

Denne tekst tjener udelukkende som dokumentationsværktøj og har ingen retsvirkning. EU's institutioner påtager sig intet ansvar for dens indhold. De autentiske udgaver af de relevante retsakter, inklusive deres betragtninger, er offentliggjort i den Europæiske Unions Tidende og kan findes i EUR-Lex. Disse officielle tekster er tilgængelige direkte via linkene i dette dokument

► **B** **KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU) 2020/1226**
af 12. november 2019

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 og
reguleringsmæssige tekniske standarder, der præciserer, hvilke oplysninger der skal indberettes i
overensstemmelse med STS-meddelelseskravene

(EØS-relevant tekst)

(EUT L 289 af 3.9.2020, s. 285)

Ændret ved:

		Tidende		
		nr.	side	dato
► <u>M1</u>	Kommissionens delegerede forordning (EU) 2022/1301 af 31. marts 2022	L 197	10	26.7.2022

▼B**KOMMISSIONENS DELEGEREDE FORORDNING (EU)
2020/1226**

af 12. november 2019

om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 og reguleringsmæssige tekniske standarder, der præciserer, hvilke oplysninger der skal indberettes i overensstemmelse med STS-meddelelseskravene

(EØS-relevant tekst)

*Artikel 1***Oplysninger, der skal indgå i STS-meddelelsen**

1. Følgende oplysninger skal i henhold til artikel 27 i forordning (EU) 2017/2402 indgå i STS-meddelelsen:

- a) hvis securitiseringen er en ikke-ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i bilag I til denne forordning
- b) hvis securitiseringen er en ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i bilag II til denne forordning
- c) for et ABCP-program, de oplysninger, der er præciseret i bilag III til denne forordning

▼M1

d) hvis securitiseringen er en balanceført syntetisk securitisering, de oplysninger, der er præciseret i bilag IV til denne forordning.

▼B

2. For securitiseringer, i forbindelse med hvilke der i henhold til forordning (EU) 2017/1129 ikke skal udfærdiges et prospekt, ledsages de oplysninger, der i henhold til stk. 1 skal indgå i STS-meddelelsen, af følgende:

- a) hvis securitiseringen er en ikke-ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i felt STSS9 og STSS10 i bilag I til denne forordning
- b) hvis securitiseringen er en ABCP-securitisering, de oplysninger, der er præciseret i felt STSAT9 og STSAT10 i bilag II til denne forordning
- c) for et ABCP-program, de oplysninger, der er præciseret i felt STSAP9 i bilag III til denne forordning

▼M1

d) hvis securitiseringen er en balanceført syntetisk securitisering, de oplysninger, der er præciseret i felt STSSY2, STSSSY10, STSSY12 og STSSY13 i bilag IV til denne forordning.

▼B

For så vidt angår artikel 27, stk. 1, tredje afsnit, i forordning (EU) 2017/2402 begrænses offentliggørelsen af STS-meddelelsen for disse securitiseringer til de oplysninger, der er omhandlet i nærværende stykke.

▼B*Artikel 2***Supplerende oplysninger****▼M1**

Hvis følgende dokumenter omfatter oplysninger, som er relevante for STS-meddelelsen, kan der indsættes en henvisning til de relevante dele af disse dokumenter i kolonnen »Yderligere oplysninger« i bilag I, II, III eller IV til denne forordning, og hvis sådanne oplysninger gives, skal dokumentationen klart identificeres:

▼B

- a) et prospekt udfærdiget i henhold til forordning (EU) 2017/1129
- b) anden underliggende dokumentation som omhandlet i artikel 7, stk. 1, litra b), i forordning (EU) 2017/2402

▼M1

- c) ethvert andet dokument med oplysninger, som er relevante for STS-meddelelsen, herunder, for balanceførte syntetiske securitiseringer, dokumenter vedrørende ethvert eksponeringsleverende institut, enhver investor, aftalen om kreditrisikoafdækning, den tredjeparts-kontrolagent, der er omhandlet i artikel 26e, stk. 4, i forordning (EU) 2017/2402, og, hvis en sådan findes, den dokumentation, der understøtter de credit linked notes, der er omhandlet i artikel 26e, stk. 10, femte afsnit, i forordning (EU) 2017/2402.

▼B*Artikel 3***Ikrafttræden**

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter offentliggørelsen i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i hver medlemsstat.

▼B*BILAG I*

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 19-22 i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende ikkeABCP-securitiseringer

Generelle oplysninger

Felt-nummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS0	Artikel 27, stk. 1	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980 ⁽²⁾
STSS1	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	Det eller de internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-nummer), hvis et sådant nummer foreligger. Hvis et sådant ikke foreligger, et andet entydigt værdipapirnummer tildelt denne securitisering.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980.
STSS2	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de eksponeringsleverende institutter og det eller de organiserende institutter og den eller de oprindelige långivere, hvis en sådan kode foreligger.	Punkt 4.2 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS3	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSS 4	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed i overensstemmelse med artikel 11, stk. 1, i Kommissionens delegerede forordning (EU) 2020/1224 ⁽³⁾ . Hvis der gives mere end én STS-meddelelse ved hjælp af denne unikke securitiseringsidentifikator, en erklæring om, hvorfor dette er tilfældet.	Ikke relevant
STSS5	Ikke relevant	Prospektidentifikator	Prospektidentifikator som tildelt af den relevante kompetente myndighed, hvis en sådan identifikator foreligger.	Ikke relevant
STSS6	Ikke relevant	Securitiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSS7	Ikke relevant	Securitiseringens navn	Securitiseringens navn.	Afsnit 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼M1**▼B**

▼ **B**

Felt-num- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS8	Artikel 18 og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de eksponerings- leverende institutter, det eller de organi- serende institutter, SSPE'en eller SSPE'erne og den eller de oprindelige långivere, hvis en sådan oplysning fore- ligger.	Ikke relevant
STSS9	Ikke relevant	Securitiserings- klassifikation	Securitiseringstype: — ikkeABCP-securitisering — ABCP-securitisering — ABCP-program.	Ikke relevant
STSS10	Ikke relevant	Underliggende eksponerings klassifikation	Type underliggende eksponeringer, herunder: 1) boliglån, som enten er sikret ved et eller flere panter i beboelsesejendom, eller som fuldt ud garanteres af en anerkendt udbyder af kreditrisikoaf- dækning, jf. artikel 201, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013, der kan henføres til kreditkvalitetstrin 2 eller derover som fastsat i nævnte forordnings tredje del, afsnit II, kapitel 2 2) kommercielle lån, som er sikret ved et eller flere panter i erhvervsejen- dom, herunder kontorer eller andre forretningslokaler 3) kreditfaciliteter til enkeltpersoner til personligt, familiemæssigt eller husholdningsmæssigt forbrug 4) kreditfaciliteter, herunder lån og leasing, til alle typer virksomheder eller selskaber 5) billån og -leasing 6) kreditkorttilgodehavender 7) tilgodehavender fra salg 8) andre underliggende eksponeringer, der af det eksponeringsleverende eller organiserende institut anses for at svare til en bestemt aktivtype på grundlag af interne metoder og para- metre	Ikke relevant
STSS11	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Hvis der er udfærdiget et prospekt i overensstemmelse med forordning (EU) 2017/1129 ⁽⁴⁾ , datoen for prospektets godkendelse. I alle andre tilfælde, slutdatoen for den seneste transaktion.	Ikke relevant
STSS12	Ikke relevant	Meddelelles- dato	Datoen for meddelelse til ESMA.	Ikke relevant

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS13	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltestydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepartsvirksomhed.	Ikke relevant
STSS14	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltestydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemsted.	Ikke relevant
STSS15	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltestydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt den.	Ikke relevant
STSS16	Artikel 27, stk. 5	STS-status	En begrundet meddelelse fra det eksponeringsleverende institut og det organiserende institut om, at securitiseringen ikke længere skal anses for at være STS.	Ikke relevant
▼M1				
STSS17	Artikel 27, stk. 3	Eksponeringsleverende institut (eller oprindelig långiver) er et kreditinstitut	En erklæring om, hvorvidt det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver er »Ja« eller ikke er »Nej« et kreditinstitut eller et investeringsselskab etableret i Unionen.	Ikke relevant
▼B				
STSS18	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af långivningskriterier	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers kriterier for långivning, processer og systemer er i overensstemmelse med artikel 9 i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSS19	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af, at långivningen er omfattet af tilsyn	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at långivningen som omhandlet i artikel 27, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 er omfattet af tilsyn.	Ikke relevant

⁽¹⁾ Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

⁽²⁾ Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980 af 14. marts 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1129 for så vidt angår format, indhold, kontrol og godkendelse af det prospekt, der skal offentliggøres, når værdipapirer udbydes til offentligheden eller optages til handel på et reguleret marked, og om ophævelse af Kommissionens forordning (EF) nr. 809/2004 (EUT L 166 af 21.6.2019, s. 26).

⁽³⁾ Delegeret forordning (EU) 2020/1224 af 16. oktober 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår reguleringsmæssige forskrifter, som præciserer de oplysninger og de detaljer vedrørende en securitisering, som det eksponeringsleverende institut, det organiserende institut eller SSPE'en skal stille til rådighed (EUT L 289 af 3.9.2020, s. 1).

⁽⁴⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/1129 af 14. juni 2017 om det prospekt, der skal offentliggøres, når værdipapirer udbydes til offentligheden eller optages til handel på et reguleret marked, og om ophævelse af direktiv 2003/71/EF (EUT L 168 af 30.6.2017, s. 12).

▼B

Specifikke oplysninger

Felt-num- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS20	Artikel 20, stk. 1	Overførsel af underliggende eksponeringer ved egentligt salg (»true sale«) eller tildeling		✓		En koncis redegørelse for, hvordan overførslen af de under- liggende eksponeringer foretages ved egentligt salg (»true sale«) eller en overførsel med samme retlige virkning på en måde, som kan håndhæves over for sælger eller enhver tredjepart.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS 21	Artikel 20, stk. 2	Omfattet af strengte tilbage- tagelsesklau- suler (»severe clawback provisions«)		✓		En koncis redegørelse for, hvor- vidt strenge tilbagetagelsesklau- suler som omhandlet i artikel 20, stk. 2, litra a) eller b), i forord- ning (EU) 2017/2402 forefindes i securitiseringen	Punkt 3.3 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSS 22	Artikel 20, stk. 3	Undtagelse for tilbagetagelses- klausuler i national lovgivning om insolvens	✓			En bekræftelse af, om de tilbag- tagelsesklausuler, der er omhandlet i artikel 20, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402, finder anvendelse.	Punkt 3.3 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSS23	Artikel 20, stk. 4	Overførsel, hvis sælger ikke er den oprindelige långiver	✓			Hvis sælger ikke er den oprinde- lige långiver, en erklæring, som bekræfter, at securitiseringen er i overensstemmelse med artikel 20, stk. 1-3, i forordning (EU) 2017/ 2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS24	Artikel 20, stk. 5	Overførsel sker ved tildeling og sikres på et senere tids- punkt		✓		Hvis overførslen af de underlig- gende eksponeringer sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt end ved securitiserin- gens afslutning, en koncis redegø- relse for, hvordan og hvorvidt de hændelser, som udløser en sådan sikring, mindst omfatter de krævede på forhånd fastlagte hændelser som opført i artikel 20, stk. 5, i forordning (EU) 2017/ 2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B



Felt-num- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Koncisredegørelse ☐	Detaljeret redegørelse ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						Hvis overførslen sker ved hjælp af alternative mekanismer, en bekræftelse af, at insolvens i forbindelse med det eksponeringsleverende institut ikke vil hindre SSPE'en i at håndhæve sine rettigheder.	
STSS25	Artikel 20, stk. 6	Erklæringer og garantier		✓		En koncis redegørelse for, hvordan og hvorvidt sælger har tilvejebragt erklæringer og garantier for, at de underliggende eksponeringer, der omfattes af securitiseringen, ikke er behæftede eller på anden måde i en tilstand, som må forventes at påvirke håndhævelsen af det egentlige salg (»true sale«) eller tildelingen eller overførslen med samme retlige virkning negativt.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS26	Artikel 20, stk. 7	Kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljevaltning af de underliggende eksponeringer på et skønmæssigt grundlag		✓		En koncis redegørelse for, hvordan: — de underliggende eksponeringer, som overføres fra eller tildeles af sælger til SSPE'en, opfylder på forhånd fastsatte, klare og veldokumenterede kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljevaltning af nævnte eksponeringer på et skønmæssigt grundlag — udvælgelsen og overførslen af de underliggende eksponeringer i securitiseringen er baseret på klare processer, som gør det lettere at konstatere, hvilke eksponeringer der udvælges eller overføres til securitiseringen, og at de ikke giver mulighed for aktiv porteføljevaltning af dem på et skønmæssigt grundlag.	Afsnit 2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS27	Artikel 20, stk. 8	Aktivernes homogenitet			✓	En detaljeret redegørelse for homogeniteten af den pulje af underliggende eksponeringer, der sikrer securitiseringen. Med henblik herpå indsættes en henvisning til EBA's reguleringsmæssige tekniske standarder homogenitet (Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/1851 ⁽²⁾) og en detaljeret beskrivelse af, hvordan hver af betingelserne i artikel 1 i nævnte delegerede forordning er opfyldt.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS28	Artikel 20, stk. 9	Forpligtelser relateret til underliggende eksponeringer: Ingen resecuritiserings	✓			En bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer ikke omfatter securitiseringer, og at den meddelte securitisering derfor ikke er en resecuritiserings.	Punkt 2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS29	Artikel 20, stk. 10	Bevillingsstandardens forsvarlighed			✓	En detaljeret redegørelse for: — hvorvidt de underliggende eksponeringer blev indgået som led i långivers almindelige virksomhed, og hvorvidt de anvendte bevillingsstandarder ikke var mindre strenge end dem, som blev anvendt på det samme tidspunkt for indgåelse over for eksponeringer, som ikke blev securitiseret — hvorvidt bevillingsstandarderne og eventuelle væsentlige ændringer i forhold til forudgående bevillingsstandarder er eller vil blive gjort fuldt tilgængelige for potentielle investorer uden unødigt forsinkelse — hvordan i tilfælde af securitiseringer, hvor de underliggende eksponeringer er boliglån, puljen af underliggende eksponeringer opfylder kravet i artikel 20, stk. 10, andet afsnit, i forordning (EU) 2017/2402 — hvorvidt vurderingen af låntagerens kreditværdighed opfylder kravene i artikel 8 i direktiv 2008/48/EF ⁽³⁾ eller artikel 18, stk. 1-4, stk. 5, litra a), og stk. 6, i direktiv 2014/17/EU ⁽⁴⁾ eller, hvis det er relevant, tilsvarende krav i tredjelande.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS30	Artikel 20, stk. 10	Eksponeringsleverende institut/långivers ekspertise			✓	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver har ekspertise inden for indgåelse af eksponeringer af samme art som de securitiserede.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Felt-num-mer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS31	Artikel 20, stk. 11	Overførte underliggende eksponeringer uden misligholdte eksponeringer			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt: — de overførte underliggende eksponeringer ikke på tidspunktet for udvælgelsen omfatter misligholdte eksponeringer (eller omlagte eksponeringer) som defineret i artikel 20, stk. 11, i forordning (EU) 2017/2402 — kravene i artikel 20, stk. 11, litra a), nr. i) og ii), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt — kravene i artikel 20, stk. 11, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt — kravene i artikel 20, stk. 11, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS32	Artikel 20, stk. 12	Mindst én betaling på overførselstidspunktet	√			En bekræftelse af, at låntagerne på det tidspunkt, hvor eksponeringerne overføres, har erlagt mindst én betaling. En bekræftelse af, at undtagelsen i artikel 20, stk. 12, i forordning (EU) 2017/2402 finder eller ikke finder anvendelse.	Punkt 3.3 og 3.4.6 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS33	Artikel 20, stk. 13	Tilbagebetalingen til indehaverne må ikke struktureres således, at den hovedsageligt afhænger af salget af aktiver.			√	En detaljeret redegørelse for det omfang, hvori tilbagebetalingen til indehaverne af securitiseringspositionerne afhænger af salget af aktiver, som sikrer de underliggende eksponeringer.	Punkt 3.4.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS34	Artikel 21, stk. 1	Opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse		√		En koncis redegørelse for, hvordan det eksponeringslevende institut, det organiserende institut eller den oprindelige långiver i forbindelse med en ikkeABCP-securitisering opfylder kravet om risikotilbageholdelse som omhandlet i artikel 6 i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.1 i bilag 9 og punkt 3.4.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnum- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Koncisredegørelse ☐	Detaljeret redegørelse ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						En angivelse af, hvilken enhed der tilbageholder den væsentlige nettoøkonomiske interesse, og af, hvilken mulighed der anvendes til at tilbageholde risikoen: 1) vertikal del i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 2) sælgers andel i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 3) tilfældigt udvalgte eksponeringer på balancen i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 4) first loss-tranche i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 5) first loss-eksponering i hvert aktiv i overensstemmelse med artikel 6, stk. 3, litra e), i forordning (EU) 2017/2402 6) manglende opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse i artikel 6, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402 7) andre muligheder anvendt.	
STSS35	Artikel 21, stk. 2	Reduktion af rente- (IR) og valutarisici (FX)		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt rente- og valutarisiciene er begrænset på passende vis, og at der er truffet foranstaltninger til at begrænse sådanne risici, og en bekræftelse af, at investorer har adgang til sådanne foranstaltninger.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS36	Artikel 21, stk. 2	Derivater købt/solgt af SSPE		✓		En koncis redegørelse for, at SSPE'en kun har indgået derivataftaler under de omstændigheder, der er omhandlet i artikel 21, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS37	Artikel 21, stk. 2	Derivater, som anvender almindelige standarder		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt anvendte afdækningsinstrumenter er tegnet og dokumenteret i overensstemmelse med almindeligt anerkendte standarder.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnum- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Koncisredegørelse ☐	Detaljeret redegørelse ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS38	Artikel 21, stk. 3	Refererede rentebetalinger baseret på almindeligt anvendte rente- satser	☒	√	☐	En koncis redegørelse for, hvor- vidt og hvordan alle refererede rentebetalinger vedrørende aktiver og forpligtelser i securitiseringen er beregnet på grundlag af almin- deligt anvendte markedsrente- satser eller almindeligt anvendte sektorbestemte rentesatser, der afspejler finansieringsomkostnin- gerne.	Punkt 2.2.2 og 2.2.13 i bilag 19 til Kommissio- nens delegerede forord- ning (EU) 2019/980
STSS39	Artikel 21, stk. 4	Kontantbeløb tilbageholdes ikke som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse	☒	√	☐	En generel erklæring om, at alle kravene i artikel 21, stk. 4, i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delege- rede forordning (EU) 2019/980
STSS40	Artikel 21, stk. 4	a) Intet kontantbeløb tilbageholdes	☒	√	☐	Bekræftelse af, at intet kontant- beløb tilbageholdes som følge af påkrav eller meddelelse om opsi- gelse.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delege- rede forordning (EU) 2019/980
STSS41	Artikel 21, stk. 4	b) Indtægter fra afdrag videre- gives til inve- storerne	☒	√	☐	Bekræftelse af, at indtægter fra afdrag på de underliggende eksponeringer videregives til inve- storerne via sekventielle afdrag på securitiseringspositionerne i over- ensstemmelse med securitisering- positionens rangorden.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delege- rede forordning (EU) 2019/980
STSS42	Artikel 21, stk. 4	c) Tilbagebeta- ling af securiti- seringsposi- tioner må ikke ændres i forhold til rangorden	☒	√	☐	Bekræftelse af, at tilbagebeta- lingen af securitiseringsposi- tioner ikke må ændres i forhold til disses rangorden.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delege- rede forordning (EU) 2019/980
STSS43	Artikel 21, stk. 4	c) Ingen bestemmelser må kræve automatisk likvidation af de underlig- gende ekspone- ringer til markedsværdi	☒	√	☐	Bekræftelse af, at ingen bestem- melser kræver automatisk likvida- tion af de underliggende ekspone- ringer til markedsværdi.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delege- rede forordning (EU) 2019/980



