

NAŘÍZENÍ KOMISE V PŘENESENÉ PRÁVOMOCI (EU) 2020/1229**ze dne 29. listopadu 2019,****kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2017/2402, pokud jde o regulační technické normy týkající se provozních norem registrů sekuritizací pro shromažďování, seskupování, porovnávání a ověřování údajů, přístup k údajům a ověřování úplnosti a správnosti****(Text s významem pro EHP)**

EVROPSKÁ KOMISE,

s ohledem na Smlouvu o fungování Evropské unie,

s ohledem na nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2017/2402 ze dne 12. prosince 2017, kterým se stanoví obecný rámec pro sekuritizaci a vytváří se zvláštní rámec pro jednoduchou, transparentní a standardizovanou sekuritizaci a kterým se mění směrnice 2009/65/ES, 2009/138/ES, 2011/61/EU a nařízení (ES) č. 1060/2009 a (EU) č. 648/2012⁽¹⁾, a zejména na čl. 10 odst. 7 písm. a) a čl. 17 odst. 2 písm. b), c) a d) uvedeného nařízení,

vzhledem k těmto důvodům:

- (1) Subjekty uvedené v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 by měly mít možnost vykonávat své příslušné pravomoci, pověření a povinnosti. Informace, které těmto subjektům poskytují registry sekuritizací, by proto měly být vysoce kvalitní a měly by zajišťovat možnost včasným, strukturovaným a uceleným způsobem seskupovat a porovnávat informace mezi jednotlivými registry sekuritizací. Registry sekuritizací by proto měly posoudit, zda jsou tyto informace úplné a správné, nežli je uvedeným subjektům zpřístupní, a měly by těmto subjektům poskytovat zprávu ke konci dne a celkové bodové hodnocení úplnosti údajů.
- (2) Postupy pro ověření toho, zda jsou informace, které registrům sekuritizací vykazují původci, sponzoři nebo sekuritizační jednotky, úplné a správné, by měly zohledňovat rozmanitost druhů, rysů a postupů sekuritizací. Je proto vhodné stanovit postupy ověřování, které zahrnují srovnání informací vykázaných v souvislosti s podobnými sekuritizacemi, jako jsou sekuritizace s tímž nebo spřízněným původcem, druhem podkladové expozice, strukturálním rysem nebo zeměpisným rozsahem.
- (3) Aby byla zajištěna kvalita vykazovaných informací, měly by se ověřovací postupy používat i s ohledem na úplnost a správnost dokumentace, která tyto informace dokládá. Vzhledem k relativní obtížnosti ověřování úplnosti a správnosti této dokumentace by však registry sekuritizací měly požadovat, aby vykazující subjekty písemně potvrdily, že podkladová sekuritizační dokumentace, kterou tyto subjekty zpřístupňují, je úplná a správná. Významné aktualizace již předložené dokumentace by měly být považovány za nový sekuritizační dokument, který vyžaduje žádost o písemné potvrzení.
- (4) Aby mohly subjekty uvedené v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 vykonávat své příslušné pravomoci, pověření a povinnosti, měly by být podrobné údaje o sekuritizacích, k nimž musí mít tyto subjekty přímý a bezprostřední přístup, harmonizovaným a jednotným způsobem navzájem srovnatelné mezi registry sekuritizací. Tyto údaje by proto měly být poskytnuty ve formátu Extensible Markup Language (XML), neboť tento formát je ve finančním odvětví běžně používán.
- (5) Měla by být zajištěna důvěrnost veškerých druhů údajů vyměňovaných mezi registry sekuritizací a subjekty uvedenými v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402. Tyto výměny by se proto měly uskutečňovat prostřednictvím zabezpečeného spojení mezi stroji a s použitím protokolů pro šifrování údajů. Pro zajištění minimálních společných norem by měl být použit protokol SFTP (SSH File Transfer Protocol).

(1) Úř. věst. L 347, 28.12.2017, s. 35.

