II

*(Muud kui seadusandlikud aktid)*

# MÄÄRUSED

## KOMISJONI RAKENDUSMÄÄRUS (EL) 2022/1929,

## 31. märts 2022,

## millega muudetakse rakendusmääruses (EL) 2020/1227 sätestatud rakenduslikke tehnilisi standardeid seoses vormidega, mida kasutatakse bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste puhul teabe esitamiseks 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 7 kolmandat lõiku,

ning arvestades järgmist:

(1) Komisjoni rakendusmäärusega (EL) 2020/1227 ([2]) on ette nähtud vormide kasutamine lihtsa, läbipaistva ja standarditud väärtpaberistamise (standardväärtpaberistamise) teate nõuetele vastava teabe esitamiseks. Rakendusmääruse (EL) 2020/1227 I–III lisas on sätestatud teave, mis tuleb esitada Euroopa Väärtpaberiturujärelevalvele (ESMA) väärtpaberistamiste puhul, mis vastavad määruse (EL) 2017/2402 artiklites 19–22 ja artiklites 23–26 sätestatud standardväärtpaberistamise nõuetele.

(2) Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusega (EL) 2021/557 ([3]) muudeti määrust (EL) 2017/2402, laiendades standardväärtpaberistamise raamistikku bilansilistele sünteetilistele väärtpaberistamistele. Seega on vaja kindlaks määrata vorm bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste puhul teabe esitamiseks kooskõlas standardväärtpaberistamise teate nõuetega.

(3) Selleks et investorid, potentsiaalsed investorid ja pädevad asutused saaksid võrdleva ülevaate iga liiki standardväärtpaberistamise tehingute kohta, on vaja tagada kõigi standardväärtpaberistamise teadete kooskõlalisus. Bilansilise standardväärtpaberistamise teate vorm peaks seega järgima traditsioonilise standardväärtpaberistamise teate vormi, kuid samal ajal tuleb võtta arvesse ka määruse (EL) 2017/2402 artiklis 26e sätestatud nõudeid, mis on seotud krediidiriskikaitse lepingutega ja kontrolli tegeva kolmanda isiku rolliga.

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

([2]) Komisjoni 12. novembri 2019. aasta rakendusmäärus (EL) 2020/1227, milles sätestatakse rakenduslikud tehnilised standardid seoses standardväärtpaberistamise teate nõuetele vastava teabe esitamise vormidega (ELT L 289, 3.9.2020, lk 315).

([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) Tuleks sätestada bilansilise standardväärtpaberistamise teate iga andmevälja vorming ning ESMA-le esitatav teave tuleks esitada elektrooniliselt.

(5) Rakendusmääruse (EL) 2020/1227 I lisa kajastab komisjoni delegeeritud määruses (EL) 2020/1226 ([4]) komisjoni delegeeritud määrusega (EL) 2022/1301 ([5]) tehtud muudatusi.

(6) Seepärast tuleks rakendusmäärust (EL) 2020/1227 vastavalt muuta.

(7) Käesolev määrus põhineb ESMA poolt komisjonile esitatud rakenduslike tehniliste standardite eelnõul.

(8) ESMA on korraldanud käesoleva määruse aluseks oleva rakenduslike tehniliste standardite eelnõu kohta avalikud konsultatsioonid, analüüsinud võimalikke seonduvaid kulusid ja kasu ning küsinud nõu Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 1095/2010 ([6]) artikli 37 kohaselt loodud väärtpaberituru sidusrühmade kogult,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

*Artikkel 1*

**Rakendusmääruse (EL) 2020/1227 muutmine**

Rakendusmäärust (EL) 2020/1227 muudetakse järgmiselt.