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Koncisredegørelse ☐	Detaljeret redegørelse ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS44	Artikel 21, stk. 5	Securitiseringer med ikke-sekventiel prioritering af betalinger	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at transaktioner kendetegnet ved ikke-sekventiel prioritering af betalinger omfatter hændelser, der er relateret til udviklingen i de underliggende eksponeringer, der medfører, at prioriteringen af betalinger igen ændres til sekventiel prioritering af betalinger. Bekræftelse af, at sådanne hændelser som minimum omfatter forringelsen af de underliggende eksponeringers kreditkvalitet, som bringer denne ned under en på forhånd fastlagt tærskel.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS45	Artikel 21, stk. 6	Revolverende securitisering med førtidsindfrielse baseret på forud fastsatte hændelser for afslutning af den revolverende periode	☐	✓	☐	En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne i artikel 21, stk. 6, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS46	Artikel 21, stk. 6, litra a)	a) Forringelse af de underliggende eksponeringers kreditkvalitet	☐	✓	☐	En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne i artikel 21, stk. 6, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS47	Artikel 21, stk. 6, litra b)	b) Forekomst af en insolvensrelateret hændelse med hensyn til det eksponeringsleverende institut eller administrationsselskabet	☐	✓	☐	En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne eller hændelserne i artikel 21, stk. 6, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS48	Artikel 21, stk. 6, litra c)	c) Værdien af de underliggende eksponeringer, som SSPE'en besidder, når ned under en på forhånd fastlagt tærskel	☐	✓	☐	En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne eller hændelserne i artikel 21, stk. 6, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant, ved brug af krydshenvisninger til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnum- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Koncisredegørelse ☐	Detaljeret redegørelse ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS49	Artikel 21, stk. 6, litra d)	d) Der gene- res ikke tilstrækkeligt med nye underliggende eksponeringer, som opfylder den på forhånd fastlagte kredit- kvalitet (hæn- delse for afslutning af den revolve- rende periode)	☒	☒	☐	En koncis redegørelse for, hvordan bestemmelserne i artikel 21, stk. 6, litra d), i forord- ning (EU) 2017/2402 afspejles i transaktionsdokumentationen, hvis det er relevant.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS50	Artikel 21, stk. 7, litra a)	a) Oplysninger om aftalemæs- sige forplig- telser for administra- tionsselskabet, trustee og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser	☒	☒	☐	Bekræftelse af, at transaktions- dokumentationen indeholder en præcisering af alle kravene i artikel 21, stk. 7, litra a), i forord- ning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS51	Artikel 21, stk. 7, litra b)	b) Bestem- melser om kontinuerlig servicering	☒	☒	☐	Bekræftelse af, at securitiserings- dokumentationen udtrykkeligt opfylder kravene i artikel 21, stk. 7, litra b), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS52	Artikel 21, stk. 7, litra c)	c) Bestem- melser om kontinuerlige derivatmodpar- ter	☒	☒	☐	Bekræftelse af, at transaktions- dokumentationen indeholder alle de oplysninger, der er omhandlet i artikel 21, stk. 7, litra c), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS53	Artikel 21, stk. 7, litra c)	c) Bestem- melser om kontinuerlige likviditetsstil- lere og konti- nuerlig konto- førende bank	☒	☒	☐	Bekræftelse af, at transaktions- dokumentationen indeholder alle de oplysninger, der er omhandlet i artikel 21, stk. 7, litra c), i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS54	Artikel 21, stk. 8	Krav til admi- nistrationsselskabet om ekspertise og politikker og passende procedurer og risikostyrings- kontroller	☐	☐	☒	En detaljeret redegørelse for, hvordan kravene i artikel 21, stk. 8, er opfyldt. Som en del af rede- gørelsen indsættes der henvis- ninger til politikker og procedurer, som skal sikre, at disse krav opfyldes.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnum- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Konkrede degn ☐	Detaljeret degn ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS55	Artikel 21, stk. 9	Klare og konsekvente definitioner vedrørende behandling af problemlån	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at den underliggende dokumentation på klar og konsekvent vis fastsætter definitioner, afhjælpende foranstaltninger og foranstaltninger relateret til gældssituationer som omhandlet i artikel 21, stk. 9, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS56	Artikel 21, stk. 9	Prioriteringer af betalinger og hændelser, der udløser tiltag	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen angiver prioriteringerne af betalinger og hændelser, der udløser tiltag, i overensstemmelse med artikel 21, stk. 9, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS57	Artikel 21, stk. 10	Rettidig løsning af konflikter mellem inve- storklasser & det ansvar, som påhviler trustee	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at bestemmelserne i artikel 21, stk. 10, i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende rettidig løsning af konflikter er overholdt.	Punkt 3.4.7 og 3.4.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS58	Artikel 22, stk. 1	Data vedrørende historisk misligholdelse og tabsudvik- ling	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at de data, der skal gøres tilgængelige i henhold til artikel 22, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, er tilgængelige, med en klar angivelse af, hvor oplysningerne kan findes.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSS59	Artikel 22, stk. 2	Stikprøve af de underliggende eksponeringer, som skal kontrolleres af en ekstern instans	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at en stikprøve af de underliggende eksponeringer blev kontrolleret af en relevant og uafhængig ekstern instans forud for udstedelsen af værdipapirerne.	Ikke relevant
STSS60	Artikel 22, stk. 3	»Liability cash flow«-model tilgængelig for potentielle investorer	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at »liability cash flow«-modellen er tilgængelig for potentielle investorer forud for fastsættelsen af prisen, og en klar angivelse af, hvor disse oplysninger er tilgængelige. Efter prisfastsættelsen bekræftelse af, at sådanne oplysninger er gjort tilgængelige for potentielle investorer efter anmodning.	Ikke relevant



Feltnum- mer	Artikel i forordning (EU) 2017/ 2402	FELTNAVN	Bekræftelse ☐	Koncisredegørelse ☐	Detaljeret redegørelse ☐	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSS61	Artikel 22, stk. 4	Offentliggørelse af oplysninger om miljøpræstationer for underliggende eksponeringer, som består af boliglån eller billån eller billeasingaftaler	☐	✓	☐	En koncis redegørelse for, hvorvidt oplysningerne om miljøpræstationer for de aktiver, der finansieres via boliglån eller billån eller billeasingaftaler, er tilgængelige i overensstemmelse med artikel 7, stk. 1, litra a), i forordning (EU) 2017/2402, og en angivelse af, hvor disse oplysninger kan findes.	Ikke relevant
STSS62	Artikel 22, stk. 5	Det eksponeringsleverende institut og det organiserende institut ansvarlige for overholdelse af artikel 7	✓	☐	☐	Bekræftelse af, at: — det eksponeringsleverende institut og det organiserende institut overholder artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402 — de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, litra a), er forud for prisfastsættelsen gjort tilgængelige for potentielle investorer efter anmodning — de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, litra b)-d), er gjort tilgængelige forud for prisfastsættelsen, i det mindste i udkast eller foreløbig form.	Ikke relevant

⁽¹⁾ Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

⁽²⁾ Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/1851 af 28. maj 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for homogeniteten af de underliggende securitiseringseksponeringer (EUT L 280 af 6.11.2019, s. 1).

⁽³⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2008/48/EF af 23. april 2008 om forbruger kreditaftaler og om ophævelse af Rådets direktiv 87/102/EØF (EUT L 133 af 22.5.2008, s. 66).

⁽⁴⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/17/EU af 4. februar 2014 om forbruger kreditaftaler i forbindelse med fast ejendom til beboelse og om ændring af direktiv 2008/48/EF og 2013/36/EU og forordning (EU) nr. 1093/2010 (EUT L 60 af 28.2.2014, s. 34).

▼B*BILAG II*

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 24 i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende ABCP-securitiseringer

Generelle oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAV	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT0	Artikel 27, stk. 1	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT1	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	Det eller de internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-nummer), hvis et sådant nummer foreligger. Hvis et sådant ikke foreligger, et andet entydigt værdipapirnummer tildelt ABCP-securitiseringen.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980.
STSAT2	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de ekspederingsleverende institutter og/eller det eller de organiserende institutter, hvis en sådan kode foreligger.	Punkt 4.2 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT3	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSAT 4	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed i overensstemmelse med artikel 11, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2020/1224. Hvis der gives mere end én STS-meddelelse ved hjælp af denne unikke securitiseringsidentifikator, en erklæring om, hvorfor dette er tilfældet.	Ikke relevant
STSAT5	Ikke relevant	Prospektidentifikator	Prospektidentifikator som tildelt af den relevante kompetente myndighed, hvis en sådan identifikator foreligger.	Ikke relevant
STSAT6	Ikke relevant	Securitiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSAT7	Ikke relevant	Securitiseringens navn	Securitiseringens navn, hvis et sådant foreligger, eller hvis et sådant ikke foreligger, kodenavnet og det anvendte navn.	Afsnit 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES (1)	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT8	Artikel 18 og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de eksponeringsleverende institutter, det eller de organiserende institutter, SSPE'en eller SSPE'erne, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSAT9	Ikke relevant	Securitiseringsklassifikation	Securitiseringstype: — ikkeABCP — ABCP; — ABCP-program.	Ikke relevant
STSAT10	Ikke relevant	Underliggende eksponeringsklassifikation	Type underliggende eksponeringer, herunder: 1. boliglån, som enten er sikret ved et eller flere panter i beboelsesejendom, eller som fuldt ud garanteres af en anerkendt udbyder af kreditrisikoafdækning, jf. artikel 201, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013, der kan henføres til kreditkvalitetstrin 2 eller derover som fastsat i nævnte forordnings tredje del, afsnit II, kapitel 2 2. kommercielle lån, som er sikret ved et eller flere panter i erhvervsejendom, herunder kontorer eller andre forretningslokaler 3. kreditfaciliteter til enkeltpersoner til personligt, familiemæssigt eller husholdningsmæssigt forbrug 4. kreditfaciliteter, herunder lån og leasing, til alle typer virksomheder eller selskaber 5. billån og -leasing 6. kreditkorttilgodehavender 7. tilgodehavender fra salg 8. andre underliggende eksponeringer, der af det eksponeringsleverende eller organiserende institut anses for at svare til en bestemt aktivtype på grundlag af interne metoder og parametre.	Ikke relevant
STSAT11	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Hvis der er udfærdiget et prospekt i overensstemmelse med forordning (EU) 2017/1129, datoen for prospektets godkendelse. Hvis ikke, ABCP-securitiseringens udstedelsesdato.	Ikke relevant
STSAT12	Ikke relevant	Meddelelsesdato	Datoen for meddelelse til ESMA.	Ikke relevant

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT13	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepartsvirksomhed.	Ikke relevant
STSAT14	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemsted.	Ikke relevant
STSAT15	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis den godkendte tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i securitiseringsforordningen, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt denne.	Ikke relevant
STSAT16	Artikel 27, stk. 5	STS-status	Hvorvidt det eksponeringsleverende institut og/eller det organiserende institut har meddelt, at ABCP-securitiseringen ikke længere skal anses for at være STS, og begrundelsen for en sådan meddelelse.	Ikke relevant

▼M1

STSAT 17	Artikel 27, stk. 3	Eksponeringsleverende institut (eller oprindelig långiver) er et kreditinstitut	En erklæring om, hvorvidt det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver er (»Ja«) eller ikke er (»Nej«) et kreditinstitut eller et investeringsselskab etableret i Unionen.	Ikke relevant
----------	--------------------	---	---	---------------

▼B

STSAT18	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af långivningskriterier	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers kriterier for långivning, processer og systemer er i overensstemmelse med artikel 9 i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAT19	Artikel 27, stk. 3	Bekræftelse af, at långivningen er omfattet af tilsyn	Hvis svaret i felt STSS17 er »Nej«, en bekræftelse af, at långivningen som omhandlet i artikel 27, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 er omfattet af tilsyn.	Ikke relevant

