a, b ja c | Kasutatav krediidiriski-kaitse | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, millisele järgmistest vormidest krediidiriskikaitse leping vastab:<br>a) määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 4. peatükis sätestatud nõuetele vastav garantii, millega krediidirisk kantakse üle mõnele määruse (EL) nr 575/2013 artikli 214 lõike 2 punktides a–d loetletud üksusele, tingimusel et investorite suhtes olevate riskipositsioonide puhul saab nimetatud määruse III osa II jaotise 2. peatüki alusel kasutada 0 % riskikaalu; | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | b) määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 4. peatükis sätestatud nõuetele vastav garantii, millel on mõne käesoleva lõike punktis a osutatud üksuse edasigarantii;<br>c) punktides a ja b osutamata muu krediidiriskikaitse selliste garantiide, krediidituletisinstrumentide või krediidiriski vahetustehingut sisaldavate võlakirjade kujul, mis vastavad määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 249 sätestatud nõuetele, tingimusel et investorite kohustused on tagatud tagatisega, mis vastab määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõigetes 9 ja 10 sätestatud nõuetele. | |
| STSSY150 | Artikli 26e lõike 9 esimese lõigu punkt a | Väärtpaberistamise tehingu algataja õigus kasutada tagatist investorite krediidiriskikaitse maksetega seotud kohustuste täitmiseks on asjakohaste tagatiskokkulepete kaudu täitmisele pööratav | | | √ | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 8 punktis c osutatud krediidiriskikaitse kasutamise korral üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaberistamise tehingu algataja õigus kasutada tagatist investorite krediidiriskikaitse maksetega seotud kohustuste täitmiseks on täitmisele pööratav ja kuidas tagatakse selle õiguse täitmisele pööratavus asjakohaste tagatiskokkulepetega. | Ei kohaldata |
| STSSY151 | Artikli 26e lõike 9 esimese lõigu punkt b | Investorite õigus väärtpaberistamise lõppemisel või väärtpaberistamise seeriate amortiseerumisel kasutamata tagatisele | | √ | | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 8 punktis c osutatud krediidiriskikaitse kasutamise korral lühiselgitus selle kohta, et investorite õigus tagastada väärtpaberistamise lõppemisel või väärtpaberistamise seeriate amortiseerumisel tagatised, mida ei ole kasutatud krediidiriskikaitse maksete tegemiseks, on täitmisele pööratav. | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| STSSY 152 | Artikli 26e lõike 9 esimese lõigu punkt c | Väärtpaberitesse investeeritud tagatis – sobivuskriteeriumide ja hoidmise korra kindlaksmääramine tehingu dokumentides | | | √ | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 8 punktis c osutatud krediidiriskikaitse kasutamise korral üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas juhul, kui tagatis on investeeritud väärtpaberitesse, on tehingu dokumentides nähtud selliste väärtpaberite jaoks ette sobivuskriteeriumid ja hoidmise kord. | Ei kohaldata |
| STSSY 153 | Artikli 26e lõike 9 teine lõik | Väärtpaberistamise tehingu algataja krediidirisk jääb investorite krediidiriskiks | | √ | | Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on täpsustatud, kas väärtpaberistamise tehingu algataja krediidirisk jääb investorite krediidiriskiks. | Ei kohaldata |
| STSSY 154 | Artikli 26e lõike 9 kolmas lõik | Õiguslik arvamus, mis kinnitab krediidiriskikaitse täitmisele pööratavust kõikides jurisdiktsioonides | √ | | | Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja on saanud kvalifitseeritud õigusnõustajalt arvamuse, mis kinnitab krediidiriskikaitse täitmisele pööratavust kõigis asjaomastes jurisdiktsioonides. | Ei kohaldata |