1) Artiklit 1 muudetakse järgmiselt:

a) lisatakse lõige 3a järgmises sõnastuses:

„3a. Delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 artikli 1 lõike 1 punktis d ja artikli 1 lõike 2 punktis d osutatud teave esitatakse käesoleva määruse IV lisas esitatud vormis.“;

b) lõige 4 asendatakse järgmisega:

„4. Kui käesoleva artikli kohaselt esitatav teave ei ole kättesaadav või vajalik määruse (EL) 2017/2402 artiklite 43 ja 43a üleminekusätete kohaldamise tõttu, märgitakse käesoleva määruse lisade asjakohasele andmeväljale või asjakohastele andmeväljadele „Ei kohaldata üleminekusätete kohaldamise tõttu“.“;

c) lõige 6 asendatakse järgmisega:

„6. Delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 artiklis 2 osutatud lisateave esitatakse käesoleva määruse I–IV lisa andmeväljal „Täidetav andmeväli“.“

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

3) Lisatakse käesoleva määruse II lisas esitatud IV lisa.

([4]) 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).

([5]) Komisjoni 26. juuli 2022. aasta delegeeritud määrus (EL) 2022/1301, millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2020/1226 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses teabega, mis tuleb bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste puhul esitada kooskõlas standardväärtpaberistamise teate nõuetega (ELT L 197, 26.7.2022, lk 10).

([6]) 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).

*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*

Rakendusmääruse (EL) 2020/1227 I, II ja III lisa muudetakse järgmiselt.

1. I lisa tabelis „Standardväärtpaberistamise teate vorm muu kui varaga tagatud kommertsväärtpaberite väärtpaberistamise puhul“ asendatakse andmeväljadele STSS4, STSS17, STSS21 ja STSS22 vastavad read järgmisega:

| | | | |
|---|---|---|---|
| „STSS4 | Kordumatu tunnus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS17 | Väärtpaberistamise tehingu algataja (või algne laenuandja) on krediidiasutus | | {Y/N} |
| STSS21 | Kohaldatakse rangeid tagastamissätteid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS22 | Erand siseriiklike maksejõuetust käsitlevate õigusnormide tagastamissätetele | | {ALPHANUM-10000}“ |

2. II lisa tabelis „Standardväärtpaberistamise teate vorm varaga tagatud kommertsväärtpaberite väärtpaberistamise puhul“ asendatakse andmeväljadele STSAT4, STSAT17, STSAT21 ja STSAT22 vastavad read järgmisega:

| | | | |
|---|---|---|---|
| „STSAT4 | Kordumatu tunnus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT17 | Väärtpaberistamise tehingu algataja (või algne laenuandja) on krediidiasutus | | {Y/N} |
| STSAT21 | Kohaldatakse rangeid tagastamissätteid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT22 | Erand siseriiklike maksejõuetust käsitlevate õigusnormide tagastamissätetele | | {ALPHANUM-10000}“ |

3. III lisa tabelis „Standardväärtpaberistamise teate vorm varaga tagatud kommertsväärtpaberite programmi puhul“ asendatakse andmeväljale STSAP4 vastav rida järgmisega:

| | | | |
|---|---|---|---|
| „STSAP4 | Kordumatu tunnus | | {ALPHANUM-1000}“ |

*II LISA*

*„IV LISA*

**Standardväärtpaberistamise teate vormi andmeväljade vorming**

| TÄHIS | ANDMELIIK | MÄÄRATLUS |
|---|---|---|
| {ALPHANUM-n} | Kuni n tähtnumbrilist märki | Vabateksti väli. Tuleb esitada ASCII vormingus (rõhumärke ei kasutata). |
| {COUNTRYCODE_2} | 2 tähtnumbrilist märki | Kahetäheline riigikood (ISO 3166–1 alpha-2 riigikood). Tuleb esitada ASCII vormingus (rõhumärke ei kasutata). |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 tähtnumbrilist märki | Kolmetäheline valuutakood (ISO 4217 valuutakood). Tuleb esitada ASCII vormingus (rõhumärke ei kasutata). |
| {DATEFORMAT} | ISO 8601 vormingus kuupäev | Kuupäevad tuleb esitada järgmisel kujul: AAAA-KK-PP |
| {Y/N} | 1 tähtnumbriline märk | „õige“ – Y<br>„vale“ – N |
| {ISIN} | 12 tähtnumbrilist märki | ISIN kood standardi ISO 6166 järgi |
| {LEI} | 20 tähtnumbrilist märki | Juriidilise isiku tunnus standardi ISO 17442 järgi |

