

**GEDELEGEERDE VERORDENING (EU) 2020/1226 VAN DE COMMISSIE****van 12 november 2019****tot aanvulling van Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad en tot vaststelling van technische reguleringsnormen tot nadere bepaling van de overeenkomstig de STS-kennisgevingsvereisten te verstrekken informatie****(Voor de EER relevante tekst)**

DE EUROPESE COMMISSIE,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad van 12 december 2017 tot vaststelling van een algemeen kader voor securitisatie en tot instelling van een specifiek kader voor eenvoudige, transparante en gestandaardiseerde securitisatie, en tot wijziging van de Richtlijnen 2009/65/EG, 2009/138/EG en 2011/61/EU en de Verordeningen (EG) nr. 1060/2009 en (EU) nr. 648/2012 <sup>(1)</sup>, en met name artikel 27, lid 6,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Krachtens Verordening (EU) 2017/2402 moeten initiators en sponsors de Europese Autoriteit voor effecten en markten (hierna “ESMA” genoemd) bepaalde informatie verschaffen wanneer zij van oordeel zijn dat een securitisatie voldoet aan de vereisten met betrekking tot criteria voor eenvoudige, transparante en gestandaardiseerde securitisaties (hierna “STS” genoemd) zoals die zijn uiteengezet in de artikelen 19 tot en met 22 en de artikelen 23 tot en met 26 van die verordening. De te verschaffen informatie verschilt naargelang het soort securitisaties waarvan kennis wordt gegeven.
- (2) Om bevoegde autoriteiten in staat te stellen hun taken te verrichten en beleggers en potentiële beleggers in staat te stellen hun due diligence uit te voeren, is voldoende gedetailleerde informatie, die relevant is voor de STS-kennisgeving, vereist om te bepalen of aan de STS-criteria is voldaan. Meer bepaald dienen de redenen om een homogeniteitsfactor te selecteren en andere factoren uit te sluiten in de kennisgeving te worden opgenomen, om de beoordeling van het homogeniteitscriterium te kunnen schragen. Voor bepaalde STS-criteria kan met een eenvoudige bevestiging van inachtneming worden volstaan, terwijl andere criteria verdere informatie vereisen. Daarom moet een onderscheid worden gemaakt tussen vereisten waarvoor een eenvoudige bevestiging voldoende is, en vereisten waarvoor een beknopte toelichting of een nadere toelichting noodzakelijk is.
- (3) Bij securitisaties waarvoor in overeenstemming met Verordening (EU) 2017/1129 van het Europees Parlement en de Raad <sup>(2)</sup> geen prospectus hoeft te worden opgesteld (particuliere securitisaties), mogen partijen securitisatietransacties aangaan zonder dat zij commercieel gevoelige informatie hoeven vrij te geven. Daarom is het passend om de informatie die bij de STS-kennisgeving van dit soort securitisaties wordt gepubliceerd, te beperken tot niet-gevoelige commerciële informatie.
- (4) Om de toegang te vergemakkelijken tot informatie die voor de STS-vereisten relevant is, moet het voor initiators en sponsors mogelijk zijn om te verwijzen naar het desbetreffende prospectus dat voor die securitisatie is opgesteld in overeenstemming met Verordening (EU) 2017/1129, naar andere relevante onderliggende documentatie als genoemd in artikel 7, lid 1, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 of naar ieder ander document met informatie die voor de STS-kennisgeving relevant is.
- (5) Deze verordening is gebaseerd op de ontwerpen van technische reguleringsnormen die ESMA aan de Commissie heeft voorgelegd.
- (6) ESMA heeft open publieke consultaties gehouden over de ontwerpen van technische reguleringsnormen waarop deze verordening is gebaseerd, heeft de mogelijke daaraan verbonden kosten en baten geanalyseerd, en heeft het advies van de bij artikel 37 van Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad <sup>(3)</sup> opgerichte Stakeholdergroep effecten en markten ingewonnen,

<sup>(1)</sup> PB L 347 van 28.12.2017, blz. 35.

<sup>(2)</sup> Verordening (EU) 2017/1129 van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2017 betreffende het prospectus dat moet worden gepubliceerd wanneer effecten aan het publiek worden aangeboden of tot de handel op een gereguleerde markt worden toegelaten en tot intrekking van Richtlijn 2003/71/EG (PB L 168 van 30.6.2017, blz. 12).

<sup>(3)</sup> Verordening (EU) nr. 1095/2010 van het Europees Parlement en de Raad van 24 november 2010 tot oprichting van een Europese toezichthoudende autoriteit (Europese Autoriteit voor effecten en markten), tot wijziging van Besluit nr. 716/2009/EG en tot intrekking van Besluit 2009/77/EG van de Commissie (PB L 331 van 15.12.2010, blz. 4).