- (6) Údaje týkající se nejnovějších sekuritizačních podkladových expozic, zpráv pro investory, vnitřních informací a informací o významných událostech, jakož i ukazatele kvality a včasnosti těchto údajů jsou zásadní pro průběžné sledování sekuritizačních investičních pozic a potenciálních investic, jakož i finanční stability a systémového rizika. Subjekty uvedené v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 by proto měly mít přístup k těmto údajům ad hoc, nebo předem stanoveným pravidelným způsobem, a to úměrně svým potřebám týkajícím se získání těchto údajů.
- (7) Sekuritizace jsou složité a nesourodé a uživatelé, kteří mají přístup k informacím z registrů sekuritizací, jsou různorodí. Je proto nezbytné usnadnit přímý a bezprostřední přístup ke zvláštním souborům dat a informacím. Tento přístup by měl zahrnovat přístup ve strojově čitelném formátu, pokud se informace týkají údajů a všech aktuálních i historických informací o sekuritizaci uložených v registru. Za tímto účelem je třeba vytvořit rámec pro žádosti ad hoc, které lze kombinovat za účelem získání specifických informací. Lhůty, v nichž by registry sekuritizací měly poskytovat údaje subjektům uvedeným v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402, by měly být harmonizovány s cílem usnadnit efektivní zpracování údajů těmito subjekty a registry sekuritizací. Zároveň by mělo být zajištěno, aby byly údaje získávány ve lhůtách umožňujících účinné plnění povinností dožadujících subjektů.
- (8) Subjekty uvedené v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 se spoléhají na údaje uchovávané v registrech sekuritizací, a to i pro účely srovnávání stávajících sekuritizací s minulými sekuritizacemi. Je proto vhodné upřesnit, že registry by podle čl. 10 odst. 2 nařízení (EU) 2017/2402 a čl. 80 odst. 3 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 ⁽²⁾ měly uchovávat záznamy o sekuritizaci po dobu deseti let od ukončení sekuritizace.
- (9) Ustanovení tohoto nařízení jsou úzce propojena, neboť se týkají norem a postupů souvisejících se shromažďováním a zpracováváním informací uchovávaných registry sekuritizací a s přístupem k těmto informacím. Je proto vhodné začlenit tato ustanovení do jediného nařízení.
- (10) Toto nařízení vychází z návrhů regulačních technických norem, jež Komisi předložil Evropský orgán pro cenné papíry a trhy (ESMA).
- (11) Orgán ESMA uskutečnil otevřenou veřejnou konzultaci o návrzích regulačních technických norem, z nichž toto nařízení vychází, analyzoval potenciální související náklady a přínosy a požádal o stanovisko skupinu subjektů působících v oblasti cenných papírů a trhů zřízenou podle článku 37 nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ⁽³⁾,

PŘIJALA TOTO NAŘÍZENÍ:

Článek 1

Definice

Pro účely tohoto nařízení se rozumí:

- a) „vykazujícím subjektem“ subjekt určený v souladu s čl. 7 odst. 2 nařízení (EU) 2017/2402;
- b) „dnem uzávěrky shromažďování údajů“ referenční datum informací vykazovaných v souladu s nařízením Komise v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224 ⁽⁴⁾.

⁽²⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 648/2012 ze dne 4. července 2012 o OTC derivátech, ústředních protistranách a registrech obchodních údajů (Úř. věst. L 201, 27.7.2012, s. 1).

⁽³⁾ Nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) č. 1095/2010 ze dne 24. listopadu 2010 o zřízení Evropského orgánu dohledu (Evropského orgánu pro cenné papíry a trhy), o změně rozhodnutí č. 716/2009/ES a o zrušení rozhodnutí Komise 2009/77/ES (Úř. věst. L 331, 15.12.2010, s. 84).

⁽⁴⁾ Nařízení Komise v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224 ze dne 16. října 2019, kterým se doplňuje nařízení Evropského parlamentu a Rady (EU) 2017/2402, pokud jde o regulační technické normy upřeshňující informace a podrobnosti o sekuritizaci, které má poskytnout původce, sponzor a sekuritizační jednotka (viz strana 1 v tomto čísle Úředního věstníku).