⁽¹⁾ Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

▼B

Specifikke oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT20	Artikel 24, stk. 1	Underliggende eksponeringer erhvervet ved egentligt salg (»true sale«)		✓		En koncis redegørelse for, hvordan overførslen af de underliggende eksponeringer foretages ved egentligt salg (»true sale«) eller tildeling med samme retlige virkning på en måde, som kan håndhæves over for sælger eller enhver tredjepart.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT 21	Artikel 24, stk. 2	Omfattet af strenge tilbagetagelsesklausuler (»severe clawback provisions«)		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt strenge tilbagetagelsesklausuler som omhandlet i artikel 24, stk. 2, litra a) eller b), i forordning (EU) 2017/2402 forefindes i securitiseringen	Punkt 3.3 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSAT 22	Artikel 24, stk. 3	Undtagelse for tilbagetagelsesklausuler i national lovgivning om insolvens	✓			En bekræftelse af, om de tilbagetagelsesklausuler, der er omhandlet i artikel 24, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402, finder anvendelse.	Punkt 3.3 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSAT23	Artikel 24, stk. 4	Overførsel, hvis sælger ikke er den oprindelige långiver	✓			Hvis sælger ikke er den oprindelige långiver, en erklæring, som bekræfter, at securitiseringen er i overensstemmelse med artikel 24, stk. 1-3, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT24	Artikel 24, stk. 5	Overførsel sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt.		✓		Hvis overførslen af de underliggende eksponeringer sker ved tildeling og sikres på et senere tidspunkt end ved securitiseringens afslutning, gives der en koncis redegørelse for, hvordan og hvorvidt de hændelser, som udløser en sådan sikring, mindst omfatter de krævede på forhånd fastlagte hændelser som opført i artikel 24, stk. 5, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT25	Artikel 24, stk. 6	Erklæringer og garantier		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt sælger har tilvejebragt erklæringer og garantier for, at de aktiver, der omfattes af securitiseringen, ikke er behæftede eller på anden måde i en tilstand, som må forventes at påvirke håndhævelsen af det egentlige salg (»true sale«) eller tildelingen eller overførslen med samme retlige virkning negativt.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT26	Artikel 24, stk. 7	Kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljeadministration af de underliggende eksponeringer på et skønsmæssigt grundlag		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt: — de underliggende eksponeringer, som overføres fra eller tildeles af sælger til SSPE'en, opfylder på forhånd fastsatte, klare og veldokumenterede kriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljeadministration af nævnte eksponeringer på et skønsmæssigt grundlag — udvælgelsen og overførslen af de underliggende eksponeringer i securitiseringen er baseret på klare processer, som gør det lettere at konstatere, hvilke eksponeringer der udvælges eller overføres til securitiseringen, og at de ikke giver mulighed for aktiv porteføljeadministration af dem på et skønsmæssigt grundlag.	Afsnit 2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT27	Artikel 24, stk. 8	Ingen resecuritisering	√			Bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer ikke omfatter securitiseringspositioner, og at den meddelte securitisering derfor ikke er en resecuritisering.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT28	Artikel 24, stk. 9	Overførte underliggende eksponeringer uden misligholdte eksponeringer			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan de overførte underliggende eksponeringer ikke omfatter på tidspunktet for udvælgelsen misligholdte eksponeringer eller omlagte eksponeringer som omhandlet i artikel 24, stk. 9, i forordning (EU) 2017/2402, hvis det er relevant. En klar redegørelse for, hvorvidt securitiseringen omfatter	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						kreditsvage tilstande på securitiseringstidspunktet som omhandlet i artikel 24, stk. 9, litra a), nr. i), i forordning EU 2017/2402, hvis det er relevant. Bekræftelse af, at: — på tidspunktet for indgåelse er kravene i artikel 24, stk. 9, litra b), i forordning (EU) 2017/2402 opfyldt — på tidspunktet for udvælgelse er kravene i artikel 24, stk. 9, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 opfyldt.	
STSAT29	Artikel 24, stk. 10	Mindst én betaling på overførselstidspunktet	✓			Bekræftelse af, at låntagerne på det tidspunkt, hvor eksponeringerne overføres, har erlagt mindst én betaling. Hvis der ikke er erlagt betalinger, en redegørelse for, hvorfor dette er tilfældet, herunder en angivelse af, hvorvidt årsagen er den, at en af de undtagelser, der er tilladt i henhold til artikel 20, stk. 12, i forordning (EU) 2017/2402, finder anvendelse.	Punkt 3.3 og 3.4.6 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT30	Artikel 24, stk. 11	Tilbagebetalingen til indehaverne må ikke struktureres således, at den hovedsageligt afhænger af salget af aktiver.			✓	En detaljeret redegørelse for det omfang, hvori tilbagebetalingen til indehaverne af securitiseringsspositionerne afhænger af salget af aktiver, som sikrer de underliggende eksponeringer. En detaljeret redegørelse for, hvorvidt tilbagebetalinger til investorerne ikke anses for at afhænge af salget af aktiver som omhandlet i artikel 24, stk. 11, andet afsnit, i forordning (EU) 2017/2402, hvis det er relevant.	Punkt 3.4.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT31	Artikel 24, stk. 12	Reduktion af rente- (IR) og valutarisici (FX)		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt og hvordan rente- og valutarisiciene er begrænset på passende vis, og en bekræftelse af, at de foranstaltninger, der er truffet med henblik herpå, er offentliggjort.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						En koncis redegørelse for, hvorvidt anvendte afdækningsinstrumenter er tegnet og dokumenteret i overensstemmelse med almindeligt anerkendte standarder.	
STSAT32	Artikel 24, stk. 12	Derivater købt/solgt af SSPE		✓		Medmindre disse tjener til afdækning af rente- eller valutarisici, en koncis redegørelse for, hvorvidt SSPE'en ikke har indgået derivataftaler.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT33	Artikel 24, stk. 12	Derivater i underliggende eksponeringer		✓		En koncis redegørelse for tilstedeværelsen af derivater i puljen af underliggende eksponeringer.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT34	Artikel 24, stk. 12	Derivater, som anvender almindelige standarder		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt derivater, som kan tillades i henhold til artikel 24, stk. 12, er tegnet og dokumenteret i overensstemmelse med almindelige standarder for international finansiering.	Punkt 3.4.7 og 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT35	Artikel 24, stk. 13	Klare og konsekvente definitioner vedrørende behandling af problemlån	✓			Bekræftelse af, at den underliggende dokumentation på klar og konsekvent vis fastsætter definitioner, afhjælpende foranstaltninger og foranstaltninger relateret til gældssituationer som omhandlet i artikel 24, stk. 13, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT36	Artikel 24, stk. 13	Prioriteringer af betalinger og hændelser, der udløser tiltag	✓			Bekræftelse af, at transaktionsdokumentationen angiver prioriteringerne af betalinger og hændelser, der udløser tiltag, i overensstemmelse med artikel 24, stk. 13, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.7 og 3.4.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT37	Artikel 24, stk. 14	Data vedrørende historisk misligholdelse og tabsudvikling	✓			Bekræftelse af, at de data, der skal gøres tilgængelige i henhold til artikel 24, stk. 14, i forordning (EU) 2017/2402, er tilgængelige, og en klar angivelse af, hvor oplysningerne er tilgængelige for potentielle investorer forud for prisfastsættelsen.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						Hvis det organiserende institut ikke har adgang til sådanne data, bekræftelse af, at sælgeren har givet adgang til data som omhandlet i artikel 24, stk. 14, i forordning (EU) 2017/2402. Bekræftelse af, at dataene er tilgængelige, og en klar angivelse af, hvor oplysningerne er tilgængelige, og at dataene omfatter en periode på mindst fem år, undtagen for data, der vedrører tilgodehavender fra salg og andre kortfristede tilgodehavender, hvis historiske periode ikke er kortere end tre år.	
STSAT38	Artikel 24, stk. 15	Aktivernes homogenitet			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan securitiseringen er sikret ved en pulje af underliggende eksponeringer, som er homogene, idet der tages hensyn til de særlige karakteristika, der er forbundet med de forskellige aktivtypers pengestrømme, herunder deres karakteristika med hensyn til kontrakter, kreditrisiko og forudbetaling.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT39	Artikel 24, stk. 15	Forpligtelser relateret til underliggende eksponeringer	√			Bekræftelse af, at puljen af underliggende eksponeringer har en vægtet gennemsnitlig restløbetid på højst ét år, og at ingen af de underliggende eksponeringer har en restløbetid på over tre år. Bekræftelse af, hvorvidt undtagelsen vedrørende puljer af billån, billeasing eller leasingtransaktioner vedrørende udstyr finder anvendelse i overensstemmelse med artikel 24, stk. 15, tredje afsnit, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT40	Artikel 24, stk. 15	Forpligtelser relateret til underliggende eksponeringer	√			Bekræftelse af, hvis det er relevant, at de underliggende eksponeringer:	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						— ikke omfatter lån sikret ved pant i beboelses- eller erhvervsejendom eller boliglån med fuld garanti som omhandlet i artikel 129, stk. 1, første afsnit, litra e), i forordning (EU) nr. 575/2013 ⁽²⁾ — indeholder forpligtelser, som er kontraktmæssigt bindende, og som kan håndhæves med fuld regresret over for låntagerne og er forbundet med fastsatte betalingsstrømme, som er betalinger vedrørende leje, hovedstol og renter, eller som er relateret til eventuelle andre rettigheder til at modtage indkomst fra aktiver, som garanterer sådanne betalinger — ikke omfatter værdipapirer som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 44), i direktiv 2014/65/EU ⁽³⁾, bortset fra erhvervsobligationer, som ikke er opført i et handelssystem.	
STSAT41	Artikel 24, stk. 16	Refererede rentebetalinger baseret på almindeligt anvendte rentesatser		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt og hvordan alle refererede rentebetalinger vedrørende aktiver og forpligtelser i ABCP-securitiseringen er beregnet på grundlag af almindeligt anvendte markedsrentesatser eller almindeligt anvendte sektorbestemte rentesatser, der afspejler finansieringsomkostningerne.	Punkt 2.2.2 og 2.2.13 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT42	Artikel 24, stk. 17	Kontantbeløb tilbageholdes ikke som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse		√		En koncis redegørelse for, hvorvidt de enkelte krav i artikel 24, stk. 17, i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt, herunder en koncis redegørelse for tilfælde, hvor kontantbeløb kan tilbageholdes.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT43	Artikel 24, stk. 17	a) Kontantbeløb tilbageholdes ikke som følge af påkrav eller opsigelse	√			Bekræftelse af, at intet kontantbeløb tilbageholdes som følge af påkrav eller meddelelse om opsigelse.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT44	Artikel 24, stk. 17	b) Indtægter fra afdrag videregives til investorerne	✓			Bekræftelse af, at indtægter fra afdrag på de underliggende eksponeringer videregives til investorer via sekventielle afdrag på securitiseringspositionerne i overensstemmelse med securitiseringspositionens rangorden.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT45	Artikel 24, stk. 17	c) Ingen bestemmelser må kræve automatisk likvidation af de underliggende eksponeringer til markedsværdi	✓			Bekræftelse af, at ingen bestemmelser kræver automatisk likvidation af de underliggende eksponeringer til markedsværdi.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT46	Artikel 24, stk. 18	Bevillingsstandardernes forsvarlighed			✓	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt de underliggende eksponeringer blev indgået som led i sælgers almindelige virksomhed, og det præciseres, hvorvidt bevillingsstandarderne ikke er mindre strenge end dem, som blev anvendt over for eksponeringer, som ikke blev securitiseret. En detaljeret redegørelse for, hvorvidt eventuelle væsentlige ændringer i forhold til forudgående bevillingsstandarder har været tilgængelige for det organiserende institut og andre parter, der er direkte eksponeret mod ABCP-securitiseringen.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT47	Artikel 24, stk. 18	Sælgers ekspertise			✓	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt sælger har den fornødne ekspertise inden for indgåelse af eksponeringer af samme art som de securitiserede.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT48	Artikel 24, stk. 19	Revolverende ABCP-securitisering/hændelse relateret til kreditkvalitet.			✓	En detaljeret redegørelse for, hvordan bestemmelserne eller hændelserne i artikel 24, stk. 19, i forordning (EU) 2017/2402 indgår i securitiseringsdokumentationen.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegrund	Detaljeret redogørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAT49	Artikel 24, stk. 20	Pligter relateret til securitiseringsdeltagere	✓			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter de aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar for det organiserende institut, administrationsselskabet og trustee, hvis det er relevant, og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT50	Artikel 24, stk. 20	Bestemmelser om kontinuerlig service-ring	✓			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter processer og ansvar, som er nødvendige for at sikre, at misligholdelse fra administrationsselskabets side eller dettes insolvens ikke medfører, at varetagelsen af forvaltningsopgaven ophører.	Punkt 3.7 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT51	Artikel 24, stk. 20	Bestemmelser om kontinuerlig derivatmodpart og kontoførende bank	✓			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter bestemmelser, der sikrer udskiftning af derivatmodparter og kontoførende bank i tilfælde af misligholdelse fra disses side, disses insolvens og andre angivne hændelser, hvis det er relevant.	Punkt 3.8 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAT52	Artikel 24, stk. 20	Det eksponeringsleverende instituts robusthed	✓			Bekræftelse af, at securitiseringsdokumentationen omfatter bestemmelser om, hvordan det organiserende institut opfylder kravene i artikel 25, stk. 3, i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

⁽¹⁾ Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

⁽²⁾ Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) nr. 575/2013 af 26. juni 2013 om tilsynsmæssige krav til kreditinstitutter og investeringsselskaber og om ændring af forordning (EU) nr. 648/2012 (EUT L 176 af 27.6.2013, s. 1).

⁽³⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af direktiv 2002/92/EF og direktiv 2011/61/EU (EUT L 173 af 12.6.2014, s. 349).

▼B*BILAG III*

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 25 og 26 i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende ABCP-programmer

Generelle oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP0	Artikel 27, stk. 1	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP1	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	De internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-numre), der er tildelt ABCP-programmerne, hvis det er relevant.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980.
STSAP2	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de organiserende institutter og/eller ABCP-programmet eller -programmerne.	Punkt 4.2 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP3	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSAP 4	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed i overensstemmelse med artikel 11, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2020/1224. Hvis der gives mere end én STS-meddelelse ved hjælp af denne unikke securitiseringsidentifikator, en erklæring om, hvorfor dette er tilfældet.	Ikke relevant
STSAP5	Ikke relevant	Prospektidentifikator	Prospektidentifikator som tildelt af den relevante kompetente myndighed, hvis en sådan identifikator foreligger.	Ikke relevant
STSAP6	Ikke relevant	Securitiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis en sådan oplysning foreligger.	Ikke relevant
STSAP7	Ikke relevant	Securitiseringens navn	ABCP-programmets navn	Afsnit 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP8	Artikel 18 og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de organiserende institutter.	Punkt 4.3 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP9	Ikke relevant	Securitiseringsklassifikation	Type securitisering (ikkeABCP, ABCP, ABCP-program)	Ikke relevant
STSAP10	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Datoen for ABCP-programmets første udstedelse	Punkt 4 i bilag 9 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980
STSAP11	Ikke relevant	Meddelelsesdato	Datoen for STS-meddelelse til ESMA	Ikke relevant
STSAP12	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltestydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepartsvirksomhed.	Ikke relevant
STSAP13	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltestydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemsted.	Ikke relevant
STSAP14	Artikel 27, stk. 2	Godkendt tredjepart	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltestydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt den.	Ikke relevant
STSAP15	Artikel 27, stk. 5	STS-status	Meddelelse fra det organiserende institut om, at ABCP-programmet ikke længere skal anses for at være STS, og begrundelsen for denne ændring.	Ikke relevant

⁽¹⁾ Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.