HEEFT DE VOLGENDE VERORDENING VASTGESTELD:

#### Artikel 1

##### **In de STS-kennisgeving op te nemen informatie**

1. De informatie die overeenkomstig artikel 27 van Verordening (EU) 2017/2402 in de STS-kennisgeving moet worden opgenomen, is:

- a) wanneer de securitisatie een niet-ABCP-securitisatie is: de in bijlage I bij deze verordening genoemde informatie;
- b) wanneer de securitisatie een ABCP-securitisatie is: de in bijlage II bij deze verordening genoemde informatie;
- c) voor een ABCP-programma: de in bijlage III bij deze verordening genoemde informatie.

2. Voor securitisaties waarvoor overeenkomstig Verordening (EU) 2017/1129 geen prospectus hoeft te worden opgesteld, dient de overeenkomstig lid 1 in de STS-kennisgeving op te nemen informatie vergezeld te gaan van het volgende:

- a) wanneer de securitisatie een niet-ABCP-securitisatie is: de in de velden STSS9 and STSS10 van bijlage I bij deze verordening genoemde informatie;
- b) wanneer de securitisatie een ABCP-securitisatie is: de in de velden STSAT9 and STSAT10 van bijlage II bij deze verordening genoemde informatie;
- c) voor een ABCP-programma: de in veld STSAP9 van bijlage III bij deze verordening genoemde informatie.

Voor de toepassing van artikel 27, lid 1, derde alinea, van Verordening (EU) 2017/2402 blijft de bekendmaking van de STS-kennisgeving voor die securitisaties beperkt tot de in dit lid bedoelde informatie.

#### Artikel 2

##### **Aanvullende informatie**

Wanneer de volgende documenten informatie bevatten die voor de STS-kennisgeving relevant is, mag een verwijzing naar de desbetreffende delen van die documenten worden gegeven in de kolom "Aanvullende informatie" in bijlage I, II of III bij deze verordening en, wanneer die informatie wordt verstrekt, wordt die documentatie duidelijk geïdentificeerd:

- a) een overeenkomstig Verordening (EU) 2017/1129 opgesteld prospectus;
- b) andere in artikel 7, lid 1, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 genoemde onderliggende documentatie;
- c) alle overige documenten met informatie die voor de STS-kennisgeving relevant is.

#### Artikel 3

##### **Inwerkingtreding**

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in elke lidstaat.

Gedaan te Brussel, 12 november 2019.

Voor de Commissie  
De voorzitter  
Jean-Claude JUNCKER

## BIJLAGE I

Met betrekking tot niet-ABCP-securitisaties bij ESMA overeenkomstig de artikelen 19 tot en met 22 van Verordening (EU) 2017/2402 in te dienen informatie

## Algemene informatie

| Veldnummer | Artikel van Verordening (EU) 2017/2402 | VELDNAAM                       | TE RAPPORTEREN INHOUD <sup>(1)</sup>  | AANVULLENDE INFORMATIE  |
|------------|--|--------------------------------|---|---|
| STSS0      | Artikel 27, lid 1                      | Eerste aanspreekpunt           | Identificatiecode voor rechtspersonen (Legal Entity Identifier — LEI) van de als eerste aanspreekpunt aangewezen entiteit en naam van de betrokken bevoegde autoriteit.                         | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 van de Commissie <sup>(2)</sup>                   |
| STSS1      | N.v.t.                                 | Identificatiecode instrument   | Internationa(a)l(e) effectenidentificatienummer(s) (ISIN) (voor zover beschikbaar). Indien geen ISIN beschikbaar, dan andere unieke effectenidentificatiecode toegekend aan deze securitisatie. | Wanneer beschikbaar op grond van rubriek 3.1 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 van de Commissie |
| STSS2      | N.v.t.                                 | Legal Entity Identifier (LEI)  | De identificatiecode voor rechtspersonen (Legal Entity Identifier — LEI) van de initiator(s) en sponsor(s) en, voor zover beschikbaar, de oorspronkelijke kredietverstrekker(s).                | Rubriek 4.2 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980  |
| STSS3      | N.v.t.                                 | Identificatiecode kennisgeving | Bij het rapporteren van een bijwerking het unieke referentienummer dat door ESMA aan de vorige STS-kennisgeving is toegekend.   | N.v.t.  |
| STSS4      | N.v.t.                                 | Unieke identificatiecode       | De unieke door de rapporterende entiteit in overeenstemming met artikel 11, lid 1, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 van de Commissie <sup>(3)</sup> toegekende identificatiecode.    | N.v.t.  |
| STSS5      | N.v.t.                                 | Identificatiecode prospectus   | De door de betrokken bevoegde autoriteit toegekende identificatiecode van het prospectus (voor zover beschikbaar).  | N.v.t.  |
| STSS6      | N.v.t.                                 | Securitisatieregister          | De naam van het geregistreerde securitisatieregister (voor zover beschikbaar).  | N.v.t.  |
| STSS7      | N.v.t.                                 | Naam securitisatie             | De naam van de securitisatie.   | Afdeling 4 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSS8      | Artikel 18 en artikel 27, lid 3        | Land van vestiging             | Het land van vestiging van de initiator(s), sponsor(s), SSPE("s) en oorspronkelijke kredietverstrekker(s) (voor zover beschikbaar).   | N.v.t.  |