**Standardväärtpaberistamise teate vorm bilansiliste väärtpaberistamiste puhul**

| ANDMEVÄLJA KOOD | ANDMEVÄLJA NIMI | TÄIDETAV ANDMEVÄLI | ANDMEVÄLJA VORMING |
|---|---|---|---|
| STSSY 1 | Esmane kontaktpunkt | | {LEI} |
| STSSY 2 | Teate kuupäev | | {DATEFORMAT} |
| STSSY 3 | Finantsinstrumendi tunnuskood | | {ISIN} |
| STSSY 4 | Juriidilise isiku tunnus | | {LEI} |
| STSSY 5 | Krediidiriskikaitse müüja | | {ALPHANUM-100} |
| STSSY 6 | Teate tunnus | | {ALPHANUM-100} |
| STSSY 7 | Kordumatu tunnus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 8 | Väärtpaberistamise register | | {ALPHANUM-100} |
| STSSY 9 | Asutamise riik | | {COUNTRYCODE_2} |
| STSSY 10 | Sünteetilise väärtpaberistamise liigitus | | {LIST} |
| STSSY 11 | Kaudse krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine | | {LIST} |
| STSSY 12 | Kasutatav krediidiriskikaitse leping | | {LIST} |
| STSSY 13 | Aluspositsioonide liigitus | | {LIST} |
| STSSY 14 | Emiteerimise kuupäev | | {DATEFORMAT} |
| STSSY 15 | Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – kinnitus | | {ALPHANUM-100} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 16 | Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – asutamise riik | | {COUNTRYCODE_2} |
| STSSY 17 | Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – pädev asutus | | {ALPHANUM-100} |
| STSSY 18 | Standardväärtpaberistamise staatus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 19 | Väärtpaberistamise tehingu algataja on liidus järelevalve alla kuuluv üksus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 20 | Põhimõtted, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab ostetud kolmanda isiku riskipositsioonide suhtes | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 21 | Aluspositsioonide algatamine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 22 | Väärtpaberistamise tehingu algataja bilansis hoitavad varad tehingu sulgemisel | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 23 | Grupi kategooria | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 24 | Väärtpaberistamise tehingu algataja riskipositsiooni täiendavat maandamist ei toimu | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 25 | Krediidiriskikaitse lepingu kooskõla määruse (EL) nr 575/2013 artikliga 249 | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 26 | Krediidiriskikaitse lepingu kooskõla muude krediidiriski maandamise normidega | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY27 | Kinnitused ja tagatised – aluspositsioonide omandiõigus | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY28 | Kinnitused ja tagatised – alusvara krediidirisk jääb väärtpaberistamise tehingu algataja bilanssi | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY29 | Kinnitused ja tagatised – vastavus sobivuskriteeriumidele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY30 | Kinnitused ja tagatised – võlgniku seaduslik ja täitmisele pööratav kohustus | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY31 | Kinnitused ja tagatised – laenude väljastamise kriteeriumid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY32 | Kinnitused ja tagatised – võlgnikud ei ole kohustust oluliselt rikkunud ega jätnud kohustust täitmata | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY33 | Kinnitused ja tagatised – tehingu dokumentides valeinfo puudumine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY34 | Kinnitused ja tagatised – aluspositsioonide täidetavus või sissenõutavus | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY35 | Sobivuskriteeriumid, mis ei võimalda aluspositsioonide puhul aktiivset portfelli valitsemist kaalutlusõiguse alusel | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY36 | Erand aktiivse portfellivalitsemise keelust | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY37 | Pärast tehingu sulgemise kuupäeva lisatud riskipositsioonide vastavus sobivuskriteeriumidele | | {ALPHANUM-10000} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 38 | Täielikult tagasimakstud riskipositsioon | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 39 | Likvideeritud aluspositsioonid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 40 | Krediidist tulenevate muudatuste puudumine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 41 | Mittevastavus sobivuskriteeriumidele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 42 | Varade homogeensus | | {ALPHANUM} |
| STSSY 43 | Üksnes üht liiki varad | | {ALPHANUM} |
| STSSY 44 | Lepinguliselt siduvad ja täitmisele pööratavad kohustused | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 45 | Kindlapiirilised perioodilised maksed | | {ALPHANUM} |
| STSSY 46 | Tulu vara müügist | | {ALPHANUM} |
| STSSY 47 | Vabalt võõrandatavate väärtpaberite puudumine | | {ALPHANUM} |
| STSSY 48 | Edasiväärtpaberistamise keeld | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 49 | Laenude väljastamise standardite avalikustamine potentsiaalsetele investoritele | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 50 | Täielik regressiõigus võlgniku vastu | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 51 | Laenude väljastamise standardid – kolmandate isikute osalemise puudumine | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 52 | Laenude väljastamise standardid – eluasemelaenud | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 53 | Laenude väljastamise standardid – laenuvõtja hindamine | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 54 | Väärtpaberistamise tehingu algataja või algse laenuandja asjatundlikkus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 55 | Makseviivituses olevate riskipositsioonide puudumine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 56 | Varasema halva krediidiajaloo puudumine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 57 | Maksmata jätmise risk ei ole suurem kui väärtpaberistamata riskipositsioonide puhul | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 58 | Alusvara lisamisel vähemalt üks makse | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 59 | Riski säilitamise nõude täitmine | | {ALPHANUM} |
