DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2020/1227 DER KOMMISSION

vom 12. November 2019

zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf Meldebögen für die Bereitstellung von Informationen gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012 ([1]), insbesondere auf Artikel 27 Absatz 7,

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) Um die Wirksamkeit und Harmonisierung von Meldungen zu erleichtern, sollten die Informationen zu Verbriefungen, die die Anforderungen der Artikel 19 bis 22 und 23 bis 26 der Verordnung (EU) 2017/2402 an eine einfache, transparente und standardisierte („STS"-)Verbriefung erfüllen, der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) in einem durchgängig angewandten Format und nach einheitlichen Standards übermittelt werden.

(2) Die Bereitstellung von Informationen in einem harmonisierten Format ermöglicht der ESMA eine effiziente Datenerhebung und erleichtert die Kohärenzkontrollen sowie die Bewertung der Vollständigkeit durch die Anleger und die zuständigen Behörden. Daher sollte das Format jedes für eine STS-Meldung auszufüllenden Feldes spezifiziert und sollten alle Informationen an die ESMA elektronisch übermittelt werden.

(3) Diese Verordnung basiert auf den Entwürfen technischer Durchführungsstandards, die der Kommission von der ESMA gemäß Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates ([2]) vorgelegt wurden.

(4) Die ESMA hat zu den Entwürfen technischer Durchführungsstandards, auf denen diese Verordnung basiert, eine offene öffentliche Anhörung durchgeführt, die potenziell anfallenden Kosten und den Nutzen analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Meldebögen für die STS-Meldung

(1) Die in Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission genannten Informationen ([3]) werden unter Verwendung des Musters in Anhang I dieser Verordnung bereitgestellt.

(2) Die in Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe b und Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 genannten Informationen werden unter Verwendung des Musters in Anhang II dieser Verordnung bereitgestellt.

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

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

([3]) Delegierte Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission vom 12. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Spezifizierung der gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung zu übermittelnden Informationen (siehe Seite 285 dieses Amtsblatts).

(3) Die in Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe c und Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 genannten Informationen werden unter Verwendung des Musters in Anhang III dieser Verordnung bereitgestellt.

(4) Sind die nach diesem Artikel bereitzustellenden Informationen wegen der Anwendung der in Artikel 43 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Übergangsbestimmungen nicht verfügbar oder erforderlich, ist im jeweiligen Feld/in den jeweiligen Feldern der Anhänge dieser Verordnung „Entfällt wegen der Anwendung von Übergangsbestimmungen" anzugeben.

(5) Die in diesem Artikel genannten Informationen sind in elektronischer und maschinenlesbarer Form zu übermitteln.

(6) Die in Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 genannten „Zusätzlichen Informationen" sind in das Feld „Auszufüllendes Kästchen" der Anhänge I bis III dieser Verordnung einzufügen.

Artikel 2

Inkrafttreten

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

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

Brüssel, den 12. November 2019

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER

ANHANG I

Feldformate des STS-Meldeformulars

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{LÄNDERCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode nach ISO 3166-1 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{WÄHRUNGSCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungscodes nach ISO 4217 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{DATUMSFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT
{J/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„richtig“ — J „falsch“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI) gemäß ISO 17442