|        |                   |  |   |        |
|--------|-------------------|--|---|--------|
| STSS9  | N.v.t.            | Indeling securitisatie                 | Soort securitisatie:<br>— niet-ABCP-securitisatie,<br>— ABCP-securitisatie,<br>— ABCP-programma.  | N.v.t. |
| STSS10 | N.v.t.            | Indeling onderliggende blootstellingen | Het soort onderliggende blootstellingen, waaronder:<br>1) woningkredieten die gedekt zijn door een of meer hypotheke op voor bewoning bestemde onroerende goederen of die volledig worden gegarandeerd door een van de in artikel 201, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013 bedoelde in aanmerking komende protectiegevers en waaraan kredietkwaliteitscategorie 2 of hoger kan worden toegekend, zoals bepaald in deel drie, titel II, hoofdstuk 2, van die verordening;<br>2) zakelijke leningen die gedekt zijn door een of meer hypotheke op zakelijk onroerend goed, met inbegrip van kantoren of andere handelspanden;<br>3) kredietfaciliteiten aan particulieren voor persoonlijke, familiale of huishoudelijke consumptieve doeleinden;<br>4) kredietfaciliteiten, met inbegrip van leningen en leases, aan alle typen ondernemingen of vennootschappen;<br>5) autoleningen/-leases;<br>6) kredietkaartvorderingen;<br>7) handelsvorderingen;<br>8) andere onderliggende blootstellingen die door de initiator of sponsor op basis van interne methodologieën en parameters als een afzonderlijke activatype worden beschouwd. | N.v.t. |
| STSS11 | N.v.t.            | Uitgiftedatum                          | Wanneer een prospectus in overeenstemming met Richtlijn (EU) 2017/1129 (*) is opgesteld, de datum waarop het prospectus is goedgekeurd.<br>In alle overige gevallen de datum van de closing van de recentste transactie.  | N.v.t. |
| STSS12 | N.v.t.            | Kennisgevingsdatum                     | Datum kennisgeving aan ESMA.  | N.v.t. |
| STSS13 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij        | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, een verklaring dat de inachtneming van de STS-criteria is bevestigd door die vergunninghoudende derde partij.   | N.v.t. |

|        |                   |   |   |        |
|--------|-------------------|---|---|--------|
| STSS14 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij   | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, de naam van die derde partij en haar land van vestiging.  | N.v.t. |
| STSS15 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij   | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, de naam van de bevoegde autoriteit die haar de vergunning heeft afgegeven.                          | N.v.t. |
| STSS16 | Artikel 27, lid 5 | STS-status  | Een met redenen omklede kennisgeving van de originator en sponsor dat de securitisatie niet langer als STS geldt.   | N.v.t. |
| STSS17 | Artikel 27, lid 3 | Initiator (of oorspronkelijke kredietverstrekker) niet zijnde een kredietinstelling | Een "ja"- of "neen"-verklaring over de vraag of de initiator of oorspronkelijke kredietverstrekker een in de Unie gevestigde kredietinstelling of beleggingsonderneming is.   | N.v.t. |
| STSS18 | Artikel 27, lid 3 | Bevestiging kredietverleningscriteria   | Wanneer het antwoord in veld STSS17 "neen" is, bevestiging dat de kredietverleningscriteria, processen en systemen bij de initiator of de oorspronkelijke kredietverstrekker zijn uitgevoerd in overeenstemming met artikel 9 van Verordening (EU) 2017/2402. | N.v.t. |
| STSS19 | Artikel 27, lid 3 | Bevestiging dat op de kredietverlening toezicht wordt uitgeoefend                   | Wanneer het antwoord in veld STSS17 "neen" is, bevestiging dat de kredietverlening als bedoeld in artikel 27, lid 3, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 toezicht wordt uitgeoefend.   | N.v.t. |

(<sup>1</sup>) In voorkomend geval een verwijzing opnemen naar de desbetreffende onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is).

(<sup>2</sup>) Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 van de Commissie van 14 maart 2019 tot aanvulling van Verordening (EU) 2017/1129 van het Europees Parlement en de Raad wat betreft de vorm, de inhoud, de controle en de goedkeuring van het prospectus dat moet worden gepubliceerd wanneer effecten aan het publiek worden aangeboden of tot de handel op een gereguleerde markt worden toegelaten, en tot intrekking van Verordening (EG) nr. 809/2004 van de Commissie (PB L 166 van 21.6.2019, blz. 26).

(<sup>3</sup>) Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 van de Commissie van 16 oktober 2019 tot aanvulling van Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad betreffende technische reguleringsnormen ter specificatie van de door de initiator, de sponsor en de SSPE beschikbaar te stellen informatie over een securitisatie (zie PB L 289 van 3.9.2020, blz. 1).