Článek 2

Zpráva ke konci dne

1. Registry sekuritizací denně pro všechny sekuritizace vypracují jednu souhrnnou zprávu ke konci dne za všechny sekuritizace, které jim byly vykázaný, vyjma jakékoli vykázané sekuritizace, která byla zamítnuta v souladu s čl. 4 odst. 6. Tato zpráva musí vycházet z nejnověji vykázaných informací, musí vyloučit jakoukoli vykázanou sekuritizaci, která byla zamítnuta v souladu s čl. 4 odst. 6, a musí obsahovat alespoň tyto informace:

- a) jedinečný identifikační kód přidělený v souladu s článkem XI nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;
- b) kódy ISIN tranší, dluhopisů nebo podřízených úvěrů v sekuritizaci, jsou-li k dispozici;
- c) součet stávajících zůstatků jistiny všech tranší, dluhopisů nebo podřízených úvěrů v sekuritizaci, v eurech, za použití směnných kurzů zveřejněných na webových stránkách Evropské centrální banky za předchozí za předcházející pracovní den;
- d) název sekuritizace;
- e) zda je sekuritizace sekuritizací komerčních papírů zajištěných aktivy, nebo sekuritizací odlišnou od komerčních papírů zajištěných aktivy;
- f) zda je druhem struktury sekuritizace druh „M“ pro hlavní svěřenský fond vykázaný v poli SESS9 přílohy XIV nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224, nebo druh „S“ pro všechny ostatní sekuritizace;
- g) zda je metoda převodu rizika sekuritizace „T“ pro skutečný prodej vykázaný v poli IVSS11 přílohy XII nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224, nebo „S“ pro syntetickou sekuritizaci vykázanou v poli SESV11 přílohy XIV uvedeného nařízení, nebo „ABCP“ pro sekuritizace komerčních papírů zajištěných aktivy;
- h) název a identifikační kód právnické osoby („LEI“) původce, sponzora a sekuritizační jednotky;
- i) datum poslední splátky úroku v datovém formátu podle ISO 8601;
- j) časové razítko posledního předložení údajů obdrženého registrem sekuritizací, které je uvedeno ve formátu data a času podle ISO 8601 (UCT) a s přesností na nejbližší sekundu, nebo v případě, že existuje více předložení údajů, na která se odkazuje k těmž dni uzávěrky shromažďování údajů, časová razítka ve formátu data a času podle ISO 8601 (UCT) prvního a posledního předložení údajů s týmž dnem uzávěrky shromažďování údajů;
- k) den uzávěrky shromažďování údajů posledního předložení údajů, které registr sekuritizací obdržel, ve formátu data podle ISO 8601;
- l) počet předložení údajů, která registr sekuritizací obdržel a na která se odkazuje k těmž dni uzávěrky shromažďování údajů podle písmene k);
- m) bodové hodnocení úplnosti údajů posledního předložení údajů, které registr sekuritizací obdržel, podle článku 3;
- n) u sekuritizací odlišných od komerčních papírů zajištěných aktivy země usazení původce nebo původního věřitele;
- o) u sekuritizací komerčních papírů zajištěných aktivy země usazení sponzora;
- p) země, kde se nachází většina podkladových expozic z hlediska stávajícího zůstatku jistiny podkladové expozice;
- q) převažující druh podkladových expozic v sekuritizaci z hlediska stávajícího zůstatku jistiny.
- r) Pro účely písmene n) platí, že pokud jsou podkladové expozice dané sekuritizace kombinací expozic od více původců nebo původních věřitelů, je zemí usazení původce nebo původního věřitele země původce nebo původního věřitele, který má v sekuritizaci největší objem expozic z hlediska stávajícího zůstatku jistiny.

2. Registry sekuritizací zpřístupní zprávu ke konci dne k dispozici ve formátu XML.

3. Časová razítka uvedená v tomto článku se nesmí odchylovat o více než jednu sekundu od koordinovaného světového času (UTC) vydaného a vedeného jedním z časových center uvedených v poslední výroční zprávě o činnostech týkajících se času Mezinárodního úřadu pro míry a váhy (BIPM).

Článek 3

Bodové hodnocení úplnosti údajů

4. Registry sekuritizací vypočítají pro každé předložení údajů bodové hodnocení úplnosti údajů pomocí matice bodového hodnocení uvedené v tabulce 1 přílohy a následujících vstupních údajů:

$$\text{Input 1} = \frac{\sum_i^N ND1}{N}$$

$$\text{Input 2} = \frac{\sum_i^N ND2 + \sum_i^N ND3 + \sum_i^N ND4}{N}$$

kde:

$\sum_i^N NDx$ označuje celkový počet polí v předložení údajů obsahujících příslušné zástupné položky „no data“ vykázané

podle čl. 9 odst. 3 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224.

Noznačuje celkový počet polí v předložení údajů, v nichž je povoleno vykázat jakékoli zástupné položky „no data“ (ND1 až ND4) v souladu s čl. 9 odst. 3 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224.