Specifikke oplysninger

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP16	Artikel 25, stk. 1	Det organiserende institut skal være et kreditinstitut under tilsyn	√			Bekræftelse af, at det organiserende institut for programmet er et kreditinstitut under tilsyn, og et link til et dokument, som dokumenterer en sådan status.	Ikke relevant



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP17	Artikel 25, stk. 2	Støtte fra det eksponeringsleverende institut som udbyder af en likviditetsfacilitet	✓			Bekræftelse af, at det organiserende institut for ABCP-programmet udbyder en likviditetsfacilitet, og at det understøtter alle securitiseringspositioner på ABCP-programniveau, herunder en beskrivelse af likviditetsfaciliteten og et link til dokumenter, der tjener som bevis for, at en sådan er stillet til rådighed.	Ikke relevant
STSAP18	Artikel 25, stk. 3	Godtgørelse over for kreditinstitutets kompetente myndighed	✓			Bekræftelse af, at kreditinstituttet i sin rolle som organiserende institut ikke bringer sin solvens og likviditet i fare, og et link, hvis et sådant findes, til det dokument, der tjener som bevis for, at kreditinstituttet har godtgjort denne stilling over for sin kompetente myndighed.	Ikke relevant
STSAP19	Artikel 25, stk. 4	Opfyldelse af kravene til det eksponeringsleverende institut om rettidig omhu	✓			Bekræftelse af, at det organiserende institut opfylder kravene om at udvise rettidig omhu som omhandlet i artikel 5, stk. 1 og 3, i forordning 2017/2402, alt efter tilfældet. Bekræftelse af, at det organiserende institut har kontrolleret, at sælger har indført de påkrævede muligheder for gældsafvikling samt inddrivelsesprocedurer, som opfylder kravene i artikel 265, stk. 2, litra i)-p), i forordning (EU) nr. 575/2013 eller tilsvarende krav i tredjelande.	Ikke relevant
STSAP20	Artikel 25, stk. 5	Sælger skal (på transaktionsniveauet) eller det organiserende institut (på ABCP-programniveauet) opfylde de i artikel 6 omhandlede krav om risikotilbageholdelse.		✓		En koncis redegørelse for, hvordan sælger (ABCP-securitisering) og det organiserende institut (ABCP-program) opfylder kravene om risikotilbageholdelse som omhandlet i artikel 6 i forordning (EU) 2017/2402, og det angives nærmere, hvilken mulighed der er anvendt til at tilbageholde risikoen, herunder: 1) vertikal del — dvs. artikel 6, stk. 3, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 2) sælgers andel — dvs. artikel 6, stk. 3, litra b), i forordning (EU) 2017/2402	Punkt 3.4.3 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
						3) tilfældigt udvalgte eksposeringer på balancen — dvs. artikel 6, stk. 3, litra c), i forordning (EU) 2017/2402 4) first loss-tranchen — dvs. artikel 6, stk. 3, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 5) first loss-eksponeringen i hvert aktiv — dvs. artikel 6, stk. 3, litra e), i forordning (EU) 2017/2402 6) manglende opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse i forordning (EU) 2017/2402 7) andet.	
STSAP21	Artikel 25, stk. 6	Overholdelse på ABCP-programniveau af artikel 7 (transparenskrav)	✓			Bekræftelse af, at: — det organiserende institut er ansvarligt for overholdelse af artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402 — det organiserende institut overholder artikel 7 på ABCP-programniveau — det organiserende institut har stillet følgende til rådighed for potentielle investorer efter anmodning og forud for prisfastsættelsen: de samlede oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra a), i forordning (EU) 2017/2402, og de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra b)-e), i forordning (EU) 2017/2402, som minimum i udkast eller foreløbig form.	Ikke relevant
STSAP22	Artikel 25, stk. 7	Træk på likviditetsfaciliteten, hvis det organiserende institut ikke fornyer finansieringstilsagn om likviditetsfaciliteten		✓		En koncis redegørelse fra det organiserende institut for, hvorvidt der vil ske træk på likviditetsfaciliteten, og de værdipapirer, som udløber, vil blive tilbagebetalt, hvis det organiserende institut ikke fornyer finansieringstilsagnet om likviditetsfaciliteten inden dets udløbsdato.	Ikke relevant



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredogørelse	Detaljeretredogørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP23	Artikel 26, stk. 1	ABCP-securitiseringer i et ABCP-program opfylder kravene i artikel 24, stk. 1-8 og 12-20	✓			Bekræftelse af, at alle ABCP-securitiseringer i programmet opfylder følgende krav: — Artikel 24, stk. 1-8, i forordning (EU) 2017/2402. — Artikel 24, stk. 12-20, i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAP24	Artikel 26, stk. 1, andet og tredje afsnit	Højst 5 % af det samlede beløb af de eksponeringer, der ligger til grund for ABCP, kan midlertidigt være i modstrid med visse krav.			✓	En detaljeret redegørelse for, hvilke krav i artikel 24, stk. 9, 10 eller 11, i forordning (EU) 2017/2402 der eventuelt midlertidigt ikke opfyldes, hvilken procentdel af det samlede beløb af de eksponeringer, der ligger til grund for ABCP-securitiseringerne, dette svarer til, og hvorfor programmet midlertidigt er i modstrid med disse krav. Bekræftelse af, at en stikprøve af de underliggende eksponeringer kontrolleres regelmæssigt af en relevant, uafhængig ekstern instans.	Ikke relevant
STSAP25	Artikel 26, stk. 2	Den vægtede gennemsnitlige restløbetid (WAL) for de underliggende eksponeringer i et ABCP-program må ikke være mere end to år.	✓			Bekræftelse af, at den vægtede gennemsnitlige restløbetid for de underliggende eksponeringer i et ABCP-program ikke er mere end to år.	Ikke relevant
STSAP26	Artikel 26, stk. 3	Fuldt ud understøttet ABCP-program (støtte fra eksponeeringsleverende institut)		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt ABCP-programmet er fuldt ud understøttet af et organiserende institut i overensstemmelse med artikel 25, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAP27	Artikel 26, stk. 4	Ingen resecuritisering og ingen kreditforbedringen, som etablerer en trancheopdeling i andet lag på ABCP-programniveau	✓			Bekræftelse af, at ABCP-programmet ikke indeholder en resecuritisering, og at kreditforbedringen ikke etablerer en trancheopdeling i andet lag på programniveau..	Ikke relevant

▼B

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP28	Artikel 26, stk. 5	Ingen call-optioner	✓			Bekræftelse af, at ABCP-programmet ikke indeholder call-optioner, bestemmelser eller klausuler, som påvirker værdipapirernes endelige udløbstidspunkt, når sådanne optioner eller klausuler kan udøves efter sælgerens, det organiserende instituts eller SSPE'ens skøn.	Ikke relevant
STSAP29	Artikel 26, stk. 6	Rente- og valutarisici på ABCP-programniveau begrænset på passende vis og dokumenteret.			✓	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt og hvordan rente- og valutarisici, som opstår på ABCP-programniveau, er begrænset på passende vis, og de foranstaltninger, der træffes med henblik på at begrænse sådanne risici, herunder, hvorvidt SSPE'en indgår derivataftaler af andre årsager end dem, der er omhandlet i artikel 26, stk. 6, i forordning (EU) 2017/2402, og en beskrivelse af, hvordan disse derivater tegnes og dokumenteres, navnlig om dette sker i overensstemmelse med almindelige standarder for international finansiering.	Ikke relevant
STSAP30	Artikel 26, stk. 7, litra a)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (ansvar, som påhviler trustee over for investorer)	✓			Bekræftelse af, at det ansvar, som påhviler trustee og andre enheder med betroede opgaver, hvis det er relevant, over for investorer, er nærmere angivet i dokumentationen vedrørende ABCP-programmet.	Ikke relevant
STSAP31	Artikel 26, stk. 7, litra b)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (det eksponeringsleverende instituts aftalemæssige forpligtelser)	✓			Bekræftelse af, at de aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar for det organiserende institut, trustee og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser, hvis det er relevant, er nærmere angivet i dokumentationen vedrørende ABCP-programmet.	Ikke relevant
STSAP32	Artikel 26, stk. 7, litra c)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (proces og ansvar i tilfælde af misligholdelse fra administrationsselskabets side)	✓			Bekræftelse af, at dokumentationen vedrørende ABCP-programmet beskriver processer og ansvar, som omfatter misligholdelse fra administrationsselskabets side eller dets insolvens, for at sikre, at varetagelsen af forvaltningsopgaven videreføres.	Ikke relevant



Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP33	Artikel 26, stk. 7, litra d)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (bestemmelser vedrørende udskiftning af derivatmodparter og den kontoførende bank)	✓			Bekræftelse af, at kravene i artikel 26, stk. 7, litra d), i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt for så vidt angår bestemmelser vedrørende udskiftning af derivatmodparter og kontoførende bank på ABCP-programniveau i tilfælde af misligholdelse fra disses side, disses insolvens og andre angivne hændelser, hvis likviditetsfaciliteten ikke dækker sådanne hændelser.	Ikke relevant
STSAP34	Artikel 26, stk. 7, litra e)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (foranstaltninger med henblik på sikkerhedsstillelse for finansieringstilsagnet)	✓			Bekræftelse af, at dokumentationen vedrørende ABCP-programmet omfatter procedurer, som sikrer, at der i forbindelse med angivne hændelser samt misligholdelse fra det organiserende instituts side eller dettes insolvens vil blive truffet afhjælpende foranstaltninger med henblik på sikkerhedsstillelse for finansieringstilsagnet eller udskiftning af udbyderen af likviditetsfaciliteten, hvis det er nødvendigt. En erklæring med angivelse af de relevante sider i prospektet eller anden underliggende dokumentation, der indeholder oplysninger, som er relevante for kravene i artikel 26, stk. 7, litra e), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSAP35	Artikel 26, stk. 7, litra f)	Krav til dokumentationen vedrørende ABCP-programmet (likviditetsfacilitet & værdipapirer, som udløber, og som skal tilbagebetales, hvis det eksponeringsleverende institut ikke fornyer finansieringstilsagnet om likviditetsfaciliteten inden dets udløbsdato)	✓			Bekræftelse af, at dokumentationen vedrørende ABCP-programmet omfatter bestemmelser, som sikrer, at der vil ske træk på likviditetsfaciliteten, og de værdipapirer, som udløber, vil blive tilbagebetalt, hvis det organiserende institut ikke fornyer finansieringstilsagnet om likviditetsfaciliteten inden dets udløbsdato. En erklæring med angivelse af de relevante sider i prospektet eller anden underliggende dokumentation, der indeholder oplysninger, som er relevante for kravene i artikel 26, stk. 7, litra f), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant

▼ **B**

Feltnummer	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	FELTNAVN	Bekræftelse	Koncisredegørelse	Detaljeret redegørelse	INDHOLD, SOM SKAL INDBERETTES ⁽¹⁾	SUPPLERENDE OPLYSNINGER
STSAP36	Artikel 26, stk. 8	Administrationsselskabets ekspertise			✓	En detaljeret redegørelse for, hvordan kravene i artikel 26, stk. 8, i forordning (EU) 2017/2402 er opfyldt, herunder de politikker og procedurer, som sikrer, at disse krav opfyldes. En erklæring med angivelse af de relevante sider i prospektet eller anden underliggende dokumentation, der indeholder de gældende forklaringer i forhold til at opfylde kravene i artikel 26, stk. 8, i forordning (EU) 2017/2402 (hvis det er relevant) (»administrationsselskabets ekspertise, politikker, procedurer og risikostyring«).	Punkt 3.2 i bilag 19 til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/980

⁽¹⁾ Indsæt en henvisning til de relevante afsnit i den underliggende dokumentation, hvis sådanne oplysninger foreligger, og det er relevant.



M1

BILAG IV

Oplysninger, som skal indgives til ESMA i overensstemmelse med artikel 26b-26e i forordning (EU) 2017/2402 vedrørende balanceførte securitiseringer

Generelle oplysninger

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 1	Artikel 27, stk. 1, tredje afsnit	Første kontaktpunkt	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode) for den enhed, der er udpeget som første kontaktpunkt og navnet på den relevante kompetente myndighed	Punkt 3.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 2	Ikke relevant	Meddelelsesdato	Datoen for meddelelse til ESMA.	Ikke relevant
STSSY 3	Ikke relevant	Instrumentidentifikationskode	Det eller de internationale identifikationsnumre for værdipapirer (ISIN-nummer), hvis et sådant nummer foreligger. Hvis et sådant ikke foreligger, et andet entydigt værdipapirnummer tildelt denne securitisering (herunder credit linked notes), hvis et sådant nummer foreligger.	Hvis de foreligger under punkt 3.1 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 4	Ikke relevant	Identifikationskode for juridiske enheder (LEI-kode)	LEI-koden for det eller de ekspederingsleverende institutter og det eller de organiserende institutter samt den eller de oprindelige långivere og SSPE'er, hvis en sådan kode foreligger.	Punkt 4.2 i bilag 9 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 5	Artikel 31, stk. 3	Sælger af afdækning	LEI-kode, navn, etableringsland for den eller de oprindelige sælgere af afdækning og navnet på den kompetente myndighed.	Ikke relevant
STSSY 6	Ikke relevant	Meddelelsesidentifikator	Ved indberetning af en opdatering, det unikke referencenummer, som ESMA tildelte den tidligere indsendte STS-meddelelse.	Ikke relevant
STSSY 7	Ikke relevant	Unik identifikator	Den unikke identifikator tildelt af den indberettende enhed i overensstemmelse med artikel 11, stk. 1, i delegeret forordning (EU) 2020/1224.	Ikke relevant
STSSY 8	Ikke relevant	Securiseringsregister	Det registrerede securitiseringsregisters navn, hvis det er relevant.	Ikke relevant
STSSY 9	Artikel 18, andet afsnit, og artikel 27, stk. 3	Hjemland	Hjemland for det eller de eksponeringsleverende institutter, det eller de organiserende institutter, den eller de oprindelige långivere og SSPE'en eller SSPE'erne.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 10	Ikke relevant	Klassifikation af syntetisk securitisering	Typen af syntetisk securitisering: — syntetisk securitisering med finansieret kreditrisikoafdækning — syntetisk securitisering med ufinansieret kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 11	Ikke relevant	Syntetisk securitisering med ufinansieret kreditrisikoafdækning	Navnet på sælgeren af afdækning (statslig eller overnational institution med en risikovægt på 0 %)	Ikke relevant
STSSY 12	Ikke relevant	Anvendt aftale om kreditrisikoafdækning	Den anvendte type af aftale om kreditrisikoafdækning: — Kreditderivater — Finansielle garantier .	Ikke relevant
STSSY 13	Ikke relevant	Underliggende eksponerings klassifikation	Type underliggende eksponeringer, herunder: 1) Handelsfinansierings-eksponeringer 2) Lån til små og mellemstore virksomheder (SMV'er) 3) Forbrugslån 4) Lån til store virksomheder 5) Blanding af lån til SMV'er og lån til store virksomheder 6) Eksponeringer i erhvervsejendomme 7) Andet.	Ikke relevant
STSSY 14	Ikke relevant	Udstedelsesdato	Datoen for transaktionens afslutning og, hvis den ikke er den samme, den dato, hvor aftalen om afdækning træder i kraft.	Ikke relevant
STSSY 15	Artikel 27, stk. 2, andet afsnit	Godkendt tredjepartsverifikator — erklæring	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, en erklæring om, at opfyldelse af STS-kriterierne blev bekræftet af den pågældende godkendte tredjepart.	Ikke relevant
STSSY 16	Artikel 27, stk. 2, andet afsnit	Godkendt tredjepartsverifikator — hjemland	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, tredjepartens navn og hjemland.	Ikke relevant
STSSY 17	Artikel 27, stk. 2, andet afsnit	Godkendt tredjepartsverifikator — kompetent myndighed	Hvis en godkendt tredjepart har ydet STS-kontroltjenesteydelser i overensstemmelse med artikel 27, stk. 2, i forordning (EU) 2017/2402, navnet på den kompetente myndighed, der har godkendt den.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 18	Artikel 27, stk. 5	STS-status	Hvis relevant, en begrundet meddelelse fra det eksponeringsleverende institut om, at den syntetiske securitisering ikke længere skal anses for at være STS.	Ikke relevant