(<sup>4</sup>) Verordening (EU) 2017/1129 van het Europees Parlement en de Raad van 14 juni 2017 betreffende het prospectus dat moet worden gepubliceerd wanneer effecten aan het publiek worden aangeboden of tot de handel op een gereguleerde markt worden toegelaten en tot intrekking van Richtlijn 2003/71/EG (PB L 168 van 30.6.2017, blz. 12).

## Specifieke informatie

| Veldnummer | Artikel van Verordening (EU) 2017/2402 | VELDNAAM  | Bevestiging | Beknopte toelichting | Nadere toelichting | TE RAPPORTEREN INHOUD (*)   | AANVULLENDE INFORMATIE  |
|------------|--|---|-------------|----------------------|--------------------|---|---|
| STSS20     | Artikel 20, lid 1                      | Overdracht onderliggende blootstellingen via true sale of cessie              |             | √                    |                    | Een beknopte toelichting over de wijze waarop de overdracht van de onderliggende blootstellingen via true sale of cessie heeft plaatsgevonden met dezelfde rechtsgevolgen op een wijze die afdwingbaar is tegenover de verkoper of een andere derde partij.   | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS21     | Artikel 20, lid 2                      | Geen strenge terugvordering   |             | √                    |                    | Een beknopte toelichting over de vraag of de in artikel 20, lid 2, onder a) of b), van Verordening (EU) 2017/2402 genoemde bepalingen inzake strenge terugvordering, in de securitisatie te vinden zijn, en een verklaring of het bepaalde in artikel 20, lid 3, van Verordening (EU) 2017/2402 al dan niet van toepassing is.  | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS22     | Artikel 20, lid 3                      | Vrijstelling van terugvorderingsbepalingen uit nationale insolventiewetgeving | √           |                      |                    | In samenhang met STSS21, in voorkomend geval, een bevestiging dat er geen omstandigheden zijn die aanleiding kunnen geven tot terugvorderingsbepalingen in overeenstemming met artikel 20, leden 1 en 2, van Verordening (EU) 2017/2402.  | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS23     | Artikel 20, lid 4                      | Overdracht waarbij verkoper niet oorspronkelijke kredietverstrekker is.       | √           |                      |                    | Wanneer de verkoper niet de oorspronkelijke kredietverstrekker is, een bevestiging dat met de securitisatie artikel 20, leden 1 tot en met 3, van Verordening (EU) 2017/2402 in acht wordt genomen.   | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS24     | Artikel 20, lid 5                      | Overdracht door middel van cessie en in een later stadium voltooid            |             | √                    |                    | Wanneer de overdracht van de onderliggende blootstellingen plaatsvindt door middel van een cessie en wordt voltooid in een later stadium dan bij de closing van de transactie, een beknopte toelichting over de vraag hoe en of die voltooiing is uitgevoerd via de vereiste minimale vooraf bepaalde event triggers die in artikel 20, lid 5, van Verordening (EU) 2017/2402 zijn opgesomd.<br>Wanneer van alternatieve overdrachtmechanismen wordt gebruikgemaakt, een bevestiging dat een insolventie van de initiator de SSPE niet zou schaden of verhinderen haar rechten af te dwingen. | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |

|        |                   |   |   |   |   |   |  |
|--------|-------------------|---|---|---|---|---|--|
| STSS25 | Artikel 20, lid 6 | Verklaringen en garanties   |   | √ |   | Een beknopte toelichting over de vraag hoe en of door de verkoper verklaringen en garanties worden verstrekt dat de onderliggende blootstellingen die de securitisatie omvat, niet bezwaard zijn of anderszins in een toestand verkeren waarvan te voorzien is dat deze een negatieve invloed zal hebben op de afdwingbaarheid van de true sale, cessie of overdracht met dezelfde rechtsgevolgen.  | Rubriek 2.2.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 van de Commissie |
| STSS26 | Artikel 20, lid 7 | Toelaatbaarheidscriteria die geen ruimte laten voor actief portefeuillebeheer van de onderliggende blootstellingen op discretionaire basis. |   | √ |   | Een beknopte toelichting over de volgende punten: <ul style="list-style-type: none"> <li>— hoe de onderliggende blootstellingen die de verkoper overdraagt of cedeert aan de SSPE, voldoen aan vooraf vastgestelde, duidelijke en gedocumenteerde toelaatbaarheidscriteria die geen ruimte laten voor actief portefeuillebeheer van die blootstellingen op discretionaire basis;</li> <li>— hoe de selectie en overdracht van de onderliggende blootstellingen in de securitisatie is gebaseerd op duidelijke processen die het mogelijk maken te identificeren welke blootstellingen zijn geselecteerd voor of worden overgedragen naar de securitisatie en die geen ruimte laten voor actief portefeuillebeheer van die blootstellingen op discretionaire basis.</li> </ul> | Afdeling 2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                     |
| STSS27 | Artikel 20, lid 8 | Homogeniteit activa   |   |   | √ | Een nadere toelichting wat betreft de homogeniteit van de pool onderliggende activa die de securitisatie afdekken. Daartoe een verwijzing opnemen naar de homogeniteit-RTS van EBA (Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/1851 van de Commissie <sup>(2)</sup> ) en toelichten hoe aan elk van de in artikel 1 van die gedelegeerde verordening genoemde voorwaarden wordt voldaan.  | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                  |
| STSS28 | Artikel 20, lid 9 | Verplichtingen onderliggende blootstellingen: geen hersecuritisatie   | √ |   |   | Een bevestiging dat de onderliggende blootstellingen geen securitisatieposities bevatten en dat de securitisatie waarvan wordt kennis gegeven, dus geen hersecuritisatie is.  | Rubriek 2.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                    |