Pro účely výpočtu bodového hodnocení úplnosti údajů se pole vyplněná za použití formátu „ND4-YYYY-MM-DD“ vykládají jako „ND4“.

Článek 4

Ověřování úplnosti a správnosti informací

1. Registry sekuritizací ověří úplnost a správnost informací, které jsou jim vykázané, a to ověřením:

- a) názvu vykazujícího subjektu, který je uveden v poli IVSS4 přílohy XII nebo v poli IVAS3 přílohy XIII nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;
- b) správnosti kódu položky předložení údajů uvedeného v tabulce 3 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224.

2. Pokud jde o informace uvedené v čl. 7 odst. 1 písm. a), e), f) a g) nařízení (EU) 2017/2402, registry sekuritizací ověří rovněž úplnost a správnost informací, a to:

- a) ověřením toho, že vykázané informace odpovídají struktuře a formátu šablon stanovených v přílohách II až XV prováděcího nařízení Komise (EU) 2020/1225 ⁽ⁱ⁾;
- b) porovnáním vykázaných informací:
 - i) mezi různými poli pro tentýž den uzávěrky shromažďování údajů a tutěž podkladovou expozici, zprávu pro investory, tytéž vnitřní informace nebo informace o významných událostech;
 - ii) mezi různými podkladovými expozicemi, zprávami pro investory, vnitřními informacemi nebo informacemi o významných událostech pro tutěž oblast a tentýž den uzávěrky shromažďování údajů;
 - iii) v rámci téže podkladové expozice, zprávy pro investory, vnitřních informací nebo informací o významných událostech pro totéž pole a různé dny uzávěrky shromažďování údajů;
 - iv) mezi podobnými sekuritizacemi;

⁽ⁱ⁾ Prováděcí nařízení Komise (EU) 2020/1225 ze dne 29. října 2019, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o formát a standardizované šablony pro poskytování informací a podrobnosti o sekuritizaci původcem, sponzorem a sekuritizační jednotkou (viz strana 217 v tomto čísle Úředního věstníku).

- c) ověřením toho, že den uzávěrky shromažďování údajů u vykázaných informací a časové razítko předložení údajů je v souladu s článkem 10 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;
- d) ověřením toho, že „zástupné položky „no data“ “ podle čl. 9 odst. 3 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224 se používají pouze v povolených případech a nebrání tomu, aby bylo předložení údajů dostatečně reprezentativní, pokud jde o podkladové expozice v sekuritizaci.

U sekuritizací komerčních papírů zajištěných aktivy se odkazy na podkladové expozice v tomto odstavci považují za odkazy na druhy podkladových expozic.

3. Registry sekuritizací ověří úplnost a správnost dokumentace, která je jim zpřístupněna podle čl. 7 odst. 1 písm. b) nařízení (EU) 2017/2402, a to tak, že si od vykazujících subjektů vyžádají písemné potvrzení následujících skutečností:

- a) registru sekuritizací byly předloženy všechny položky uvedené v tabulce 3 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224, které musí být zpřístupněny podle čl. 7 odst. 1 písm. b) nařízení (EU) 2017/2402;
- b) dokumentace je v souladu se skutečnými dohodami a rysy sekuritizace.

4. Písemné potvrzení podle odstavce 3 bude vyžádáno v těchto lhůtách:

- a) do pěti pracovních dnů od první emise cenných papírů v rámci dané sekuritizace nebo v případě sekuritizací obchodních cenných papírů zajištěných aktivy do pěti pracovních dnů od první emise cenných papírů v rámci programu ABCP;
- b) každých dvanáct měsíců od dat žádostí podle písmene a);
- c) do pěti pracovních dnů od zpřístupnění nového dokumentu podle čl. 7 odst. 1 písm. b) nařízení (EU) 2017/2402.

Registr sekuritizací, který neobdržel písemné potvrzení do čtrnácti dnů od data jakékoli žádosti podle prvního pododstavce, požádá vykazující subjekt, aby mu písemné potvrzení do čtrnácti dnů předložil.

5. Registry sekuritizací ověří, zda oznámení STS sekuritizace podle čl. 7 odst. 1 písm. d) nařízení (EU) 2017/2402, které bylo tomuto registru sekuritizací zpřístupněno, vyhovuje struktuře a formátu šablon uvedených v přílohách prováděcího nařízení Komise (EU) 2020/1227 ⁽⁶⁾.