Specifikke oplysninger

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 19	Artikel 26b, stk. 1, første afsnit	Det eksponeringsleverende institut er en tilsynsbelagt enhed i Unionen	✓			Bekræftelse af, at det eksponeringsleverende institut er en enhed, der er godkendt eller har licens i Unionen.	Ikke relevant
STSSY 20	Artikel 26b, stk. 1, andet afsnit	Eksponeringsleverende institut, som anvender den erhvervede tredjeparts eksponeringspolitikker		✓		En koncis redegørelse for de politikker for kredit, inddrivelse, gældsoplægning og gældsservicering, som det eksponeringsleverende institut anvender på en tredjeparts eksponeringer, som det eksponeringsleverende institut har købt for egen regning og derefter securitiseret, og som ikke må være mindre strenge end dem, som det eksponeringsleverende institut anvender på sammenlignelige eksponeringer, der ikke er blevet købt.	Ikke relevant
STSSY 21	Artikel 26b, stk. 2	Underliggende eksponeringsindgåelse		✓		En koncis redegørelse for, at de underliggende eksponeringer er indgået som en del af det eksponeringsleverende instituts kerneforretningsaktivitet.	Ikke relevant
STSSY 22	Artikel 26b, stk. 3, første afsnit	Aktiver på det eksponeringsleverende instituts balance ved transaktionens afslutning	✓			En bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer ved transaktionens afslutning er opført på balancen hos det eksponeringsleverende institut eller hos en enhed, der tilhører samme koncern som det eksponeringsleverende institut.	Ikke relevant
STSSY 23	Artikel 26b, stk. 3, andet afsnit	Gruppekategori	✓			For så vidt angår felt STSSY 22, en bekræftelse af, hvilken af følgende to grupper der er den relevante: a) en gruppe af juridiske enheder, der er underlagt konsolideringsregler i overensstemmelse med første del, afsnit II, kapitel 2, i forordning (EU) nr. 575/2013	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
						b) en koncern som defineret i artikel 212, stk. 1, litra c), i direktiv 2009/138/EF ⁽¹⁾	
STSSY 24	Artikel 26b, stk. 4	Ingen yderligere afdækning af det eksponeringsleverende instituts eksponering	✓			En bekræftelse af, at det eksponeringsleverende institut ikke afdækker sin eksponering mod den kreditrisiko, der er forbundet med securitiseringens underliggende eksponeringer, ud over den afdækning, der er opnået gennem aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 25	Artikel 26b, stk. 5	Aftale om kreditrisikoafdækning, der opfylder kravene i artikel 249 i forordning (EU) nr. 575/2013	✓			En bekræftelse af, at aftalen om kreditrisikoafdækning er i overensstemmelse med reglerne om kreditrisikoreduktion i artikel 249 i forordning (EU) nr. 575/2013.	Ikke relevant
STSSY 26	Artikel 26b, stk. 5	Aftale om kreditrisikoafdækning, der opfylder andre regler for kreditrisikoreduktion		✓		Hvis artikel 249 i forordning (EU) nr. 575/2013 ikke finder anvendelse, en koncis redegørelse for, at overholdelse af krav, der ikke er mindre strenge end kravene i nævnte artikel, er sikret.	Ikke relevant
STSSY 27	Artikel 26b, stk. 6, litra a)	Erklæringer og garantier — Ejendomsret til de underliggende eksponeringer		✓		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at det eksponeringsleverende institut eller en enhed i den koncern, som det eksponeringsleverende institut tilhører, har fuld juridisk og gyldig ejendomsret til de underliggende eksponeringer og deres tilknyttede accessoriske rettigheder.	Ikke relevant
STSSY 28	Artikel 26b, stk. 6, litra b)	Erklæringer og garantier — Det eksponeringsleverende institut bevarer kreditrisikoen ved de underliggende aktiver		✓		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at det eksponeringsleverende institut eller en enhed, der er omfattet af tilsynet på konsolideret niveau, bevarer kreditrisikoen ved de underliggende eksponeringer på sin balance, hvis det eksponeringsleverende institut er et kreditinstitut som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 1), i forordning (EU) nr. 575/2013 eller et forsikringsselskab som defineret i artikel 13, nr. 1), i direktiv 2009/138/EF.	Ikke relevant

⁽¹⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2009/138/EF af 25. november 2009 om adgang til og udøvelse af forsikrings- og genforsikringsvirksomhed (Solvens II) (EUT L 335 af 17.12.2009, s. 1).

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 29	Artikel 26b, stk. 6, litra c)	Erklæringer og garantier — Eksponering i overensstemmelse med anerkendelseskriterierne		√		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer og garantier for, at hver underliggende eksponering på den dato, hvor den indgår i den securitiserede portefølje, opfylder anerkendelseskriterierne og alle betingelser, bortset fra forekomsten af en kreditbevisenhed som omhandlet i artikel 26e, stk. 1, i forordning (EU) 2017/2402, for en kreditrisikoafdækningsbetaling i overensstemmelse med den aftale om kreditrisikoafdækning, der er indeholdt i securitiseringsdokumentationen.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 30	Artikel 26b, stk. 6, litra d)	Erklæringer og garantier — Retlig forpligtelse for låntager, som kan håndhæves		√		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at kontrakten for hver underliggende eksponering efter det eksponeringsleverende instituts bedste overbevisning indeholder en retlig, gyldig, bindende og retskraftig forpligtelse for låntageren til at betale de pengebeløb, der er angivet i kontrakten.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 31	Artikel 26b, stk. 6, litra e)	Erklæringer og garantier — Bevillingskriterier		√		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at de underliggende eksponeringer opfylder bevillingskriterier, som ikke er mindre strenge end de standardbevillingskriterier, som det eksponeringsleverende institut anvender på lignende eksponeringer, som ikke securitiseres.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 32	Artikel 26b, stk. 6, litra f)	Erklæringer og garantier — Ingen af låntagerne overtræder i væsentlig grad eller misligholder deres forpligtelser		√		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at efter det eksponeringsleverende instituts bedste overbevisning overtræder ingen af låntagerne i væsentlig grad eller misligholder deres forpligtelser, for så vidt angår en underliggende eksponering på den dato, hvor den underliggende eksponering medtages i den securitiserede portefølje af eksponeringer.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 33	Artikel 26b, stk. 6, litra g)	Erklæringer og garantier — Ingen urigtige oplysninger i transaktionsdokumentationen		√		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at transaktionsdokumentationen efter det eksponeringsleverende instituts bedste overbevisning ikke indeholder urigtige oplysninger om detaljerne vedrørende de underliggende eksponeringer.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 34	Artikel 26b, stk. 6, litra h)	Erklæringer og garantier — Håndhævelse eller inddrivelse i forhold til de underliggende eksponeringer		√		En koncis redegørelse for det eksponeringsleverende instituts erklæringer om og garantier for, at kontrakten mellem låntager og den oprindelige långiver i forbindelse med den underliggende eksponering ikke er blevet ændret på en sådan måde, at muligheden for at håndhæve eller inddrive den underliggende eksponering er blevet påvirket ved transaktionens afslutning, eller når en underliggende eksponering indgår i den securitiserede portefølje.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 35	Artikel 26b, stk. 7, første afsnit	Anerkendelseskriterier, som ikke giver mulighed for aktiv porteføljevaltning af de underliggende eksponeringer på et skønsomt grundlag		√		En koncis redegørelse for, at de underliggende eksponeringer opfylder på forhånd fastsatte, klare og veldokumenterede anerkendelseskriterier, som ikke tillader aktiv porteføljevaltning af nævnte eksponeringer på et skønsomt grundlag.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 36	Artikel 26b, stk. 7, andet afsnit	Undtagelse fra forbuddet mod aktiv porteføljevaltning		√		I forbindelse med felt STSSY 35 en koncis redegørelse for, at udskiftning af eksponeringer, der er i modstrid med erklæringer eller garantier, eller, hvis securitiseringen omfatter en genopfyldningsperiode, tilføjelse af eksponeringer, der opfylder de fastlagte betingelser for genopfyldning, ikke skal betragtes som aktiv porteføljevaltning.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 37	Artikel 26b, stk. 7, tredje afsnit	Eksponering tilføjet efter transaktionens afslutningsdato, der opfylder anerkendelseskriterierne		√		En koncis redegørelse for, at enhver eksponering, der tilføjes efter transaktionens afslutningsdato, opfylder anerkendelseskriterier, som ikke er mindre strenge end dem, der blev anvendt ved den første udvælgelse af de underliggende eksponeringer.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 38	Artikel 26b, stk. 7, fjerde afsnit, litra a)	Fuldt ud tilbagebetalt eksponering		√		Hvis de underliggende eksponeringer skal fjernes fra transaktionen, en koncis redegørelse for, at de er blevet fuldt ud tilbagebetalt eller på anden måde udløbet.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 39	Artikel 26b, stk. 7, fjerde afsnit, litra b)	Underliggende eksponeringer, der er blevet afhændet		√		Hvis den underliggende eksponering skal fjernes fra transaktionen, en koncis redegørelse for, at den er blevet afhændet som led i det eksponeringsleverende instituts normale virksomhed, forudsat at en sådan afhændelse ikke udgør implicit støtte som omhandlet i artikel 250 i forordning (EU) nr. 575/2013.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 40	Artikel 26b, stk. 7, fjerde afsnit, litra c)	Ikke kredit-drevet ændring		√		Hvis den underliggende eksponering skal fjernes fra transaktionen, en koncis redegørelse for, at den er genstand for en ændring, der ikke er kredit-drevet, såsom refinansiering eller omstrukturering af gæld, og som finder sted under den normale forvaltning af den pågældende underliggende eksponering.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 41	Artikel 26b, stk. 7, fjerde afsnit, litra d)	Anerkendelseskriterierne ikke opfyldt		√		Hvis den underliggende eksponering skal fjernes fra transaktionen, en koncis redegørelse for, at den ikke opfyldte anerkendelseskriterierne på det tidspunkt, hvor den indgik i transaktionen.	Afsnit 2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 42	Artikel 26b, stk. 8, første afsnit	Aktivernes homogenitet			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan securitiseringen er sikret ved en pulje af underliggende eksponeringer, som er homogene med hensyn til aktivtype. Med henblik herpå henvises der til Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/1851 ⁽²⁾ .	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 43	Artikel 26b, stk. 8, første afsnit	Kun én aktivtype			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan puljen af underliggende eksponeringer kun omfatter én aktivtype.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

⁽²⁾ Kommissionens delegerede forordning (EU) 2019/1851 af 28. maj 2019 om supplerende regler til Europa-Parlamentets og Rådets forordning (EU) 2017/2402 for så vidt angår reguleringsmæssige tekniske standarder for homogeniteten af de underliggende securitiseringseksponeringer (EUT L 285 af 6.11.2019, s. 1).

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 44	Artikel 26b, stk. 8, andet afsnit	Forpligtelser, der er kontraktligt bindende og kan håndhæves		√		En koncis redegørelse for, at de underliggende eksponeringer, der er omhandlet i felt STSSY 42, indeholder forpligtelser, der er kontraktligt bindende og kan håndhæves, med fuld regresret over for låntagere og, hvor det er relevant, garantier.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 45	Artikel 26b, stk. 8, tredje afsnit	Defineret periodisk betaling			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan de underliggende eksponeringer, der er omhandlet i felt STSSY 42, er forbundet med fastsatte periodiske betalingsstrømme, hvis afdrag beløbsmæssigt kan variere, og som er betalinger vedrørende leje, hovedstol eller renter, eller som er relateret til eventuelle andre rettigheder til at modtage indkomst fra aktiver, som understøtter sådanne betalinger.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 46	Artikel 26b, stk. 8, tredje afsnit	Indtægter fra salg af aktiver			√	En detaljeret redegørelse for, hvorvidt og hvordan de underliggende eksponeringer, der er omhandlet i felt STSSY 42, også kan generere indtægter fra salg af finansierede eller leasede aktiver.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 47	Artikel 26b, stk. 8, fjerde afsnit	Ingen omsættelige værdipapirer			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan de underliggende eksponeringer ikke omfatter værdipapirer som defineret i artikel 4, stk. 1, nr. 44), i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU ⁽³⁾ , bortset fra erhvervsobligationer, som ikke er opført i et handelssystem.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 48	Artikel 26b, stk. 9	Ingen resecuritisering	√			En bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer ikke omfatter securitiseringspositioner.	Punkt 2.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

⁽³⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/65/EU af 15. maj 2014 om markeder for finansielle instrumenter og om ændring af direktiv 2002/92/EF og direktiv 2011/61/EU (EUT L 173 af 12.6.2014, s. 349).

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 49	Artikel 26b, stk. 10, første afsnit	Bevillingsstandarder, der er tilgængelige for potentielle investorer	✓			En bekræftelse af, at de bevillingsstandarder, som de underliggende eksponeringer indgås efter, og eventuelle væsentlige ændringer i forhold til forudgående bevillingsstandarder er fuldt tilgængelige for potentielle investorer uden unødigt forsinkelse.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 50	Artikel 26b, stk. 10, første afsnit	Fuld regresret over for en låntager	✓			En bekræftelse af, at de underliggende eksponeringer er bevilget med fuld regresret over for en låntager, der ikke er en SSPE.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 51	Artikel 26b, stk. 10, første afsnit	Bevillingsstandarder — Ingen tredje-mand	✓			En bekræftelse af, at ingen tredjeparter er involveret i kredit- eller bevillingsbeslutninger vedrørende de underliggende eksponeringer.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 52	Artikel 26b, stk. 10, andet afsnit	Bevillingsstandarder — Boliglån	✓			I tilfælde af securitiseringer, hvor de underliggende eksponeringer er boliglån, en bekræftelse af at puljen af lån ikke omfatter lån, som er markedsført og bevilget med den klausul, at låneansøgeren eller, hvor det er relevant, mæglerne er gjort opmærksomme på, at oplysningerne muligvis ikke er verificeret af långiveren.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 53	Artikel 26b, stk. 10, tredje afsnit	Bevillingsstandarder — Vurdering af låntager	✓			Bekræftelse af, at vurderingen af låntagerens kreditværdighed opfylder kravene i artikel 8 i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2008/48/EF ⁽⁴⁾ eller artikel 18, stk. 1-4, artikel 18, stk. 5, litra a), og artikel 18, stk. 6, i Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/17/EU ⁽⁵⁾ eller, hvor det er relevant, tilsvarende krav i tredje-lande.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

⁽⁴⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2008/48/EF af 23. april 2008 om forbrugerkreditaftaler og om ophævelse af Rådets direktiv 87/102/EØF (EUT L 133 af 22.5.2008, s. 66).

⁽⁵⁾ Europa-Parlamentets og Rådets direktiv 2014/17/EU af 4. februar 2014 om forbrugerkreditaftaler i forbindelse med fast ejendom til beboelse og om ændring af direktiv 2008/48/EF og 2013/36/EU og forordning (EU) nr. 1093/2010 (EUT L 60 af 28.2.2014, s. 34).