| STSSY 60 | Intressimäära- ja valuutariskide maandamine | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 61 | Krediidiriskikaitse tagatis ja krediidiriskikaitse makse on nomineeritud samas valuutas | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 62 | Väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja kohustused on võrdsed tema tuluga või sellest väiksemad | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 63 | Tuletisinstrumentide kasutamine ainult intressimäära- või valuutariski maandamiseks | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 64 | Tuletisinstrumentide kasutamine vastavalt üldtunnustatud standarditele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 65 | Üldkasutatavatel intressimääradel põhinevad viiteintressimaksed ilma keerukate valemite või tuletisinstrumentideta | | {ALPHANUM-10000} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 66 | Täitmisele pööramise sündmus ei piira investori täitemeetmeid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 67 | Krediidiriskikaitse lepingu täitmisele pööramine – ükski rahasumma ei jää väärtpaberistamise eriotstarbelisest ettevõtjast üle kandmata | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 68 | Kahjude jaotamine nõudeõiguse järgu alusel | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 69 | Järjestikune amortiseerimine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 70 | Mittejärjestikune maksehierarhia | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 71 | Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid | | {ALPHANUM} |
| STSSY 72 | Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid | | {ALPHANUM} |
| STSSY 73 | Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid | | {ALPHANUM} |
| STSSY 74 | Amortiseeritavate väärtpaberistamise seeriate summaga võrdne tagatise summa | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 75 | Toimunud krediidisündmus ja krediidiriskikaitse summa igal maksekuupäeval | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 76 | Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – krediidikvaliteet | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 77 | Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – kahju | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 78 | Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – uued aluspositsioonid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 79 | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – nõudehaldaja | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 80 | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – usaldusisik | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 81 | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – kontrolli tegev kolmas isik | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 82 | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – makseviivitus või maksejõuetus | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 83 | Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – nõuete haldamise protseduurid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 84 | Nõuete haldamise standardid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 85 | Nõudehaldaja nõutav asjatundlikkus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 86 | Hästi dokumenteeritud ja asjakohased põhimõtted, protseduurid ja riskijuhtimise kontrollimeetmed | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 87 | Vähemalt sama ranged haldamise protseduurid kui need, mida kohaldatakse sarnaste väärtpaberistamata riskipositsioonide suhtes | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 88 | Alusvara registri olemasolu | | {ALPHANUM} |
| STSSY 89 | Alusvara register – sisu | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 90 | Eri kategooria investorite vaheliste konfliktide õigeaegne lahendamine | | {ALPHANUM-1000} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 91 | Väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja – selgelt kindlaks määratud hääleõigused | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 92 | Varasemad makseviivituse ja kahjumi tulemusnäitajad | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 93 | Aluspositsioonide valimi väliskontroll | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 94 | Kohustiste rahavoo mudeli kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 95 | Eluasemelaenudest või autolaenudest või -liisingutest koosnevate aluspositsioonide keskkonnatoime avaldamine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 96 | Erand eluasemelaenudest või autolaenudest või -liisingutest koosnevate aluspositsioonide keskkonnatoime avaldamise nõudest | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY97 | Väärtpaberistamise tehingu algataja vastutus määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 täitmise eest | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 98 | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punkti a kohase teabe kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 99 | Määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punktide b, c ja d kohase teabe kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele vähemalt kavandina või esialgsel kujul | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 100 | Krediidisündmused ja garantiide kasutamine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 101 | Krediidisündmused ja krediidituletisinstrumentide kasutamine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 102 | Krediidiriskikaitse lepingu dokumenteerimine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 103 | Võla restruktureerimise meetmed ei välista sobivate krediidisündmuste käivitumist | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 104 | Krediidiriskikaitse makse põhineb tegelikul realiseerunud kahjumil ning standardsetel sissenõudmispõhimõtetel ja -menetlustel | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 105 | Kindlaksmääratud aja jooksul tasutav krediidiriskikaitse makse | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 106 | Vahepealne krediidiriskikaitse makse hiljemalt kuus