| STSSY155 | Artikli 26e lõike 10 esimese lõigu punkt a | Kvaliteetne tagatis – 0 % riskiga kaalutud võlaväärtpaberid | | √ | | Kui krediidiriskikaitset pakutakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 punkti a kohaselt määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 2. peatükis osutatud 0 % riskiga kaalutud võlaväärtpaberite kujul, siis lühiselgitus selle kohta, et täidetud on kõik järgmised tingimused:<br>i) võlaväärtpaberite maksimaalne järelejäänud tähtaeg on kuni kolm kuud ega ole pikem kui järelejäänud aeg järgmise maksekuupäevani;<br>ii) võlaväärtpaberid saab lunastada sellise rahasumma vastu, mis võrdub kaitstud väärtpaberistamise seeria tagasimaksmata summaga; | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | iii) võlaväärtpabereid hoiab väärtpaberistamise tehingu algatajast ja investoritest sõltumatu depositoorium. | |
| STSSY 156 | Artikli 26e lõike 10 esimese lõigu punkt b | Kvaliteetne tagatis – raha kolmandast isikust krediidiasutuses, mille krediidikvaliteedi aste on 3 või üle selle | | √ | | Kui krediidiriskikaitset pakutakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 punkti b kohaselt, siis lühiselgitus tagatiskokkuleppe kohta, millega väärtpaberistamise tehingu algatajale ja investorile antakse tagatis rahana, mida hoitakse kolmandast isikust krediidiasutuses, mille krediidikvaliteedi aste on 3 või üle selle kooskõlas määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 136 sätestatud krediidikvaliteedi astmete määramisega. | Ei kohaldata |
| STSSY 157 | Artikli 26e lõike 10 teine lõik | Erand – tagatis väärtpaberistamise tehingu algataja juures hoiustatud rahana | | | √ | Kui kasutatakse erandit määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 esimesest lõigust, siis üksikasjalik selgitus tagatiskokkuleppe kohta, mille kohaselt ainult väärtpaberistamise tehingu algataja võib kasutada kvaliteetse tagatisena raha, mis on hoiustatud väärtpaberistamise tehingu algataja või tema sidusettevõtja juures, ja investori nõusolek selle tagatiskokkuleppega. | Ei kohaldata |
| STSSY 158 | Artikli 26e lõike 10 kolmas lõik | Tagatis väärtpaberistamise tehingu algataja juures hoiustatud rahana – pädeva asutuse luba | | | √ | Üksikasjalik selgitus määruse (EL) 2017/2402 artikli 29 lõike 5 kohaselt määratud pädeva asutuse nõusoleku kohta, et tagatisena võib kasutada raha, mis on hoiustatud väärtpaberistamise tehingu algataja või tema sidusettevõtja juures, kui väärtpaberistamise tehingu algataja või tema sidusettevõtja vastab krediidikvaliteedi astmele 3, tingimusel et võimalik on dokumenteerida tururaskused, finantsinstitutsiooni liikmesriigile määratud krediidikvaliteedi astmega seotud objektiivsed takistused või liikmesriigis esinevad märkimisväärsed | Ei kohaldata |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | võimalikud kontsentratsiooniprobleemid, mis tulenevad määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 teises lõigus osutatud krediidikvaliteedi astme 2 miinimumnõude kohaldamisest. | |
| STSSY 159 | Artikli 26e lõike 10 neljas lõik | Tagatise ülekandmine, kui kolmandast isikust krediidiasutus või väärtpaberistamise tehingu algataja ei vasta enam minimaalsele krediidikvaliteedi astmele | | | √ | Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas tagatis kooskõlas määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 neljanda lõiguga üle kantakse, kui tagatist hoiustati rahana krediidiasutuses, mis ei vasta enam minimaalsele krediidikvaliteedi astmele. | Ei kohaldata |
| STSSY 160 | Artikli 26e lõike 10 viies lõik | Vastavus tagatisnõuetele investeeringu puhul krediidiriski vahetustehingut sisaldavatesse võlakirjadesse, mille on emiteerinud väärtpaberistamise tehingu algataja | √ | | | Kinnitus selle kohta, et kooskõlas määruse (EL) nr 575/2013 artikliga 218 on tehtud investeering krediidiriski vahetustehingut sisaldavatesse võlakirjadesse, mille on emiteerinud väärtpaberistamise tehingu algataja. | Ei kohaldata“” |