STS-Meldeformular für Nicht-ABCP-Verbriefungen

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS0	Erste Anlaufstelle		{ALPHANUM-1000}
STSS1	Identifikationsnummer des Finanzinstruments		{ISIN}
STSS2	LEI des Originators oder Sponsors oder ursprünglichen Kreditgebers		{LEI}
STSS3	Kennziffer der Meldung		{ALPHANUM-100}
STSS4	Eindeutige Kennung		{ALPHANUM-100}
STSS5	Kennziffer des Prospekts		{ALPHANUM-100}
STSS6	Verbriefungsregister		{ALPHANUM-1000}
STSS7	Bezeichnung der Verbriefung		{ALPHANUM-100}
STSS8	Sitzland		{LÄNDERCODE_2}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS9	Klassifizierung der Verbriefung		{LISTE}
STSS10	Art der zugrunde liegenden Risikopositionen		{LISTE}
STSS11	Ausgabedatum		{DATUMSFORMAT}
STSS12	Meldedatum		{DATUMSFORMAT}
STSS13	Zugelassener Dritter		{ALPHANUM-100}
STSS14	Zugelassener Dritter (Name und Sitzland)		{ALPHANUM-1000} {LÄNDERCODE_2}
STSS15	Zuständige Behörde, die den Dritten zugelassen hat		{ALPHANUM-100}
STSS16	STS-Status		{ALPHANUM-1000}
STSS17	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) kein EU-Kreditinstitut		{J/N}
STSS18	Bestätigung der Kreditvergabekriterien		{ALPHANUM-1000}
STSS19	Erklärung, dass die Kreditvergabekriterien beaufsichtigt werden		{ALPHANUM-1000}
STSS20	Zugrunde liegende Risikopositionen im Wege einer „True-Sale"-Verbriefung erworben		{ALPHANUM-10000}
STSS21	Keine schwerwiegende Rückforderung		{ALPHANUM-10000}
STSS22	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht		{ALPHANUM-1000}
STSS23	Übertragung, wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist		{ALPHANUM-1000}
STSS24	Übertragung im Wege einer Abtretung, die zu einem späteren Zeitpunkt abgeschlossen wird		{ALPHANUM-10000}
STSS25	Zusicherungen und Gewährleistungen		{ALPHANUM-10000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS26	Kriterien für aktive Portfolioverwaltung		{ALPHANUM-10000}
STSS27	Homogenität der Vermögenswerte		{ALPHANUM}
STSS28	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen/keine Wiederverbriefung		{ALPHANUM-1000}
STSS29	Solidität der Vergabestandards		{ALPHANUM}
STSS30	Erfahrung des Originators/ Kreditgebers		{ALPHANUM}
STSS31	Ausgefallene Vermögenswerte		{ALPHANUM}
STSS32	Mindestens eine Zahlung zum Zeitpunkt der Übertragung		{ALPHANUM-1000}
STSS33	Rückzahlung an die Inhaber/Veräußerung von Vermögenswerten		{ALPHANUM}
STSS34	Erfüllung der Anforderung in Bezug auf den Risikoselbstbehalt		{LISTE}
STSS35	Minderung von Zins- (IR-) und Währungs- (FX-)risiken		{ALPHANUM-10000}
STSS36	Derivatekäufe/-verkäufe der Verbriefungszweckgesellschaft		{ALPHANUM-10000}
STSS37	Derivate mit gemeinsamen Standards		{ALPHANUM-10000}
STSS38	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen		{ALPHANUM-10000}