|        |                    |  |  |  |   |   |
|--------|--------------------|--|--|--|---|---|
| STSS29 | Artikel 20, lid 10 | Gedegenheid afsluitstandaard   |  |  | <p>√</p> <p>Een nadere toelichting over de volgende punten:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— de vraag of de onderliggende blootstellingen zijn geïnitieerd in het kader van de normale bedrijfsuitoefening van de kredietverstrekker en of de toegepaste afsluitstandaarden niet minder streng waren dan die welke zijn gehanteerd op hetzelfde moment van initiëring als voor blootstellingen die niet waren gesecuritiseerd;</li> <li>— de vraag of over de afsluitstandaarden en eventuele materiële wijzigingen van eerdere afsluitstandaarden aan potentiële beleggers alle informatie is verschaft of onverwijld zal worden verschaft;</li> <li>— de vraag of bij securitisaties waarvan de onderliggende blootstellingen woonkredieten zijn, de pool van onderliggende blootstellingen aan het vereiste van artikel 20, lid 10, tweede alinea, van Verordening (EU) 2017/2402 voldoet;</li> <li>— de vraag of een beoordeling van de kredietwaardigheid van de kredietnemer voldoet aan de vereisten van artikel 8 van Richtlijn 2008/48/EG <sup>(3)</sup> of van artikel 18, leden 1 tot en met 4, artikel 18, lid 5, onder a), en artikel 18, lid 6, van Richtlijn 2014/17/EU <sup>(4)</sup> of, indien van toepassing, aan gelijkwaardige vereisten in derde landen.</li> </ul> | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS30 | Artikel 20, lid 10 | Expertise initiator/kredietverstrekker   |  |  | <p>√</p> <p>Een nadere toelichting over de vraag of de initiator of de oorspronkelijke kredietverstrekker beschikt over expertise in het initiëren van blootstellingen die vergelijkbaar zijn met die welke worden gesecuritiseerd.</p>   | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS31 | Artikel 20, lid 11 | Overgedragen onderliggende blootstellingen zonder blootstellingen in wanbetaling |  |  | <p>√</p> <p>Een nadere toelichting over de vraag of:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>— de overgedragen onderliggende blootstellingen, op het tijdstip van selectie, geen blootstellingen in wanbetaling (of geherstructureerde blootstellingen) in de zin van artikel 20, lid 11, van Verordening (EU) 2017/2402 bevatten;</li> <li>— aan de vereisten van artikel 20, lid 11, onder a), i) en ii), van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan;</li> <li>— aan de vereisten van artikel 20, lid 11, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan;</li> </ul>   | Rubriek 2.2.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |



|        |                    |  |   |  |   |  |  |
|--------|--------------------|--|---|--|---|--|--|
|        |                    |  |   |  |   | — aan de vereisten van artikel 20, lid 11, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan.  |  |
| STSS32 | Artikel 20, lid 12 | Ten minste één betaling op tijdstip overdracht   | √ |  |   | Een bevestiging dat, op het tijdstip van overdracht van de blootstellingen, de debiteuren ten minste één betaling hebben gedaan.<br>Een bevestiging of de vrijstelling op grond van artikel 20, lid 12, van Verordening (EU) 2017/2402 van toepassing is.  | Rubrieken 3.3 en 3.4.6 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                     |
| STSS33 | Artikel 20, lid 13 | De structuur van de terugbetaling van de houders is niet van dien aard dat de terugbetaling overwegend afhankelijk is van de verkoop van activa. |   |  | √ | Een nadere toelichting bij de mate waarin de terugbetalingen van de houders van de securitisatiepositie afhankelijk is van de verkoop van activa die onderliggende blootstellingen afdekken.   | Rubriek 3.4.1 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                              |
| STSS34 | Artikel 21, lid 1  | Inachtneming risicobehoevisten   |   |  | √ | Een beknopte toelichting over de vraag hoe de initiator, sponsor of oorspronkelijke kredietverstrekker van een niet-ABCP-securitisatie het risicobehoevisten van artikel 6 van Verordening (EU) 2017/2402 in acht neemt.<br>Een indicatie welke entiteit het materiële netto economisch belang behoudt en welke optie wordt gebruikt om het risico te behouden:<br>1) vertical slice overeenkomstig artikel 6, lid 3, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402;<br>2) aandeel van de verkoper overeenkomstig artikel 6, lid 3, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402;<br>3) willekeurig gekozen blootstellingen die op de balans worden gehouden, overeenkomstig artikel 6, lid 3, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402;<br>4) eersteverliestranche overeenkomstig artikel 6, lid 3, onder d), van Verordening (EU) 2017/2402;<br>5) eersteverliesblootstelling bij elk actief overeenkomstig artikel 6, lid 3, onder e), van Verordening (EU) 2017/2402;<br>6) niet-inachtneming van de in artikel 6, lid 3, van Verordening (EU) 2017/2402 bepaalde risicobehoevisten;<br>7) andere gebruikte opties. | Rubriek 3.1 van bijlage 9 en rubriek 3.4.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |

|        |                   |   |  |   |  |   |   |
|--------|-------------------|---|--|---|--|---|---|
| STSS35 | Artikel 21, lid 2 | Limitering rente- (IR) en valutarisico's (FX)   |  | √ |  | Een beknopte toelichting over de vraag hoe rente- en valutarisico's passend worden gelimiteerd en over maatregelen die worden genomen om dergelijke risico's te limiteren, samen met een bevestiging dat dergelijke maatregelen voor beleggers beschikbaar zijn.  | Rubrieken 3.4.2 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980    |
| STSS36 | Artikel 21, lid 2 | Door SSPE gekochte/verkochte derivaten  |  | √ |  | Een beknopte verklaring dat de SSPE geen derivatencontracten heeft gesloten behalve in de in artikel 21, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde gevallen.   | Rubrieken 3.4.2 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980    |
| STSS37 | Artikel 21, lid 2 | Derivaten waarvoor gebruikelijke normen worden gebruikt.  |  | √ |  | Een beknopte toelichting over de vraag of gebruikte hedginginstrumenten volgens breed aanvaarde normen zijn overgenomen en gedocumenteerd.  | Rubrieken 3.4.2 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980    |
| STSS38 | Artikel 21, lid 3 | Referentierentebetalingen op basis van algemeen gebruikelijke rentevoeten                           |  | √ |  | Een beknopte toelichting over de vraag hoe en of referentierentebetalingen in het kader van de activa en verplichtingen van de securitisatietransactie zijn berekend op basis van algemeen gebruikelijke marktrentevoeten, of op in de sector doorgaans gehanteerde rentevoeten die een weerspiegeling van de financieringskosten vormen. | Rubrieken 2.2.2 en 2.2.13 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS39 | Artikel 21, lid 4 | Geen insluiting van contanten na een sommatie tot nakoming of een sommatie tot vervroegde betaling. |  | √ |  | Een verklaring in algemene termen dat aan elk van de vereisten van artikel 21, lid 4, van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |
| STSS40 | Artikel 21, lid 4 | a)Geen insluiting van een bedrag aan contanten.   |  | √ |  | Bevestiging dat geen contanten ingesloten raken na afgifte van een sommatie tot nakoming of een sommatie tot vervroegde betaling.   | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |
| STSS41 | Artikel 21, lid 4 | b)Ontvangen hoofdsommen moeten worden doorgegeven aan beleggers.                                    |  | √ |  | Bevestiging dat uit hoofde van de onderliggende blootstellingen ontvangen hoofdsommen via sequentiële aflossing van de securitisatieposities, als bepaald door de rangorde van de securitisatiepositie, aan de beleggers worden doorgegeven.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |

|        |                             |  |   |   |  |  |  |
|--------|-----------------------------|--|---|---|--|--|--|
| STSS42 | Artikel 21, lid 4           | c) Rangorde terugbetaling securitisatieposities mag niet worden herzien.   | √ |   |  | Bevestiging dat de rangorde van de terugbetaling van de securitisatieposities niet wordt herzien.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980        |
| STSS43 | Artikel 21, lid 4           | d) Geen bepalingen die automatische liquidatie onderliggende blootstellingen tegen marktwaarde vergen.   | √ |   |  | Bevestiging dat geen bepalingen automatische liquidatie onderliggende blootstellingen tegen marktwaarde vergen.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980        |
| STSS44 | Artikel 21, lid 5           | Securitisaties met een niet-sequentiële rangorde van betalingen  | √ |   |  | Bevestiging dat transacties waarbij in een niet-sequentiële rangorde van betalingen is voorzien, triggers bevatten die verbonden zijn aan de prestaties van de onderliggende blootstellingen waardoor de rangorde van de betalingen terugvalt in sequentiële betalingen volgens hun rangorde.<br>Bevestiging dat dergelijke triggers ten minste de verslechtering van de kredietkwaliteit van de onderliggende blootstellingen beneden een vooraf bepaalde drempel omvatten. | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980        |
| STSS45 | Artikel 21, lid 6           | Revolverende securitisatie met tot vervroegde aflossing aanleiding gevende gebeurtenissen voor beëindiging doorlooptermijn op basis van voorgescreven triggers |   | √ |  | In voorkomend geval een beknopte toelichting over de vraag hoe het bepaalde in artikel 21, lid 6, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 zijn neerslag vindt in de transactiedocumentatie.   | Rubrieken 2.3 en 2.4 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS46 | Artikel 21, lid 6, onder a) | a) Achteruitgang kredietkwaliteit onderliggende blootstellingen  |   | √ |  | In voorkomend geval een beknopte toelichting over de vraag hoe het bepaalde in artikel 21, lid 6, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 zijn neerslag vindt in de transactiedocumentatie.   | Rubrieken 2.3 en 2.4 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS47 | Artikel 21, lid 6, onder b) | b) Intreden insolventiegerelateerde gebeurtenis met betrekking tot de initiator of de servicer   |   | √ |  | In voorkomend geval een beknopte toelichting over de vraag hoe de bepalingen of triggers uit artikel 21, lid 6, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 hun neerslag vinden in de transactiedocumentatie.   | Rubrieken 2.3 en 2.4 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |

|        |                             |   |   |   |  |   |  |
|--------|-----------------------------|---|---|---|--|---|--|
| STSS48 | Artikel 21, lid 6, onder c) | c)Waarde van de onderliggende blootstellingen in bezit van SSPE onderschrijdt een vooraf bepaalde drempel.  |   | √ |  | In voorkomend geval een beknopte toelichting over de vraag hoe het bepaalde in artikel 21, lid 6, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402 zijn neerslag vindt in de transactiedocumentatie, gebruikmakend van kruisverwijzingen naar de betrokken onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is). | Rubrieken 2.3 en 2.4 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS49 | Artikel 21, lid 6, onder d) | d)Niet-genereren voldoende nieuwe onderliggende blootstellingen die voldoen aan vooraf bepaalde kredietkwaliteit (trigger voor beëindiging doorroltermijn). |   | √ |  | In voorkomend geval een beknopte toelichting over de vraag hoe het bepaalde in artikel 21, lid 6, onder d), van Verordening (EU) 2017/2402 zijn neerslag vindt in de transactiedocumentatie.  | Rubrieken 2.3 en 2.4 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS50 | Artikel 21, lid 7, onder a) | a)Informatie over contractuele verplichtingen servicer, trustee en andere aanbieders van verwante diensten  | √ |   |  | Bevestiging dat de transactiedocumentatie alle vereisten van artikel 21, lid 7, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 specificeert.  | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSS51 | Artikel 21, lid 7, onder b) | b)Continuïteitsbepalingen servicing   | √ |   |  | Bevestiging dat de transactiedocumentatie alle vereisten van artikel 21, lid 7, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 specificeert.  | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSS52 | Artikel 21, lid 7, onder c) | c)Continuïteitsbepalingen tegenpartijen derivaten   | √ |   |  | Bevestiging dat de transactiedocumentatie aan alle in artikel 21, lid 7, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde informatie voldoet.  | Rubriek 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSS53 | Artikel 21, lid 7, onder c) | c)Continuïteitsbepalingen liquiditeitsverschaffers en rekeninghoudende bank   | √ |   |  | Bevestiging dat de transactiedocumentatie aan alle in artikel 21, lid 7, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402 bedoelde informatie voldoet.  | Rubriek 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |

|        |                    |   |   |  |   |  |  |
|--------|--------------------|---|---|--|---|--|--|
| STSS54 | Artikel 21, lid 8  | Vereiste expertise servicer en beleidslijnen, adequate procedures en risicobeheercontroles zijn voorhanden. |   |  | √ | Een nadere toelichting over de vraag hoe aan de vereisten van artikel 21, lid 8, van Verordening (EU) 2017/2402 wordt voldaan. Bij de toelichting verwijzingen opnemen naar beleidslijnen en procedures die de inachtneming van deze vereisten moeten borgen.                    | Rubriek 3.4.6 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980            |
| STSS55 | Artikel 21, lid 9  | Duidelijke en consistente definities met betrekking tot de behandeling van problemleningen                  | √ |  |   | Bevestiging dat in de onderliggende documentatie duidelijke en consistente definities, remedies en maatregelen met betrekking tot de in artikel 21, lid 9, Verordening (EU) 2017/2402 genoemde schuldsituaties worden gegeven.   | Rubriek 2.2.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980            |
| STSS56 | Artikel 21, lid 9  | Betalingsrangorde en trigger-events   | √ |  |   | Bevestiging dat de securitisatiedocumentatie de betalingsrangorde en trigger-events overeenkomstig artikel 21, lid 9, van Verordening (EU) 2017/2402 geeft.  | Rubriek 3.4.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980            |
| STSS57 | Artikel 21, lid 10 | Tijdige oplossing conflicten tussen klassen beleggers en verantwoordelijkheden trusteees                    | √ |  |   | Bevestiging dat is voldaan aan het in artikel 21, lid 10, van Verordening (EU) 2017/2402 met betrekking tot tijdige oplossing van conflicten bepaalde.   | Rubrieken 3.4.7 en 3.4.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSS58 | Artikel 22, lid 1  | Gegevens historische wanbetalings- en verliesprestaties   | √ |  |   | Bevestiging dat de op grond van artikel 22, lid 1, van Verordening (EU) 2017/2402 verplicht beschikbaar te stellen gegevens beschikbaar zijn, met de duidelijke vermelding waar de informatie te vinden is.  | Rubriek 2.2.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980            |
| STSS59 | Artikel 22, lid 2  | Steekproef van de aan externe controles onderworpen onderliggende blootstellingen                           | √ |  |   | Bevestiging dat een steekproef van de onderliggende blootstellingen vóór de uitgifte van de effecten uit hoofde van de securitisatie is onderworpen aan externe verificatie door een passende en onafhankelijke partij.  | N.v.t.   |
| STSS60 | Artikel 22, lid 3  | Beschikbaarheid liability cash-flow-model voor potentiële beleggers   | √ |  |   | Bevestiging dat een liability cash-flow-model voor potentiële beleggers beschikbaar is vóór beprijzing en een duidelijke verklaring waar die informatie beschikbaar is. Na beprijzing bevestiging dat die informatie op verzoek aan potentiële beleggers beschikbaar is gesteld. | N.v.t.   |