kuud pärast krediidisündmust | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 107 | Vahepealne krediidiriskikaitse makse on suurem kui asjakohane oodatav kahju | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 108 | Vahepealse krediidiriskikaitse makse tingimused | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 109 | Vahepealse ja lõpliku krediidiriskikaitse makse arvutamise meetod | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 110 | Krediidiriskikaitse makse on proportsionaalne tagasimaksmata osa nimiväärtusega | | {ALPHANUM-10000} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 111 | Krediidiriskikaitse makse täitmisele pööratavus | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 112 | Krediidiriskikaitse lepingu kohaselt investorite makstav summa on krediidiriskikaitse lepingus kindlaks määratud | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 113 | Summade arvutamine kõikidel juhtudel | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 114 | Investorite maksete asjaolud on krediidiriskikaitse lepingus kindlaks määratud | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 115 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku hinnang asjaoludele, mis tingivad investorite maksed | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 116 | Krediidiriskikaitse makse summa arvutamine üksiku aluspositsiooni tasandil | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 117 | Võla ümberkujundamise maksimaalse pikendusperioodi kindlaksmääramine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 118 | Pikendusperiood on lühem kui kaks aastat | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 119 | Lõplik krediidiriskikaitse makse väärtpaberistamise tehingu algataja lõpliku kahju hinnangu alusel | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 120 | Krediidiriskikaitse lepingu lõpetamine | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 121 | Krediidiriskikaitse preemiad sõltuvad tagasimaksmata osa nimiväärtusest | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 122 | Krediidiriskikaitse lepingus ei määrata kindlaks mehhanisme, mis võivad ära hoida või vähendada kahju tegelikku jaotamist investoritele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 123 | Erand seoses preemiate ettemaksetega | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 124 | Krediidiriskikaitse preemia kirjeldus tehingu dokumentides | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 125 | Investorite õiguste täitmisele pööratavus | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 126 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku määramine enne tehingu sulgemise kuupäeva | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 127 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – krediidiriskikaitse lepingu tingimustes osutatud krediidisündmus | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 128 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – aluspositsiooni kuulumine alusportfelli | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 129 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – vastavus sobivuskriteeriumidele alusportfelli lisamise ajal | | {ALPHANUM-1000} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 130 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – vastavus täiendamistingimustele | | {{ALPHANUM-1000} |
| STSSY 131 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – kahju vastavus väärtpaberistamise tehingu algataja kasumiaruandele | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 132 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – kahjude õige jagamine investorite vahel | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 133 | Kontrolli tegev kolmas isik on väärtpaberistamise tehingu algatajast, investoritest ja (asjakohasel juhul) väärtpaberistamise eriotstarbelisest ettevõtjast sõltumatu | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 134 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku määramine tehingu sulgemise kuupäevaks | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 135 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku valimipõhine kontroll | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 136 | Investorite võimalus taotleda, et kontrolli tegev kolmas isik kontrolliks konkreetseid aluspositsioone | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 137 | Kontrolli tegeva kolmanda isiku juurdepääs kogu asjakohasele teabele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 138 | Lõpetamissündmused | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 139 | Tehingu dokumendid – ostuoptsioonid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 140 | Tehingu dokumendid – ajaline ostuoptsioon ei ole struktureeritud eesmärgiga vältida kahju jaotamist krediidikvaliteedi parandamise positsioonidele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 141 | Ostuoptsioon | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 142 | Otsene krediidiriskikaitse – tagatise tagastamine investoritele vastavalt väärtpaberistamise seeriate nõudeõiguse järgule | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 143 | Tehingu lõpetamine investorite poolt, kui krediidiriskikaitse preemia jäetakse maksmata | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 144 | Investoritele pakutava sünteetilise ületulu summa on kindlaks määratud tehingu dokumentides ja väljendatud kindla protsendina portfelli tagasimaksmata summast | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 145 | Kasutamata sünteetilise ületulu tagastamine väärtpaberistamise tehingu algatajale | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 146 | Sisereitingute meetodit kasutavad väärtpaberistamise tehingu algatajad – aasta kohta ette nähtud summa ei ole suurem kui regulatiivne aastane oodatav kahju | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 147 | Väärtpaberistamise tehingu algatajad, kes ei kasuta sisereitingute meetodit – alusportfelli ühe aasta oodatava kahju arvutamine määratakse selgelt kindlaks tehingu dokumentides | | {ALPHANUM-10000} |