STSS39	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über die vorzeitige Fälligstellung		{ALPHANUM-10000}
STSS40	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS41	Weiterreichung von Tilgungseingängen an die Anleger		{ALPHANUM-1000}
STSS42	Rückzahlung nicht in umgekehrter Reihenfolge zur Seniorität		{ALPHANUM-1000}
STSS43	Keine Bestimmungen, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern		{ALPHANUM-1000}
STSS44	Verbriefungen mit nichtsequentieller Zahlungsrangfolge		{ALPHANUM-1000}
STSS45	Revolvierende Verbriefung mit vorzeitigen Rückzahlungsereignissen für die Beendigung der revolvierenden Periode, basierend auf festgelegten Auslösern		{ALPHANUM-10000}
STSS46	Verschlechterung der Kreditqualität der zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-10000}
STSS47	Insolvenz des Originators oder des Forderungsverwalters		{ALPHANUM-10000}
STSS48	Absinken des Werts der zugrunde liegenden Risikopositionen, die von der Verbriefungszweckgesellschaft gehalten werden, unter einen im Voraus festgelegten Schwellenwert		{ALPHANUM-10000}
STSS49	Nicht hinreichende Generierung neuer zugrunde liegender Risikopositionen, die über die im Voraus festgelegte Kreditqualität verfügen (auslösendes Ereignis für die Beendigung der revolvierenden Periode)		{ALPHANUM-10000}
STSS50	Information über die vertraglichen Verpflichtungen des Forderungsverwalters, des Treuhänders und anderer Anbieter von Nebendienstleistungen		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS51	Bestimmungen zur Kontinuität der Forderungsverwaltung		{ALPHANUM-1000}
STSS52	Bestimmungen zur Kontinuität der Derivatgegenparteien		{ALPHANUM-1000}
STSS53	Bestimmungen zur Kontinuität der Liquiditätsgeber und der kontoführenden Bank		{ALPHANUM-1000}
STSS54	Erforderliche Erfahrung des Forderungsverwalters sowie angemessene Strategien, Verfahren und Kontrollen des Risikomanagements vorhanden		{ALPHANUM}
STSS55	Klare und kohärente Definitionen (Problemkredite)		{ALPHANUM-1000}
STSS56	Zahlungsrangfolgen und auslösende Ereignisse		{ALPHANUM-1000}
STSS57	Zeitnahe Lösung von Konflikten zwischen den verschiedenen Kategorien von Anlegern und Zuständigkeiten der Treuhänder		{ALPHANUM-1000}
STSS58	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste		{ALPHANUM-1000}
STSS59	Externe Überprüfung einer Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-1000}
STSS60	Verfügbarkeit eines Liability-Cashflow-Modells für potenzielle Anleger		{ALPHANUM-1000}
STSS61	Umweltbilanz/Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder -Leasinggeschäfte		{ALPHANUM-10000}
STSS62	Verantwortlichkeit von Originator und Sponsor für die Einhaltung des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}