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 54	Artikel 26b, stk. 10, fjerde afsnit	Ekspertise hos det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver	✓			En bekræftelse af, at det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver har erfaring med indgåelse af eksponeringer af samme art som de securitiserede.	Punkt 2.2.7 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 55	Artikel 26b, stk. 11, litra a)	Ingen eksponeringer ved misligholdelse		✓		En koncis redegørelse for, at de underliggende eksponeringer på tidspunktet for udvælgelsen ikke omfatter misligholdte eksponeringer som omhandlet i artikel 178, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller eksponeringer mod en kreditforringet låntager eller garant, som efter det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers bedste overbevisning er blevet erklæret insolvent, eller hvis kreditorer ved en domstol er givet en endelig ret til tvangsinddrivelse, som ikke kan appelleres, eller erstatning som følge af den manglende betaling inden for tre år forud for indgåelsesdatoen, eller som har gennemgået en gældsomlægningsproces for så vidt angår vedkommendes misligholdte eksponeringer inden for tre år forud for datoen for udvælgelse af de underliggende eksponeringer, medmindre: i) en omlagt underliggende eksponering ikke har frembragt nye restancer efter datoen for omlægningen, der skal have fundet sted mindst ét år forud for datoen for udvælgelse af de underliggende eksponeringer, eller ii) de oplysninger, som det eksponeringsleverende institut gør tilgængelige i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra a), og litra e), nr. i), i forordning (EU) 2017/2402 udtrykkeligt fastsætter andelen af omlagte underliggende eksponeringer, tidspunktet for og nærmere oplysninger om omlægningen og deres udvikling efter datoen for omlægningen. Hvis en af disse to undtagelser finder anvendelse, gives en koncis redegørelse herfor.	Punkt 2.2.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Feltnavn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 56	Artikel 26b, stk. 11, litra b)	Ingen negativ kredithistorik		√		En koncis redegørelse for, at de underliggende eksponeringer på tidspunktet for udvælgelsen ikke omfatter misligholdte eksponeringer som omhandlet i artikel 178, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller eksponeringer mod en kreditforringet låntager eller garant, som efter det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers bedste overbevisning på tidspunktet for indgåelsen af den underliggende eksponering, hvor det er relevant, fandtes i et offentligt kreditregister over personer med negativ kredithistorik eller, hvis et sådant offentligt register ikke findes, et andet kreditregister, som er tilgængeligt for det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver.	Ikke relevant
STSSY 57	Artikel 26b, stk. 11, litra c)	Risikoen for manglende betaling er ikke højere end for ikke-securitiserings-eksponeringer		√		En koncis redegørelse for, at de underliggende eksponeringer på tidspunktet for udvælgelsen ikke omfatter misligholdte eksponeringer som omhandlet i artikel 178, stk. 1, i forordning (EU) nr. 575/2013 eller eksponeringer mod en kreditforringet låntager eller garant, som efter det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers bedste overbevisning har en kreditvurdering, som indikerer, at risikoen for, at kontraktmæssigt aftalte betalinger, der ikke erlægges, er væsentligt højere end for sammenlignelige eksponeringer, som det eksponeringsleverende institut besidder, og som ikke securitiseres.	Ikke relevant
STSSY 58	Artikel 26b, stk. 12	Mindst én betaling foretaget på tidspunktet for medtagelsen af de underliggende aktiver	√			En bekræftelse af, at låntagere på tidspunktet for medtagelsen af de underliggende eksponeringer har foretaget mindst én betaling, medmindre:	Punkt 3.3 og 3.4.6 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
						a) securitiseringen er en revolverende securitisering sikret ved eksponeringer, som afvikles med et enkelt afdrag, eller som har en restløbetid på mindre end ét år, herunder uden begrænsning månedlige betalinger på revolverende kreditter, eller b) eksponeringen repræsenterer refinansieringen af en eksponering, der allerede indgår i transaktionen. Hvis en af disse to undtagelser finder anvendelse, gives en koncis redegørelse herfor.	
STSSY 59	Artikel 26c, stk. 1	Opfyldelse af krav om risikotilbageholdelse			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan det eksponeringsleverende institut eller den oprindelige långiver opfylder kravene om risikotilbageholdelse i overensstemmelse med artikel 6 i forordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.1 i bilag 9 og punkt 3.4.3 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 60	Artikel 26c, stk. 2, første afsnit	Reduktion af rente- og valutarisici	√			Bekræftelse af, at: a) rente- og valutarisici, som opstår ved en securitisering, og deres mulige indvirkning på betalingerne til det eksponeringsleverende institut og investorerne er beskrevet i transaktionsdokumentationen b) disse risici afbødes på passende vis, og investorerne oplyses om alle foranstaltninger, der træffes med henblik herpå.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY61	Artikel 26c, stk. 2, første afsnit	Kreditrisikoafdækning og kreditrisikoafdeckningsbetaling denomineret i samme valuta	√			En bekræftelse af, at enhver sikkerhedsstillelse, der sikrer investors forpligtelser i henhold til aftalen om kreditrisikoafdækning, er denomineret i den samme valuta, som kreditrisikoafdeckningsbetalingen er denomineret i.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 62	Artikel 26c, stk. 2, andet afsnit	SSPE'ens forpligtelser er lig med eller mindre end SSPE'ens indtægter		√		En koncis redegørelse for, at i tilfælde af en securitisering, der anvender en SSPE, skal størrelsen af SSPE'ens forpligtelser vedrørende rentebetalinger til investorerne på hver betalingsdato være lig med eller mindre end beløbet for SSPE'ens indtægter fra det eksponeringsleverende institut og enhver aftale om sikkerhedsstillelse.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 63	Artikel 26c, stk. 2, tredje afsnit	Der anvendes ingen derivater, undtagen til afdækning af rente- eller valutarisici	√			En bekræftelse af, at puljen af underliggende eksponeringer ikke omfatter derivater, undtagen med henblik på afdækning af rente- eller valutarisici i forbindelse med de underliggende eksponeringer.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 64	Artikel 26c, stk. 2, tredje afsnit	Anvendelse af derivater baseret på fælles standarder		√		En koncis redegørelse for, at hvis undtagelsen i felt STSSY 63 finder anvendelse, bevilges og dokumenteres ethvert anvendt derivat i henhold til almindeligt anerkendte standarder.	Punkt 3.4.2 og 3.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 65	Artikel 26c, stk. 3, første og andet afsnit	Refererede rentebetalinger baseret på almindeligt anvendte rentesatser uden komplekse formler eller derivater		√		I tilfælde af eventuelle refererede rentebetalinger i forbindelse med transaktionen en koncis redegørelse for, hvilken af følgende rentebetalinger der henvises til: a) almindeligt anvendte markedsrentesatser eller almindeligt anvendte sektorbestemte rentesatser, der afspejler finansieringsomkostningerne og ikke knyttes til komplekse formler eller derivater, eller b) indtægter fra den sikkerhedsstillelse, der sikrer investorens forpligtelser i henhold til aftalen om kreditrisikoaf-dækning. En koncis redegørelse for, at alle refererede forfaldne rentebetalinger vedrørende underliggende eksponeringer er baseret på almindeligt anvendte markedsrentesatser eller almindeligt anvendte sektorbestemte rentesatser, der afspejler finansieringsomkostningerne, og som ikke må knyttes til komplekse formler eller derivater.	Punkt 2.2.2 og 2.2.13 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 66	Artikel 26c, stk. 4, første afsnit	Fyldestgørelsesgrund, uden at dette berører investorens håndhævelsesforanstaltninger		√		En koncis redegørelse for, at investoren har tilladelse til at træffe håndhævelsesforanstaltninger, når der indtræffer en fyldestgørelsesgrund over for det eksponeringsleverende institut.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 67	Artikel 26c, stk. 4, andet afsnit	Håndhævelse af aftalen om kreditrisikoafdækning — Intet kontantbeløb tilbageholdes i SSPE'en		√		I tilfælde af en securitisering, der anvender en SSPE, hvor der er udstedt påkrav eller givet meddelelse om opsigelse af aftalen om kreditrisikoafdækning, en koncis redegørelse for, at intet kontantbeløb må tilbageholdes i SSPE'en ud over det nødvendige for at sikre den operationelle funktion af den pågældende SSPE, betaling af kreditrisikoafdningsbetalinger for misligholdte underliggende eksponeringer, der stadig er ved at blive omlagt på tidspunktet for opsigelsen, eller den velordnede tilbagebetaling til investorerne i overensstemmelse med kontraktvilkårene i securitiseringen.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 68	Artikel 26c, stk. 5, første afsnit	Tab fordelt efter rangorden		√		En koncis redegørelse for, at tab allokeres til indehaverne af en securitiseringsposition efter tranchernes rangorden, begyndende med den mest efterstillede tranche.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 69	Artikel 26c, stk. 5, andet afsnit	Sekventielle afdrag		√		En koncis redegørelse for, at sekventielle afdrag anvendes på alle trancher for at bestemme det udestående beløb for trancherne på hver betalingsdato, begyndende med den mest foranstillede tranche.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 70	Artikel 26c, stk. 5, tredje afsnit	Ikkesekventiel prioritering af betalinger		√		Uanset felt STSSY 69 en koncis redegørelse for, at transaktioner kendetegnet ved ikkesekventiel prioritering af betalinger omfatter hændelser, der er relateret til udviklingen i de underliggende eksponeringer, der medfører, at prioriteringen af betalinger igen ændres til sekventiel prioritering af betalinger.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ **M1**

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Feltnavn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 71	Artikel 26c, stk. 5, tredje afsnit, litra a)	Udviklingsrelaterede udløsningsmekanismer			√	Detaljeret redegørelse for den obligatoriske udviklingsrelaterede udløsningsmekanisme, der er omhandlet i felt STSSY 70, som enten er stigningen i det kumulative beløb for misligholdte eksponeringer eller stigningen i de kumulative tab, der er større end en given procentdel af det udestående beløb i den underliggende portefølje.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 72	Artikel 26c, stk. 5, tredje afsnit, litra b)	Udviklingsrelaterede udløsningsmekanismer			√	Detaljeret redegørelse for den yderligere bagudrettede udviklingsrelaterede udløsningsmekanisme, der er omhandlet i felt STSSY 70.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 73	Artikel 26c, stk. 5, tredje afsnit, litra c)	Udviklingsrelaterede udløsningsmekanismer			√	Detaljeret redegørelse for den fremadrettede udviklingsrelaterede udløsningsmekanisme, der er omhandlet i felt STSSY 70.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 74	Artikel 26c, stk. 5, syvende afsnit	Sikkerhedsstillelse svarende til beløbet for trancher, der afdrages		√		Koncis redegørelse for, at efterhånden som trancherne afdrages, tilbagebetales en del af sikkerhedsstillelsen, der svarer til afdragene på disse trancher, til investorerne, forudsat at investorerne har sikret disse trancher.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 75	Artikel 26c, stk. 5, ottende afsnit	Kreditbegivenhed indtruffet og kreditrisikoafdækningsbeløb til rådighed på enhver betalingsdato		√		En koncis redegørelse for, at hvis en kreditbegivenhed som omhandlet i felt STSSY 100 eller STSSY 101 er indtruffet i forbindelse med underliggende eksponeringer, og gældsomlægningen for disse eksponeringer ikke er afsluttet, svarer det kreditrisikoafdækningsbeløb, der er tilbage på enhver betalingsdato, mindst til den udestående nominale værdi af disse underliggende eksponeringer, minus værdien af eventuelle mellemliggende betalinger foretaget i relation til de pågældende underliggende eksponeringer.	Punkt 3.4.5 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ **M1**

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 76	Artikel 26c, stk. 6, litra a)	Førtidsindfrielsesbestemmelser eller -udløsningsmekanismer — Kreditkvalitet		√		Hvis en securitisering er en revolverende securitisering, en koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen omfatter passende førtidsindfrielsesbestemmelser eller -udløsningsmekanismer for afslutning af den revolverende periode i tilfælde af en forringelse af de underliggende eksponeringers kreditkvalitet til eller under en på forhånd fastsat tærskel.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 77	Artikel 26c, stk. 6, litra b)	Førtidsindfrielsesbestemmelser eller -udløsningsmekanismer — Tab		√		Hvis en securitisering er en revolverende securitisering, en koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen omfatter passende førtidsindfrielsesbestemmelser eller -udløsningsmekanismer for afslutning af den revolverende periode i tilfælde af en stigning i tabene til over en på forhånd fastsat tærskel.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 78	Artikel 26c, stk. 6, litra c)	Førtidsindfrielsesbestemmelser eller -udløsningsmekanismer — Nye eksponeringer		√		Hvis en securitisering er en revolverende securitisering, en koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen omfatter passende førtidsindfrielsesbestemmelser eller -udløsningsmekanismer for afslutning af den revolverende periode i tilfælde af, at der ikke genereres tilstrækkeligt med nye underliggende eksponeringer, som opfylder den på forhånd fastlagte kreditkvalitet inden for en nærmere fastsat periode.	Punkt 2.3 og 2.4 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 79	Artikel 26c, stk. 7, litra a)	Aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar — Administrationsselskab		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen klart specificerer administrationsselskabets kontraktlige forpligtelser, opgaver og ansvar.	Punkt 3.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 80	Artikel 26c, stk. 7, litra a)	Aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar — Trustee		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen klart specificerer de kontraktlige forpligtelser, opgaver og ansvar, som trustee og andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser har.	Punkt 3.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 81	Artikel 26c, stk. 7, litra a)	Aftalemæssige forpligtelser, opgaver og ansvar — Tredjeparts-kontrolagent		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen klart specificerer de kontraktlige forpligtelser, opgaver og ansvar, som den i felt STSSY 126 omhandlede tredjeparts-kontrolagent har.	Punkt 3.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 82	Artikel 26c, stk. 7, litra b)	Udskiftning af udbydere af tjenesteydelser i tilfælde af misligholdelse eller insolvens		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen klart angiver de bestemmelser, der sikrer udskiftning af administrations-selskabet, trustee, andre udbydere af accessoriske tjenesteydelser eller tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, i tilfælde af misligholdelse eller insolvens hos en af disse udbydere af tjenesteydelser, hvis disse udbydere af tjenesteydelser adskiller sig fra det eksponeringslevende institut, på en måde, der ikke medfører, at leveringen af disse tjenesteydelser ophører.	Punkt 3.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 83	Artikel 26c, stk. 7, litra c)	Forvaltnings-procedurer		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen klart angiver de forvaltnings-procedurer, der gælder for de underliggende eksponeringer på transaktionens afslutningsdato og derefter, og de omstændigheder, hvorunder disse procedurer kan ændres.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 84	Artikel 26c, stk. 7, litra d)	Forvaltnings-standards		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen klart angiver de forvaltnings-standards, som administrations-selskabet er forpligtet til at overholde ved forvaltning af de underliggende eksponeringer i hele securitiseringens levetid.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 85	Artikel 26c, stk. 8, første afsnit	Krav til administrations-selskabet om ekspertise		√		En koncis redegørelse for, at administrations-selskabet har ekspertise inden for forvaltning af eksponeringer af samme art som de securitiserede eksponeringer.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980