6. Registr sekuritizací zamítne předložení informací, které jsou neúplné nebo nesprávné podle odstavců 1, 2 a 5, vyjma odst. 2 písm. b) bodů iii) a iv). Registr sekuritizací zařadí předložení údajů zamítnutá podle tohoto odstavce do jedné z kategorií zamítnutí uvedených v tabulce 2 přílohy.

7. Registr sekuritizací oznámí subjektům uvedeným v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 bez zbytečného odkladu:

- a) že předložené informace jsou neúplné nebo nesprávné podle odst. 2 písm. b) bodů iii) a iv);
- b) že registr sekuritizací neobdržel písemné potvrzení podle odstavce 3.

8. Do jedné hodiny od obdržení informací uvedených v článku 7 nařízení (EU) 2017/2402 poskytnou registry sekuritizací vykazujícím subjektům podrobnou zpětnou vazbu týkající se výsledků ověření provedených podle odstavců 1, 2, 3 a 5, včetně případné kategorie zamítnutí přidělené podle odstavce 6. Tato zpětná vazba musí obsahovat alespoň:

- a) jedinečný identifikační kód sekuritizace přidělený v souladu s článkem 11 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;

⁽⁶⁾ Prováděcí nařízení Komise (EU) 2020/1227 ze dne 12. listopadu 2019, kterým se stanoví prováděcí technické normy, pokud jde o šablony pro poskytování informací v souladu s požadavky na oznámení STS sekuritizace (viz strana 315 v tomto čísle Úředního věstníku).

- b) kód(y) položky(ek) podle tabulky 3 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;
 - c) časové razítko předložení vykázaných informací ve formátu data a času podle ISO 8601 (UCT) s přesností na nejbližší sekundu.
9. V každé pondělí do 19:00:00 UTC vypracují registry sekuritizací zprávu o všech informacích, které zamítly od 19:00:00 UTC předchozího pondělí. Tato zpráva musí obsahovat alespoň následující položky:
- a) jedinečný identifikační kód sekuritizace přidělený v souladu s článkem 11 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;
 - b) název sekuritizace;
 - c) kódy ISIN tranší, dluhopisů nebo podřízených úvěrů v sekuritizaci, jsou-li k dispozici;
 - d) název a identifikační kód právnické osoby původce, sponzora a sekuritizační jednotky;
 - e) časové razítko předložených informací ve formátu data a času podle ISO 8601 (UCT) s přesností na nejbližší sekundu;
 - f) kód položky předložení údajů podle tabulky 3 přílohy I nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224;
 - g) kategorie zamítnutí podle tabulky 2 přílohy tohoto nařízení a zvláštní okolnosti pro zařazení do této kategorie zamítnutí;
 - h) případné(á) vysvětlení poskytnuté(á) vykazujícím subjektem do 17:00:00 UTC v pondělí ke dni zveřejnění zprávy ohledně toho, proč jsou vykázané informace neúplné nebo nesprávné nebo proč nebylo předloženo písemné potvrzení podle odstavce 3.

Článek 5

Podrobnosti informací, k nimž má být poskytnut přístup

Podrobnosti informací podle čl. 17 odst. 2 písm. c) nařízení (EU) 2017/2402 jsou následující:

- a) veškeré informace, které registr sekuritizací obdrží od vykazujících subjektů v souladu s nařízením (EU) 2017/2402;
- b) zpráva ke konci dne podle článku 2, bodové hodnocení úplnosti údajů podle článku 3 a veškeré informace vyplývající z ověření provedených podle článku 4 tohoto nařízení;
- c) všechny vzorce a metody výpočtu a agregace používané k vypracování informací podle písmen a) a b).

Článek 6

Podmínky přístupu k podrobnostem informací

1. Přístup k informacím podle článku 5 se poskytuje na požádání. Žádost o udělení přístupu musí uvádět:
 - a) název dožadujícího subjektu;
 - b) kontaktní osobu dožadujícího subjektu;
 - c) typ subjektu, který žádá o přístup, podle čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402;
 - d) jména osob v dožadujícím subjektu, které budou mít přístup k požadovaným informacím;
 - e) pověřovací dokumenty pro zabezpečené připojení s použitím protokolu SFTP, které požaduje čl. 7 odst. 2;
 - f) zda se jedná o žádost ad hoc, nebo předem definovanou pravidelnou žádost;

- g) identifikaci požadovaných informací na základě jakékoli kombinace kritérií podle odstavce 4;
- h) další technické informace relevantní pro přístup dožadujícího subjektu.