ANHANG II

Feldformate des STS-Meldeformulars

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{LÄNDERCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode nach ISO 3166-1 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{WÄHRUNGSCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungscodes nach ISO 4217 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{DATUMSFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT
{J/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„richtig“ — J „falsch“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI) gemäß ISO 17442

STS-Meldeformular für ABCP-Verbriefungen

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT0	Erste Anlaufstelle		{ALPHANUM-1000}
STSAT1	Identifikationsnummer des Finanzinstruments		{ISIN}
STSAT2	LEI des Originators oder Sponsors oder ursprünglichen Kreditgebers		{LEI}
STSAT3	Kennziffer der Meldung		{ALPHANUM-100}
STSAT4	Eindeutige Kennung		{ALPHANUM-100}
STSAT5	Kennziffer des Prospekts		{ALPHANUM-100}
STSAT6	Verbriefungsregister		{ALPHANUM-1000}
STSAT7	Bezeichnung der Verbriefung		{ALPHANUM-100}
STSAT8	Sitzland		{ALPHANUM-1000}
STSAT9	Verbriefungsart		{LISTE}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT10	Art der zugrunde liegenden Risikopositionen		{LISTE}
STSAT11	Ausgabedatum		{DATUMSFORMAT}
STSAT12	Meldedatum		{DATUMSFORMAT}
STSAT13	Zugelassener Dritter		{ALPHANUM-100}
STSAT14	Zugelassener Dritter (Name und Sitzland)		{ALPHANUM-1000} {LÄNDERCODE_2}
STSAT15	Zuständige Behörde, die den Dritten zugelassen hat		{ALPHANUM-100}
STSAT16	STS-Status		{ALPHANUM-1000}
STSAT17	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) kein EU-Kreditinstitut		{J/N}
STSAT18	Bestätigung der Kreditvergabekriterien		{ALPHANUM-1000}
STSAT19	Erklärung, dass die Kreditvergabekriterien beaufsichtigt werden		{ALPHANUM-1000}
STSAT20	Zugrunde liegende Risikopositionen im Wege einer „True-Sale"-Verbriefung erworben		{ALPHANUM-10000}
STSAT21	Keine schwerwiegende Rückforderung		{ALPHANUM-10000}
STSAT22	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht		{ALPHANUM-1000}
STSAT23	Übertragung, wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist		{ALPHANUM-1000}
STSAT24	Übertragung im Wege einer Abtretung, die zu einem späteren Zeitpunkt abgeschlossen wird		{ALPHANUM-10000}
STSAT25	Zusicherungen und Gewährleistungen		{ALPHANUM-10000}
STSAT26	Kriterien für aktive Portfolioverwaltung		{ALPHANUM-10000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT27	Keine Wiederverbriefung		{ALPHANUM-1000}
STSAT28	Übertragene zugrunde liegende Risikopositionen umfassen keine ausgefallenen Risikopositionen		{ALPHANUM}
STSAT29	Mindestens eine geleistete Zahlung zum Zeitpunkt der Übertragung		{ALPHANUM-1000}
STSAT30	Rückzahlung an die Inhaber/Veräußerung von Vermögenswerten		{ALPHANUM}
STSAT31	Minderung von Zins- (IR-) und Währungs- (FX-)risiken		{ALPHANUM-10000}
STSAT32	Derivatekäufe/-verkäufe der Verbriefungszweckgesellschaft		{ALPHANUM-10000}
STSAT33	Derivate in den zugrunde liegenden Risiko-positionen		{ALPHANUM-10000}
STSAT34	Derivate mit gemeinsamen Standards		{ALPHANUM-10000}
STSAT35	Klare und kohärente Definitionen für den Umgang mit Problemkrediten		{ALPHANUM-1000}
STSAT36	Zahlungsrangfolgen und auslösende Ereignisse		{ALPHANUM-1000}
STSAT37	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste		{ALPHANUM-1000}
STSAT38	Homogenität der Vermögenswerte		{ALPHANUM}
STSAT39	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-1000}
STSAT40	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-1000}
STSAT41	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen		{ALPHANUM-10000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT42	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über die vorzeitige Fälligstellung		{ALPHANUM-10000}
STSAT43	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen/Beitreibung oder vorzeitige Fälligstellung		{ALPHANUM-1000}
STSAT44	Weiterreichung von Tilgungseingängen an die Anleger		{ALPHANUM-1000}
STSAT45	Keine Bestimmungen, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern		{ALPHANUM-1000}
STSAT46	Solidität der Vergabestandards		{ALPHANUM}
STSAT47	Erfahrung des Verkäufers		{ALPHANUM}
STSAT48	Revolvierende ABCP-Transaktion/auslösendes Ereignis Kreditqualität		{ALPHANUM}
STSAT49	Aufgaben der an der Verbriefung Beteiligten		{ALPHANUM-1000}
STSAT50	Bestimmungen zur Kontinuität der Forderungsverwaltung		{ALPHANUM-1000}
STSAT51	Bestimmungen zur Kontinuität der Derivatgegenpartei und der kontoführenden Bank		{ALPHANUM-1000}
STSAT52	Solidität des Sponsors		{ALPHANUM-1000}

ANHANG III

Feldformate des STS-Meldeformulars

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{LÄNDERCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode nach ISO 3166-1 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{WÄHRUNGSCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungscodes nach ISO 4217 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{DATUMSFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT
{J/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„richtig“ — J „falsch“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI) gemäß ISO 17442