▼ **M1**

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 86	Artikel 26c, stk. 8, første afsnit	Veldokumenterede og passende politikker, procedurer og risikostyringskontroller	✓			En bekræftelse af, at administrationsselskabet har veldokumenterede og passende politikker, procedurer og risikostyringskontroller i forbindelse med forvaltning af eksponeringer.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 87	Artikel 26c, stk. 8, andet afsnit	Forvaltningsprocedurer, der er mindst lige så strenge som dem, der anvendes på lignende ikke-securitiserede eksponeringer	✓			En koncis redegørelse for, at administrationsselskabet anvender forvaltningsprocedurer på de underliggende eksponeringer, der er mindst lige så strenge som dem, der anvendes af det eksponeringsleverende institut på tilsvarende eksponeringer, som ikke securitiseres.	Punkt 3.4.6 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 88	Artikel 26c, stk. 9	Referenceregister			✓	En detaljeret redegørelse for, hvordan det eksponeringsleverende institut til enhver tid fører et ajourført referenceregister til identifikation af de underliggende eksponeringer.	Ikke relevant
STSSY 89	Artikel 26c, stk. 9	Referenceregister — Indhold		✓		En koncis redegørelse for, at det referenceregister, der er omhandlet i felt STSSY 88, identificerer referencelåntagerne, de referenceforpligtelser, som de underliggende eksponeringer hidrører fra, og for hver underliggende eksponering den nominelle værdi, der er afdækket, og som er udestående.	Ikke relevant
STSSY 90	Artikel 26c, stk. 10	Rettidig løsning af konflikter mellem forskellige investorklasser	✓			En bekræftelse af, at transaktionsdokumentationen indeholder klare bestemmelser, der letter den rettidige løsning af konflikter mellem forskellige investorklasser.	Punkt 3.4.7 og 3.4.8 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 91	Artikel 26c, stk. 10	SSPE — Klart definerede stemmerettigheder	✓			En bekræftelse af, at stemmerettigheder i tilfælde af en securitisering, der anvender en SSPE, er klart defineret og tildelt obligationsindehaverne, og at det ansvar, som påhviler trustee og andre enheder med betroede opgaver over for investorerne, er klart identificeret.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 92	Artikel 26d, stk. 1	Data vedrørende historisk misligholdelse og tabsudvikling	✓			En bekræftelse af, at data om statiske og dynamiske historiske misligholdelses- og tabsresultater såsom data om overtrædelser og misligholdelse (der dækker en periode på mindst 5 år) for eksponeringer, der i alt væsentligt svarer til dem, der securitiseres, og at kilderne til disse data og kriterierne for at sidestille gøres tilgængelige for potentielle investorer forud for prisfastsættelsen.	Punkt 2.2.2 i bilag 19 til delegeret forordning (EU) 2019/980
STSSY 93	Artikel 26d, stk. 2	Stikprøve af de underliggende eksponeringer, som skal kontrolleres af en ekstern instans	✓			En bekræftelse af, at en stikprøve af de underliggende eksponeringer skal kontrolleres af en relevant og uafhængig ekstern instans forud for afslutningen af transaktionen, idet det bl.a. undersøges, om de underliggende eksponeringer kan omfattes af kreditrisikoafdækning i henhold til aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 94	Artikel 26d, stk. 3	»Liability cash flow«-model tilgængelig for potentielle investorer	✓			En bekræftelse af, at det eksponeringsleverende institut forud for fastsættelsen af prisen på securitiseringen gør en »liability cash flow«-model tilgængelig for potentielle investorer, som netop repræsenterer det kontraktmæssige forhold mellem de underliggende eksponeringer og de betalinger, der finder sted mellem det eksponeringsleverende institut, investorer, andre tredjeparter og, hvis det er relevant, SSPE'en, og af, at nævnte model efter prisfastsættelsen gøres tilgængelig for investorer på løbende basis og for potentielle investorer efter anmodning.	Ikke relevant
STSSY 95	Artikel 26d, stk. 4, første afsnit	Offentliggørelse af oplysninger om miljøpræstationer for underliggende eksponeringer, som består af boliglån eller billån eller billeasingaftaler		✓		I tilfælde af en securitisering, hvor de underliggende eksponeringer er boliglån eller billån eller billeasingaftaler, og medmindre undtagelsen i felt STSSY 96 finder anvendelse, en koncis redegørelse for, at det eksponeringsleverende institut stiller oplysninger om miljøpræstationerne for de aktiver, der finansieres af lånene, til rådighed som en del af de oplysninger, der offentliggøres i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra a), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 96	Artikel 26d, stk. 4, andet afsnit	Undtagelse fra kravet om at offentliggøre de oplysninger om miljøpræstationer for underliggende eksponeringer, som består af boliglån eller billån eller billeasingaftaler		✓		Hvis det eksponeringsleverende institut beslutter at fravige kravet i felt STSSY 95, en koncis redegørelse for, at det eksponeringsleverende institut offentliggør de tilgængelige oplysninger om de vigtigste negative virkninger af de aktiver, der finansieres af de underliggende eksponeringer, på bæredygtighedsfaktorer.	Ikke relevant
STSSY 97	Artikel 26d, stk. 5	Det eksponeringsleverende institut, som er ansvarligt for overholdelse af artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402	✓			En bekræftelse af, at det organiserende institut er ansvarligt for overholdelse af artikel 7 i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSSY 98	Artikel 26d, stk. 5	Oplysninger om artikel 7, stk. 1, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 tilgængelige for potentielle investorer	✓			En bekræftelse af, at de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra a), i forordning (EU) 2017/2402, gøres tilgængelige for potentielle investorer forud for prisfastsættelsen efter anmodning.	Ikke relevant
STSSY 99	Artikel 26d, stk. 5	Oplysninger om artikel 7, stk. 1, litra b), c) og d), i forordning (EU) 2017/2402, som er tilgængelige for potentielle investorer, i det mindste i udkast eller foreløbig form	✓			En bekræftelse af, at de oplysninger, der kræves i henhold til artikel 7, stk. 1, første afsnit, litra b), c) og d), i forordning (EU) 2017/2402, gøres tilgængelige forud for prisfastsættelsen i det mindste i udkast eller foreløbig form, og at den endelige dokumentation derefter gøres tilgængelig for investorerne senest 15 dage efter transaktionens afslutning.	Ikke relevant
STSSY 100	Artikel 26e, stk. 1, tredje afsnit, litra a)	Kreditbegivenheder og anvendelse af garantier		✓		Hvis risikooverførslen opnås ved brug af garantier, en koncis redegørelse for, at aftalen om kreditrisikoafdækning som minimum dækker de kreditbegivenheder, der er omhandlet i artikel 215, stk. 1, litra a), i forordning (EU) nr. 575/2013.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 101	Artikel 26e, stk. 1, første afsnit, litra b)	Kreditbegivenheder og anvendelse af kreditderivater		√		Hvis risikooverførslen opnås ved brug af kreditderivater, en koncis redegørelse for, at kreditaftalen som minimum dækker de kreditbegivenheder, der er omhandlet i artikel 216, stk. 1, litra a), i forordning (EU) nr. 575/2013.	Ikke relevant
STSSY 102	Artikel 26e, stk. 1, andet afsnit	Aftale om kreditrisikoafdækning dokumenteret		√		En koncis redegørelse for, at alle kreditbegivenheder er dokumenteret.	Ikke relevant
STSSY 103	Artikel 26e, stk. 1, tredje afsnit	Kreditlempler udelukker ikke udløsning af anerkendte kreditbegivenheder		√		En koncis redegørelse for, at de kreditlempler i henhold til artikel 47b i forordning (EU) nr. 575/2013, der anvendes på de underliggende eksponeringer, ikke udelukker udløsning af anerkendte kreditbegivenheder.	Ikke relevant
STSSY 104	Artikel 26e, stk. 2, første afsnit	Kreditrisikoafdækningsbetaling baseret på faktiske realiserede tab og standardinddrivelsespolitikker og -procedurer		√		En koncis redegørelse for, at kreditrisikoafdækningsbetalingen efter en kreditbegivenhed beregnes på grundlag af det eksponeringsleverende instituts eller den oprindelige långivers faktiske realiserede tab, der er fremkommet i overensstemmelse med deres standardinddrivelsespolitikker og -procedurer for de relevante eksponeringstyper, og som er registreret i deres regnskaber på det tidspunkt, hvor betalingen foretages.	Ikke relevant
STSSY 105	Artikel 26e, stk. 2, første afsnit	Kreditrisikoafdækningsbetalingens forfald til betaling inden for et nærmere fastsat tidsrum		√		En koncis redegørelse for, at den endelige kreditrisikoafdækningsbetaling forfalder til betaling inden for et nærmere fastsat tidsrum efter gældsomlægningen for den relevante underliggende eksponering, hvis gældsomlægningen er afsluttet for det planlagte ubetingede udløb eller førtidige ophør af aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 106	Artikel 26e, stk. 2, første afsnit	Foreløbig kreditrisikoafdækningsbetaling senest seks måneder efter en kreditbegivenhed		√		I tilfælde, hvor gældsomlægningen af tabene for den relevante underliggende eksposering ikke er afsluttet ved udgangen af den periode på seks måneder, der er omhandlet i artikel 26e, stk. 2, andet afsnit, i forordning (EU) 2017/2402, en koncis redegørelse for, at der foretages en foreløbig kreditrisikoafdækningsbetaling senest seks måneder, efter at en kreditbegivenhed, jf. felt STSSY100 og STSSY101, er indtruffet.	Ikke relevant
STSSY 107	Artikel 26e, stk. 2, andet afsnit, litra a) og b)	Foreløbig kreditrisikoafdækningsbetaling højere end det gældende forventede tab		√		En koncis redegørelse for, at den foreløbige kreditrisikoafdækningsbetaling som minimum er den højeste af følgende: a) det forventede tab, som svarer til den værdiforringelse, som er registreret af det eksponeringsleverende institut i dets regnskaber i overensstemmelse med de gældende regnskabsregler på det tidspunkt, hvor den foreløbige betaling foretages, under forudsætning af, at aftalen om kreditrisikoafdækning ikke eksisterer og ikke dækker noget tab eller, b) hvis det er relevant, det forventede tab fastlagt i overensstemmelse med tredje del, afsnit II, kapitel 3, i forordning (EU) nr. 575/2013.	Ikke relevant
STSSY 108	Artikel 26e, stk. 2, tredje afsnit	Vilkår for den foreløbige kreditrisikoafdækningsbetaling		√		Hvis der foretages en foreløbig kreditrisikoafdækningsbetaling, en koncis redegørelse for, at der foretages den i felt STSSY 106 omhandlede endelige kreditrisikoafdækningsbetaling for at tilpasse den foreløbige afregning af tab til det faktiske realiserede tab.	Ikke relevant
STSSY 109	Artikel 26e, stk. 2, fjerde afsnit	Metode til beregning af foreløbige og endelige kreditrisikoafdækningsbetalinger		√		En koncis redegørelse for, at metoden til beregning af foreløbige og endelige kreditrisikoafdækningsbetalinger er angivet i aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 110	Artikel 26e, stk. 2, femte afsnit	Kreditrisikoafdækningsbetaling, som står i forhold til delen af den udestående nominelle værdi		√		En koncis redegørelse for, at kreditrisikoafdækningsbetalingen står i forhold til den del af den udestående nominelle værdi af den tilsvarende underliggende eksponering, som er omfattet af aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 111	Artikel 26e, stk. 2, sjette afsnit	Håndhævelse af kreditrisikoafdækningsbetalingen		√		En koncis redegørelse for, at det eksponeringsleverende institut ret til at modtage kreditrisikoafdækningsbetalingen kan håndhæves.	Ikke relevant
STSSY 112	Artikel 26e, stk. 2, sjette afsnit	Det beløb, som investorerne skal betale i henhold til aftalen om kreditrisikoafdækning, er fastsat i aftalen om kreditrisikoafdækning.		√		En koncis redegørelse for, at det beløb, som investorer skal betale i henhold til aftalen om kreditrisikoafdækning, er klart fastsat i aftalen om kreditrisikoafdækning og begrænset.	Ikke relevant
STSSY 113	Artikel 26e, stk. 2, sjette afsnit	Beregning af beløbene uanset omstændighederne		√		En koncis redegørelse for, at det under alle omstændigheder er muligt at beregne de beløb, som investorerne skal betale i henhold til aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 114	Artikel 26e, stk. 2, sjette afsnit	Betingelser for investorers betalinger fastsat i aftalen om kreditrisikoafdækning.		√		En koncis redegørelse for, at aftalen om kreditrisikoafdækning klart fastsætter, under hvilke omstændigheder investorerne skal foretage betalinger.	Ikke relevant
STSSY 115	Artikel 26e, stk. 2, sjette afsnit	Tredjeparts-kontrolagentens vurdering af omstændigheder, der udløser investorers betalinger		√		En koncis redegørelse for, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, vurderer, om de omstændigheder, der er fastsat i aftalen om kreditrisikoafdækning, i henhold til hvilken investorer skal foretage betalinger, er indtruffet.	Ikke relevant
STSSY 116	Artikel 26e, stk. 2, syvende afsnit	Kreditrisikoafdækningsbetaling beregnet for den enkelte underliggende eksponering.		√		En koncis redegørelse for, at beløbet for kreditrisikoafdækningsbetalingen beregnes for den enkelte underliggende eksponering, for hvilken en kreditbegivenhed er indtruffet.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 117	Artikel 26e, stk. 3, første afsnit	Præcisering af den maksimale forlængelsesperiode for gældsoplægningsprocessen		√		En koncis redegørelse for, at aftalen om kreditrisikoafdækning angiver den maksimale forlængelsesperiode, som gælder for gældsoplægningsprocessen for underliggende eksponeringer, i forbindelse med hvilke der er indtruffet en kreditbegivenhed som omhandlet i artikel 26e, stk. 1 i forordning (EU) 2017/2402, men hvor gældsoplægningen ikke er afsluttet før det planlagte ubetingede udløb eller førtidige ophør af aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 118	Artikel 26e, stk. 3, første afsnit	Forlængelsesperiode på mindre end to år		√		En koncis redegørelse for, at den forlængelsesperiode, der er omhandlet i felt STSSY 117, ikke er længere end to år.	Ikke relevant
STSSY 119	Artikel 26e, stk. 3, første afsnit	Endelig kreditrisikoafdækningsbetaling baseret på det eksponeringsleverende instituts endelige tabsskøn		√		En koncis redegørelse for, at aftalen om kreditrisikoafdækning foreskriver, at der ved udløbet af den i felt STSSY 117 omhandlede forlængelsesperiode foretages en endelig kreditrisikoafdækningsbetaling på grundlag af det eksponeringsleverende instituts endelige tabsskøn, som registreres af det eksponeringsleverende institut i dets regnskaber på det pågældende tidspunkt, under forudsætning af at aftalen om kreditrisikoafdækning ikke eksisterer og ikke dækker noget tab.	Ikke relevant
STSSY 120	Artikel 26e, stk. 3, andet afsnit	Ophør af aftalen om kreditrisikoafdækning		√		I tilfælde af at aftalen om kreditrisikoafdækning ophører, en koncis redegørelse for, at gældsoplægningen fortsætter for så vidt angår udestående kreditbegivenheder, der indtraf før ophøret, på samme måde som den, der er beskrevet i artikel 26e, stk. 3, første afsnit, i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSSY 121	Artikel 26e, stk. 3, tredje afsnit	Kreditrisikoafdækningspræmier betinget af det udestående nominelle beløb		√		En koncis redegørelse for, at de kreditrisikoafdækningspræmier, der skal betales i henhold til aftalen om kreditrisikoafdækning, er struktureret som betinget af den udestående nominelle værdi af de ikkemisligholdte securitiserede eksponeringer på betalingstidspunktet og afspejler risikoen ved den afdækkede tranche.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 122	Artikel 26e, stk. 3, tredje afsnit	Aftale om kreditrisikoafdækning fastsætter ikke mekanismer, der kan forhindre eller reducere den faktiske fordeling af tab til investorerne		√		En koncis redegørelse for, at aftalen om kreditrisikoafdækning med henblik på felt STSSY 117 ikke foreskriver garanterede præmier, forudgående præmiebetalinger, rabatordninger eller andre mekanismer, der kan forhindre eller begrænse den faktiske fordeling af tab til investorerne eller tilbageføre en del af de betalte præmier til det eksponeringsleverende institut efter transaktionens udløb.	Ikke relevant
STSSY 123	Artikel 26e, stk. 3, fjerde afsnit	Undtagelse for forudgående præmiebetalinger		√		Hvis garantiordningen, uanset felt STSSY 121 og STSSY 122, er specifikt fastsat i en medlemsstats nationale lovgivning og omfattet af en regaranti fra en af de enheder, der er anført i artikel 214, stk. 2, litra a) -d), i forordning (EU) nr. 575/2013, en kortfattet redegørelse for, at de forudgående præmiebetalinger er tilladt, forudsat at statsstøttereglerne overholdes.	Ikke relevant
STSSY 124	Artikel 26e, stk. 3, femte afsnit	Beskrivelse af kreditrisikoafdækningspræmien i transaktionsdokumentationen		√		En koncis redegørelse for, at det i transaktionsdokumentationen beskrives, hvordan kreditrisikoafdækningspræmien og eventuelle relaterede kuponer beregnes for hver betalingsdato i hele securitiseringens løbetid.	Ikke relevant
STSSY 125	Artikel 26e, stk. 3, sjette afsnit	Håndhævelse af investorerrettigheder		√		En koncis redegørelse for, at investorernes ret til at modtage kreditrisikoafdækningspræmier kan håndhæves.	Ikke relevant
STSSY 126	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit	Udpegelse af en tredjepartskontrolagent inden transaktionens slutdato	√			En bekræftelse af, at det eksponeringsleverende institut inden transaktionens slutdato udpeger en tredjepartskontrolagent.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Feltnavn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 127	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra a)	Tredjeparts-kontrolagentens kontrol — Kreditbegivenhed angivet i betingelserne i aftalen om kreditrisikoafdækning	✓			En bekræftelse af, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, for hver af de underliggende eksponeringer, for hvilke der gives meddelelse om kreditbegivenheder, kontrollerer, at der er tale om en kreditbegivenhed som angivet i betingelserne i aftalen om kreditrisikoafdækning.	Ikke relevant
STSSY 128	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra b)	Tredjeparts-kontrolagentens kontrol — Underliggende eksponering indgår i referenceporteføljen	✓			For hver af de underliggende eksponeringer, for hvilke der er givet meddelelse om en kreditbegivenhed, en bekræftelse af, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, kontrollerer, at den underliggende eksponering indgik i referenceporteføljen på det tidspunkt, hvor den pågældende kreditbegivenhed indtraf.	Ikke relevant
STSSY 129	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra c)	Tredjeparts-kontrolagentens kontrol — Anvendelseskriterier opfyldt på tidspunktet for optagelse i referenceporteføljen	✓			For hver af de underliggende eksponeringer, for hvilke der er givet meddelelse om en kreditbegivenhed, en bekræftelse af, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, kontrollerer, at den underliggende eksponering opfyldte anerkendelseskriterierne på det tidspunkt, hvor den blev optaget i referenceporteføljen.	Ikke relevant
STSSY 130	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra d)	Tredjeparts-kontrolagentens kontrol — Overholdelse af betingelserne for genopfyldning	✓			For hver af de underliggende eksponeringer, for hvilke der er givet meddelelse om en kreditbegivenhed, en bekræftelse af, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, kontrollerer, at den pågældende genopfyldning, hvis en underliggende eksponering er blevet tilføjet securitiseringen som følge af en genopfyldning, opfylder betingelserne for genopfyldning.	Ikke relevant
STSSY 131	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra e)	Tredjeparts-kontrolagentens kontrol — Tab i overensstemmelse med det eksponeringsleverende instituts resultatopgørelse	✓			For hver af de underliggende eksponeringer, for hvilke der er givet meddelelse om en kreditbegivenhed, en bekræftelse af, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, kontrollerer, at det endelige tab er i overensstemmelse med de tab, som det eksponeringsleverende institut har registreret på sin resultatopgørelse.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 132	Artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra f)	Tredjeparts-kontrolagentens kontrol — Tab korrekt allokeret til investorer	✓			For hver af de underliggende eksponeringer, for hvilke der er givet meddelelse om en kreditbegivenhed, en bekræftelse af, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, kontrollerer, at på det tidspunkt, hvor den endelige kreditrisikoafdækningsbetaling foretages, er tabene i forbindelse med de underliggende eksponeringer blevet korrekt allokeret til investorerne.	Ikke relevant
STSSY 133	Artikel 26e, stk. 4, andet afsnit	Tredjeparts-kontrolagent er uafhængig af eksponeringsleverende institutter, investorer og (hvis relevant) SSPE'en		✓		En koncis redegørelse for, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY126, er uafhængig af det eksponeringsleverende institut og investorerne og, hvor det er relevant, af SSPE'en.	Ikke relevant
STSSY 134	Artikel 26e, stk. 4, andet afsnit	Udpegelse af tredjeparts-kontrolagenten inden slutdatoen		✓		En koncis redegørelse for, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY126, har accepteret udpegelsen som tredjeparts-kontrolagent inden transaktionens slutdato.	Ikke relevant
STSSY 135	Artikel 26e, stk. 4, tredje afsnit	Tredjeparts-kontrolagentens tjek foretages på stikprøvebasis		✓		En koncis redegørelse for, at tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, udfører kontrollen på stikprøvebasis i stedet for på grundlag af hver enkelt underliggende eksponering, for hvilken der anmodes om kreditrisikoafdækningsbetaling.	Ikke relevant
STSSY 136	Artikel 26e, stk. 4, tredje afsnit	Investorerne mulighed for at kræve, at tredjeparts-kontrolagenten kontrollerer enhver underliggende eksponering		✓		En koncis redegørelse for, hvorvidt og hvordan investorer kan anmode om kontrol af anvendelsen af en bestemt underliggende eksponering, hvis de ikke er tilfredse med stikprøvekontrollen.	Ikke relevant
STSSY 137	Artikel 26e, stk. 4, fjerde afsnit	Mulighed for, at tredjeparts-kontrolagenten kan få adgang til alle relevante oplysninger		✓		En koncis redegørelse for, at det eksponeringsleverende institut i transaktionsdokumentationen forpligter sig til at give tredjeparts-kontrolagenten, der er omhandlet i felt STSSY 126, alle de oplysninger, der er nødvendige for at kontrollere overholdelse af kravene i artikel 26e, stk. 4, første afsnit, litra a) -f), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSS 138	Artikel 26e, stk. 5, første afsnit, litra a)-f)	Opsigelsesbegivenheder		√		En koncis redegørelse for, at det eksponeringsleverende institut ikke må afslutte en transaktion før dens planlagte udløb af andre årsager end de begivenheder, der er anført i artikel 26e, stk. 5, litra a)-f), i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSS 139	Artikel 26e, stk. 5, andet afsnit	Transaktionsdokumentation — Call-rettig-heder		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen præciserer, at enhver af de call-rettig-heder, der er omhandlet i artikel 26e, stk. 5, første afsnit, litra d) og e), i forordning (EU) 2017/2402, er omfattet af den pågældende transaktion, og hvordan sådanne call-rettig-heder er struktureret.	Ikke relevant
STSS 140	Artikel 26e, stk. 5, tredje afsnit	Transaktionsdokumentation — Time call ikke struktureret med henblik på at undgå allokering af tab til kreditforbedringspositioner		√		Med henblik på artikel 26e, stk. 5, første afsnit, litra d), i forordning (EU) 2017/2402, en koncis redegørelse for, at time call ikke er struktureret med henblik på at undgå allokering af tab til kreditforbedringspositioner eller andre positioner, der besiddes af investorer, og ikke på anden måde er struktureret med henblik på at opnå kreditforbedring.	Ikke relevant
STSS 141	Artikel 26e, stk. 5, fjerde afsnit	Time call		√		Når muligheden for time call er omfattet af transaktionen, en redegørelse for, hvordan kravet omhandlet i STSS 139 og STSS 140 er opfyldt, herunder med en begrundelse for anvendelsen af time call og en plausibel redegørelse, som viser, at brugen af time call ikke er begrundet i en forringelse af kvaliteten af de underliggende aktiver.	Ikke relevant
STSS 142	Artikel 26e, stk. 5, femte afsnit	Finansieret kreditrisikoafdækning — Tilbagebetaling af sikkerhedsstillelse til investorer i henhold til tranchernes rangorden		√		I tilfælde af finansieret kreditrisikoafdækning en koncis redegørelse for, at sikkerhedsstillelsen, når aftalen om kreditrisikoafdækning ophører, tilbagebetales til investorerne i henhold til tranchernes rangorden med forbehold af bestemmelserne i den relevante insolvenslovgivning, i det omfang den finder anvendelse på det eksponeringsleverende institut.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSS 143	Artikel 26e, stk. 6	Investorer afslutter transaktionen ved manglende betaling af kreditrisikoafdækningspræmien		√		En koncis redegørelse for, at investorerne ikke må afslutte en transaktion inden dens planlagte udløb af andre grunde end manglende betaling af kreditrisikoafdækningspræmien eller enhver anden materiel misligholdelse af kontraktlige forpligtelser fra det eksponeringsleverende instituts side.	Ikke relevant
STSSY 144	Artikel 26e, stk. 7, litra a)	Beløbet for syntetisk mer-spread til investorer angivet i transaktionsdokumentationen og udtrykt som en fast procentdel af den samlede udestående porteføljebalance		√		Hvis det eksponeringsleverende institut påtager sig et syntetisk mer-spread, der er tilgængeligt som kreditforbedring for investorerne, en koncis redegørelse for, at beløbet for det syntetiske mer-spread, som det eksponeringsleverende institut forpligter sig til at anvende som kreditforbedring for hver betalingsperiode, er specificeret i transaktionsdokumentationen og udtrykt som en fast procentdel af den samlede udestående porteføljesaldo ved begyndelsen af den relevante betalingsperiode (fast syntetisk mer-spread).	Ikke relevant
STSSY 145	Artikel 26e, stk. 7, litra b)	Uudnyttet syntetisk mer-spread, der skal returneres til det eksponeringsleverende institut		√		Hvis det eksponeringsleverende institut påtager sig et syntetisk mer-spread, der er tilgængeligt som kreditforbedring for investorerne, en koncis redegørelse for, at det syntetiske mer-spread, der ikke anvendes til at dække kredittab, der opstår i hver betalingsperiode, returneres til det eksponeringsleverende institut.	Ikke relevant
STSSY 146	Artikel 26e, stk. 7, litra c)	Eksponeringsleverende institutter, der anvender den interne rating-baserede metode — Samlet forpligtet beløb pr. år overstiger ikke det etårige lovbestemte forventede tab		√		Hvis det eksponeringsleverende institut forpligter sig til et syntetisk mer-spread, der er tilgængeligt som kreditforbedring for investorerne, en koncis redegørelse for, at det samlede forpligtede beløb pr. år for eksponeringsleverende institutter, der anvender den interne ratingbaserede metode, der er omhandlet i artikel 143 i forordning (EU) nr. 575/2013, ikke er højere end det etårige lovbestemte forventede tab på alle underliggende eksponeringer for det pågældende år, beregnet i overensstemmelse med artikel 158 i nævnte forordning.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 147	Artikel 26e, stk. 7, litra d)	Eksponeringsleverende institutter, der ikke anvender den interne ratingbaserede metode — beregningen af det forventede etårige tab på den underliggende portefølje skal fremgå klart af transaktionsdokumentationen		√		Hvis det eksponeringsleverende institut forpligter sig til et syntetisk mer-spread, der er tilgængeligt som kreditforbedring for investorerne, en koncis redegørelse for, at for eksponeringsleverende institutter, der ikke anvender den interne ratingbaserede metode, der er omhandlet i artikel 143 i forordning (EU) nr. 575/2013, fremgår beregningen af det etårige forventede tab på den underliggende eksponering klart af transaktionsdokumentationen.	Ikke relevant
STSSY 148	Artikel 26e, stk. 7, litra e)	Betingelser for syntetisk mer-spread fastsat i transaktionsdokumentationen		√		Hvis det eksponeringsleverende institut forpligter sig til et syntetisk mer-spread, der er tilgængeligt som kreditforbedring for investorerne, en koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen specificerer betingelserne i artikel 26e, stk. 7, i forordning (EU) 2017/2402.	Ikke relevant
STSS 149	Artikel 26e, stk. 8, litra a), b) og c)	Anvendt kreditrisikoafdækning		√		En koncis redegørelse for, hvilke af følgende former aftalen om kreditrisikoafdækning er i overensstemmelse med: a) en garanti, der opfylder de krav, der er fastsat i tredje del, afsnit II, kapitel 4, i forordning (EU) nr. 575/2013, hvorved kreditrisikoen overføres til en af de enheder, der er anført i artikel 214, stk. 2, litra a)-d), i forordning (EU) nr. 575/2013, forudsat at eksponeringerne mod investoren kan tillægges en risikovægt på 0 % i henhold til nævnte forordnings tredje del, afsnit II, kapitel 2	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
						b) en garanti, der opfylder de krav, der er fastsat i tredje del, afsnit II, kapitel 4, i forordning (EU) nr. 575/2013, som drager fordel af en regaranti fra en af de enheder, der er omhandlet i dettes stykkes litra a) c) en anden kreditrisikoafdækning, som ikke er omhandlet i litra a) og b) i form af en garanti, et kreditderivat eller en credit linked note, der opfylder kravene i artikel 249 i forordning (EU) nr. 575/2013, forudsat at investorens forpligtelser er sikret ved sikkerhedsstillelse, der opfylder kravene i artikel 26e, stk. 9 og 10 i forordning (EU) 2017/2402.	
STSSY 150	Artikel 26e, stk. 9, første afsnit, litra a)	Håndhævelse af det eksponeringsleverende instituts ret til at anvende sikkerhedsstillelsen til at opfylde investorens forpligtelser til at betale kreditrisikoafdækningen gennem passende aftaler om sikkerhedsstillelse			√	Hvis der anvendes en kreditrisikoafdækning som omhandlet i artikel 26e, stk. 8, litra c), i forordning (EU) 2017/2402, en detaljeret redegørelse for, hvordan det eksponeringsleverende instituts ret til at anvende sikkerhedsstillelsen til at opfylde investorens betalingsforpligtelser kan håndhæves, og hvordan håndhævelsen af denne ret sikres gennem passende aftaler om sikkerhedsstillelse.	Ikke relevant
STSSY 151	Artikel 26e, stk. 9, første afsnit, litra b)	Investorens ret til at modtage uudnyttet sikkerhedsstillelse, når securitiseringen afvikles, eller efterhånden som trancherne afdrages		√		Hvis der anvendes en kreditrisikoafdækning som omhandlet i artikel 26e, stk. 8, litra c), i forordning (EU) 2017/2402, en koncis redegørelse for, at investorens ret til tilbagebetaling af enhver sikkerhedsstillelse, der ikke er blevet anvendt til at opfylde kreditrisikoafdragningsbetalinger, når securitiseringen afvikles, eller efterhånden som trancherne afdrages, kan håndhæves.	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 152	Artikel 26e, stk. 9, første afsnit, litra c)	Sikkerhedsstillelse investeret i værdipapirer — Anerkendelseskriterier og deponeeringsordning specificeret i transaktionsdokumentationen			√	Hvis der anvendes kreditrisikoafdækning som omhandlet i artikel 26e, stk. 8, litra c), i forordning (EU) 2017/2402, en detaljeret redegørelse for, hvordan transaktionsdokumentationen fastsætter anerkendelseskriterierne og deponeringsaftalen for værdipapirerne, hvis sikkerhedsstillelsen investeres i værdipapirer.	Ikke relevant
STSSY 153	Artikel 26e, stk. 9, andet afsnit	Investorer eksponeret for det eksponeringsleverende instituts kreditrisiko		√		En koncis redegørelse for, at transaktionsdokumentationen præciserer, om investorer fortsat er eksponeret for det eksponeringsleverende instituts kreditrisiko.	Ikke relevant
STSSY 154	Artikel 26e, stk. 9, tredje afsnit	Juridisk udtalelse, der bekræfter, at kreditrisikoafdækningen kan håndhæves i alle jurisdiktioner	√			En bekræftelse af at, det eksponeringsleverende institut har indhentet en udtalelse fra en kvalificeret juridisk rådgiver, der bekræfter, at kreditrisikoafdækningen kan håndhæves i alle relevante jurisdiktioner.	Ikke relevant
STSSY 155	Artikel 26e, stk. 10, første afsnit, litra a)	Sikkerhedsstillelse af høj kvalitet – 0 % risikovægtede gældsværdipapirer		√		Hvis der ydes kreditrisikoafdækning i overensstemmelse med artikel 26e, stk. 10, litra a), i forordning (EU) 2017/2402 i form af 0 % risikovægtede gældsværdipapirer som omhandlet i tredje del, afsnit II, kapitel 2, i forordning (EU) nr. 575/2013, en koncis redegørelse for, at alle følgende betingelser er opfyldt: i) gældsinstrumenterne har en maksimal restløbetid på tre måneder, som ikke er længere end den tid, der resterer til næste betalingsdato ii) gældsinstrumenterne kan indløses til kontanter til et beløb, der svarer til den udestående del af den risikoafdækkede tranche iii) gældsinstrumenterne opbevares af en depositar, der er uafhængig af det eksponeringsleverende institut og investorerne	Ikke relevant