2. Pro účely odstavce 1 registry sekuritizací:

- a) určí osobu nebo osoby odpovědné za udržování kontaktu se subjekty uvedenými v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402;
- b) zveřejní na svých webových stránkách podmínky přístupu k informacím a pokyny k podání žádosti o přístup k těmto informacím;
- c) poskytnou přístup pouze k informacím uvedeným v žádosti o přístup;
- d) co nejdříve, nejpozději však do 30 dnů od žádosti o přístup k informacím, stanoví technická opatření nezbytná k tomu, aby subjekty uvedené v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 mohly předkládat žádosti o přístup k těmto informacím.

3. Přístup k informacím podle článku 5 se poskytuje v těchto lhůtách:

- a) nejpozději do 19:00:00 UTC dne, k němuž se zpráva vztahuje, v případě žádosti ad hoc nebo předem definované pravidelné žádosti o zprávu ke konci dne podle článku 2;
- b) nejpozději do 12:00:00 UTC prvního dne po dni obdržení žádosti o přístup, pokud se informace týkají sekuritizace, která dosud není oceněna nebo dosud není splatná nebo u níž nastala splatnost méně než jeden rok před datem podání žádosti;
- c) nejpozději do tří pracovních dnů ode dne obdržení žádosti o přístup, pokud se informace týkají sekuritizace, u níž nastala splatnost déle než jeden rok před datem podání žádosti;
- d) nejpozději do tří pracovních dnů ode dne obdržení žádosti o přístup, pokud se informace týkají několika sekuritizací, na něž se vztahuje písmeno b) i písmeno c).

4. Registry sekuritizací poskytnou subjektům uvedeným v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 přístup k informacím uvedeným v článku 5 na základě jakékoli kombinace těchto kritérií:

- a) druh sekuritizace: sekuritizace odlišná od komerčních papírů zajištěných aktivy, nebo sekuritizace komerčních papírů zajištěných aktivy;
- b) druh struktury sekuritizace: uveďte buď „M“ pro hlavní svěřenský fond vykázaný v poli SESS9 přílohy XIV nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224, nebo „S“ pro všechny ostatní sekuritizace;
- c) metoda převodu rizika sekuritizace: uveďte buď „Y“ pro skutečný prodej vykázaný v poli IVSS11 v příloze XII nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224, nebo „Y“ pro syntetickou sekuritizaci vykázanou v poli SESV11 v příloze XIV uvedeného nařízení, nebo „ABCP“ pro sekuritizace komerčních papírů zajištěných aktivy;
- d) kód položky sekuritizace;
- e) druh podkladové expozice sekuritizace;
- f) oddíl podkladové expozice sekuritizace;
- g) oddíl šablony zprávy pro investory do sekuritizace;
- h) oddíl šablony vnitřních informací o sekuritizaci nebo informací o významných událostech;
- i) identifikační kód:
 - i) jedinečný identifikační kód;
 - ii) identifikační kód transakce;
 - iii) mezinárodní identifikační číslo cenného papíru;

- iv) nový nebo původní identifikační kód tranše/dluhopisu;
 - v) nový nebo původní identifikační kód podkladové expozice;
 - vi) nový nebo původní identifikační kód dlužníka;
 - vii) identifikační kód právnické osoby původce;
 - viii) identifikační kód právnické osoby sponzora;
 - ix) identifikační kód právnické osoby sekuritizační jednotky;
 - x) původní identifikační kód právnické osoby věřitele;
 - xi) identifikační kód právnické osoby manažera zajištěného úvěrového závazku;
 - j) zeměpisný rozsah:
 - i) zeměpisný region;
 - ii) rozhodné právo;
 - k) datum a čas:
 - i) časové razítko předložení údajů;
 - ii) den uzávěrky shromažďování údajů;
 - iii) datum emise tranše/dluhopisu;
 - iv) závazná splatnost tranše/dluhopisu;
 - v) datum vzniku podkladové expozice;
 - vi) datum splatnosti podkladové expozice;
 - l) měna:
 - i) měna tranše/dluhopisu;
 - ii) denominace měny podkladové expozice.
5. Registry sekuritizací zpřístupní ve formátu XML tyto informace:
- a) informace podle čl. 7 odst. 1 písm. a) a d) až g) nařízení (EU) 2017/2402;
 - b) informace vypracované registry sekuritizací v souladu s články 2 a 4 tohoto nařízení, s výjimkou písemných potvrzení obdržených podle čl. 4 odst. 3.