| | | | |
|---|---|---|---|
| STSSY 148 | Sünteetilise ületulu tingimuste sätestamine tehingu dokumentides | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS 149 | Kasutatav krediidiriskikaitse | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 150 | Väärtpaberistamise tehingu algataja õigus kasutada tagatist investorite krediidiriskikaitse maksetega seotud kohustuste täitmiseks on asjakohaste tagatiskokkulepete kaudu täitmisele pööratav | | {ALPHANUM} |
| STSSY 151 | Investorite õigus väärtpaberistamise lõppemisel või väärtpaberistamise seeriate amortiseerumisel kasutamata tagatisele | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 152 | Väärtpaberitesse investeeritud tagatis – sobivuskriteeriumide ja hoidmise korra kindlaksmääramine tehingu dokumentides | | {ALPHANUM} |
| STSSY 153 | Väärtpaberistamise tehingu algataja krediidirisk jääb investorite krediidiriskiks | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 154 | Õiguslik arvamus, mis kinnitab krediidiriskikaitse täitmisele pööratavust kõikides jurisdiktsioonides | | {ALPHANUM-1000} |
| STSSY 155 | Kvaliteetne tagatis – 0 % riskiga kaalutud võlaväärtpaberid | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 156 | Kvaliteetne tagatis – raha kolmandast isikust krediidiasutuses, mille krediidikvaliteedi aste on 3 või üle selle | | {ALPHANUM-10000} |
| STSSY 157 | Erand – tagatis väärtpaberistamise tehingu algataja juures hoiustatud rahana | | {ALPHANUM} |
| STSSY 158 | Tagatis väärtpaberistamise tehingu algataja juures hoiustatud rahana – pädeva asutuse luba | | {ALPHANUM} |
| STSSY 159 | Tagatise ülekandmine, kui kolmandast isikust krediidiasutus või väärtpaberistamise tehingu algataja ei vasta enam minimaalsele krediidikvaliteedi astmele | | {ALPHANUM} |
| STSSY 160 | Vastavus tagatisnõuetele investeeringu puhul krediidiriski vahetustehingut sisaldavatesse võlakirjadesse, mille on emiteerinud väärtpaberistamise tehingu algataja | | {ALPHANUM-1000}“” |