STS-Meldeformular für das ABCP-Programm

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP0	Erste Anlaufstelle		{ALPHANUM-1000}
STSAP1	Identifikationsnummer des Finanzinstruments		{ISIN}
STSAP2	LEI des Sponsors		{LEI}
STSAP3	Kennziffer der Meldung		{ALPHANUM-100}
STSAP4	Eindeutige Kennung		{ALPHANUM-100}
STSAP5	Kennziffer des Prospekts		{ALPHANUM-100}
STSAP6	Verbriefungsregister		{ALPHANUM-1000}
STSAP7	Bezeichnung des ABCP-Programms		{ALPHANUM-100}
STSAP8	Sitzland		{ALPHANUM-1000}
STSAP9	Klassifizierung des Instruments		{LISTE}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP10	Ausgabedatum		{DATUMSFORMAT}
STSAP11	Meldedatum		{DATUMSFORMAT}
STSAP12	Zugelassener Dritter		{ALPHANUM-100}
STSAP13	Zugelassener Dritter (Name und Sitzland)		{ALPHANUM-1000} {LÄNDERCODE_2}
STSAP14	Zuständige Behörde, die den Dritten zugelassen hat		{ALPHANUM-100}
STSAP15	STS-Status		{ALPHANUM-1000}
STSAP16	Sponsor muss beaufsichtigtes Kreditinstitut sein		{ALPHANUM-1000}
STSAP17	Unterstützung durch den Sponsor als Bereitsteller von Liquiditätsfazilitäten		{ALPHANUM-1000}
STSAP18	Nachweis, den das Kreditinstitut gegenüber seiner zuständigen Behörde zu erbringen hat		{ALPHANUM-1000}
STSAP19	Erfüllung der Prüf- und Sorgfaltspflichten des Sponsors		{ALPHANUM-1000}
STSAP20	Einhaltung der Risiko-selbstbehalt-Anforderungen (Transaktionsebene/Programmebene)		{LISTE}
STSAP21	Einhaltung von Artikel 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 auf der Ebene des ABCP-Programms		{ALPHANUM-1000}
STSAP22	Inanspruchnahme von Liquidität für den Fall, dass die Liquiditätsfazilität nicht erneuert wird		{ALPHANUM-10000}
STSAP23	Konformität der ABCP-Transaktionen im Rahmen eines ABCP-Programms mit Artikel 24 Absätze 1 bis 8 und 12 bis 20 der Verordnung (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP24	Höchstens 5 % des Gesamtbetrags der zugrunde liegenden Risikopositionen temporär nicht konform		{ALPHANUM}
STSAP25	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAL) höchstens zwei Jahre		{ALPHANUM-1000}
STSAP26	Vollständig unterstütztes ABCP-Programm (Sponsorenunterstützung)		{ALPHANUM-10000}
STSAP27	Keine Wiederverbriefung und keine Bonitätsverbesserung, die eine zweite Tranchierungsebene beim ABCP-Programm schafft		{ALPHANUM-1000}
STSAP28	Keine Kaufoptionen		{ALPHANUM-1000}
STSAP29	Zins- und Währungsrisiken auf ABCP-Programmebene in geeigneter Weise gemindert und dokumentiert		{ALPHANUM}
STSAP30	Anforderungen an ABCP-Programmunterlagen (Zuständigkeiten des Treuhänders gegenüber den Anlegern)		{ALPHANUM-1000}
STSAP31	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (vertragliche Verpflichtungen des Sponsors)		{ALPHANUM-1000}
STSAP32	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Verfahren und Zuständigkeiten bei Ausfall des Forderungsverwalters)		{ALPHANUM-1000}
STSAP33	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Bestimmungen über den Ersatz von Derivatgegenparteien und der kontoführenden Bank)		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP34	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Verfahren zur Gewährleistung der Besicherung der Finanzierungszusage)		{ALPHANUM-1000}
STSAP35	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Liquiditätsfazilität und Rückzahlung fällig werdender Wertpapiere, falls der Sponsor die Finanzierungszusage für die Liquiditätsfazilität vor deren Ablauf nicht erneuert)		{ALPHANUM-1000}
STSAP36	Erfahrung des Forderungsverwalters		{ALPHANUM}