Článek 7

Normy pro shromažďování údajů a přístup k nim

1. Pro příjem údajů od vykazujících subjektů nebo jiných registrů sekuritizací a pro předávání údajů subjektům uvedeným v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402 používají registry sekuritizací protokoly pro elektronický podpis a šifrování údajů.
2. Pro účely odstavce 1 registry sekuritizací zřídí a budou udržovat zabezpečené rozhraní mezi stroji a zpřístupní toto rozhraní vykazujícím subjektům a subjektům uvedeným v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402. Toto rozhraní musí používat protokol SFTP.
3. Registry sekuritizací používají ke komunikaci prostřednictvím rozhraní uvedeného v odstavci 2 standardizované zprávy ve formátu XML a zpřístupňují informace stanovené v čl. 6 odst. 5 tohoto nařízení subjektům uvedeným v čl. 17 odst. 1 nařízení (EU) 2017/2402.

*Článek 8***Vedení záznamů**

1. Registry sekuritizací zaznamenají:
 - a) ověření podle tohoto nařízení a jakoukoli jinou validaci provedenou registrem sekuritizací;
 - b) písemná potvrzení, která registr sekuritizací obdrží podle čl. 4 odst. 3;
 - c) výsledky, které registr sekuritizací poskytne vykazujícímu subjektu podle čl. 4 odst. 6;
 - d) případné vysvětlení ze strany vykazujícího subjektu, proč jsou předložené informace neúplné nebo nesprávné nebo proč neexistuje písemné potvrzení podle čl. 4 odst. 7;
 - e) v protokolu o vykazování podrobné údaje o veškerých opravách nebo zrušeních předložených vykazujícím subjektem;
 - f) jakékoli jiné informace vypracované nebo předložené podle tohoto nařízení.
2. Každý záznam se uchovává po dobu deseti let od ukončení sekuritizace, k níž se záznam vztahuje.
3. Protokol o vykazování podle odst. 1 písm. d) zahrnuje jedinečný identifikační kód sekuritizace, kód položky, časové razítko dotčeného předložení údajů, časové razítko změn a jasný popis změn předložených informací, včetně předchozího a nového obsahu těchto informací.

*Článek 9***Vstup v platnost**

Toto nařízení vstupuje v platnost dvacátým dnem po vyhlášení v *Úředním věstníku Evropské unie*.

Toto nařízení je závazné v celém rozsahu a přímo použitelné ve všech členských státech.

V Bruselu dne 29. listopadu 2019.

Za Komisi
předseda
Jean-Claude JUNKER

PŘÍLOHA

Matice bodového hodnocení úplnosti údajů a kategorie zamítnutí

Tabulka 1

Matice bodového hodnocení úplnost údajů

		Vstupní údaj 1: Procentní podíl polí vykázaných jako „ND1“			
		Vstupní údaj 1 = 0 %	0 % < vstupní údaj 1 ≤ 10 %	10 % < vstupní údaj 1 ≤ 30 %	Vstupní údaj 1 > 30 %
Vstupní údaj 2: Procentní podíl polí vykázaných jako „ND2“, „ND3“ nebo „ND4-RRRR-MM-DD“	Vstupní údaj 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < vstupní údaj 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < vstupní údaj 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	Vstupní údaj 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabulka 2

Kategorie zamítnutí

Kategorie zamítnutí	Důvod
Schéma	Předložení informací bylo zamítnuto z důvodu nevyhovujícího schématu.
Povolení	Předložení informací bylo zamítnuto, protože vykazující subjekt nezískal povolení vykazovat informace jménem původce, sponzora nebo sekuritizační jednotky pro speciální účel.
Logika	Předložení informací bylo zamítnuto, protože kód položky není v souladu s dostupnými hodnotami v tabulce 3 přílohy 1 nařízení v přenesené pravomoci (EU) 2020/1224.
Obchod	Předložení informací bylo zamítnuto, není v souladu s jednou nebo více validacemi obsahu.
Reprezentativnost	Předložení informací bylo zamítnuto podle čl. 4 odst. 6.