▼ M1

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 156	Artikel 26e, stk. 10, første afsnit, litra b)	Sikkerhedsstillelse af høj kvalitet — Kontanter hos et tredjepartskreditinstitut med kreditkvalitetstrin 3 eller derover		√		Hvis der ydes kreditrisikoafdækning i overensstemmelse med artikel 26e, stk. 10, litra b), i forordning (EU) 2017/2402, en koncis redegørelse for aftalen om sikkerhedsstillelse, der giver det eksponeringsleverende institut og investoren mulighed for at anvende sikkerhedsstillelse i form af kontanter i et tredjepartskreditinstitut med kreditkvalitetstrin 3 eller derover i overensstemmelse med konverteringen i artikel 136 i forordning (EU) nr. 575/2013.	Ikke relevant
STSSY 157	Artikel 26e, stk. 10, andet afsnit	Undtagelse — Sikkerhedsstillelse i form af kontanter deponeret hos det eksponeringsleverende institut			√	Hvis undtagelsen fra artikel 26e, stk. 10, første afsnit, i forordning (EU) 2017/2402 anvendes, en detaljeret redegørelse for aftalen om sikkerhedsstillelse og investorens samtykke hertil, som kun giver det eksponeringsleverende institut adgang til sikkerhedsstillelse af høj kvalitet i form af kontanter deponeret hos det eksponeringsleverende institut eller et af dets tilknyttede selskaber.	Ikke relevant
STSSY 158	Artikel 26e, stk. 10, tredje afsnit	Sikkerhedsstillelse i form af kontanter deponeret hos det eksponeringsleverende institut — den kompetente myndigheds tilladelse			√	En detaljeret redegørelse for samtykke fra de kompetente myndigheder, der er udpeget i henhold til artikel 29, stk. 5, i forordning (EU) 2017/2402, til, at sikkerhedsstillelsen kan ske i form af kontanter deponeret hos det eksponeringsleverende institut eller et af dets tilknyttede selskaber, hvis det eksponeringsleverende institut eller et af dets tilknyttede selskaber opfylder betingelserne for et kreditkvalitetstrin 3, forudsat at markedsvanskeligheder, objektive hindringer i forbindelse med det kreditkvalitetstrin, der er tildelt instituttets medlemsstat, eller væsentlige potentielle koncentrationsproblemer i den pågældende medlemsstat som følge af anvendelsen af minimumskravet til kreditkvalitetstrin 2, jf. artikel 26e, stk. 10, andet afsnit, i forordning (EU) 2017/2402, kan dokumenteres.	Ikke relevant

▼ **M1**

Feltkode	Artikel i forordning (EU) 2017/2402	Felt navn	Bekræftelse	Koncis redegørelse	Detaljeret redegørelse	Oplysninger, der skal indberettes	Yderligere oplysninger
STSSY 159	Artikel 26e, stk. 10, fjerde afsnit	Overførsel af sikkerhedsstillelse, hvis tredjepartskreditinstituttet eller det eksponeringsleverende institut ikke længere opfylder minimumskravet til kreditkvalitetstrin			√	En detaljeret redegørelse for, hvordan sikkerhedsstillelsen overføres i overensstemmelse med artikel 26e, stk. 10, fjerde afsnit, i forordning (EU) 2017/2402, hvis sikkerheden blev stillet i form af kontanter depoteret hos et institut, der ikke længere opfylder minimumskravet til kreditkvalitetstrin.	Ikke relevant
STSSY 160	Artikel 26e, stk. 10, femte afsnit	Opfyldelse af kravene til sikkerhedsstillelse i tilfælde af investeringer i credit linked notes udstedt af det eksponeringsleverende institut	√			En bekræftelse af, at der er foretaget en investering i credit linked notes udstedt af det eksponeringsleverende institut i overensstemmelse med artikel 218 i forordning (EU) nr. 575/2013.	Ikke relevant