|        |                   |  |   |   |  |  |        |
|--------|-------------------|--|---|---|--|--|--------|
| STSS61 | Artikel 22, lid 4 | Bekendmaking informatie over milieuprestaties van uit woonkredieten of autoleeningen of -leases bestaande onderliggende activa |   | √ |  | Een beknopte toelichting over de vraag of de informatie over de milieuprestatie van de met woonkredieten of autoleeningen of -leases gefinancierde activa overeenkomstig artikel 7, lid 1, eerste alinea, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 beschikbaar is, en een verklaring waar die informatie te vinden is.   | N.v.t. |
| STSS62 | Artikel 22, lid 5 | Initiator en sponsor verantwoordelijk voor naleving artikel 7.   | √ |   |  | Bevestiging dat: <ul style="list-style-type: none"> <li>— de initiator en de sponsor verantwoordelijk zijn voor de inachtneming van artikel 7 van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>— de krachtens artikel 7, lid 1, onder a), vereiste informatie op verzoek vóór de beprijzing aan potentiële beleggers beschikbaar is gesteld;</li> <li>— de krachtens artikel 7, lid 1, onder b) tot en met d), vóór de beprijzing ten minste in ontwerpvorm of in initiële vorm beschikbaar is gesteld.</li> </ul> | N.v.t. |

(<sup>1</sup>) In voorkomend geval een verwijzing opnemen naar de desbetreffende onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is).

(<sup>2</sup>) Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/1851 van de Commissie van 28 mei 2019 tot aanvulling van Verordening (EU) 2017/2402 van het Europees Parlement en de Raad ten aanzien van technische reguleringsnormen inzake de homogeniteit van de onderliggende blootstellingen in de securitisatie (PB L 280 van 6.11.2019, blz. 1).

(<sup>3</sup>) Richtlijn 2008/48/EG van het Europees Parlement en de Raad van 23 april 2008 inzake kredietovereenkomsten voor consumenten en tot intrekking van Richtlijn 87/102/EEG van de Raad (PB L 133 van 22.5.2008, blz. 66).

(<sup>4</sup>) Richtlijn 2014/17/EU van het Europees Parlement en de Raad van 4 februari 2014 inzake kredietovereenkomsten voor consumenten met betrekking tot voor bewoning bestemde onroerende goederen en tot wijziging van de Richtlijnen 2008/48/EG en 2013/36/EU en Verordening (EU) nr. 1093/2010 (PB L 60 van 28.2.2014, blz. 34).

## BIJLAGE II

Met betrekking tot ABCP-securitisaties bij ESMA overeenkomstig de artikel 24 van Verordening (EU) 2017/2402 in te dienen informatie

## Algemene informatie

| Veldnummer | Artikel van Verordening (EU) 2017/2402 | VELDNAAM                       | TE RAPPORTEREN INHOUD <sup>(1)</sup>   | AANVULLENDE INFORMATIE   |
|------------|--|--------------------------------|--|--|
| STSAT0     | Artikel 27, lid 1                      | Eerste aanspreekpunt           | Identificatiecode voor rechtspersonen (Legal Entity Identifier — LEI) van de als eerste aanspreekpunt aangewezen entiteit en naam van de betrokken bevoegde autoriteit.                            | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                  |
| STSAT1     | N.v.t.                                 | Identificatiecode instrument   | Internationa(a)l(e) effectenidentificatienummer(s) (ISIN) (voor zover beschikbaar). Indien geen ISIN beschikbaar, dan andere unieke effectenidentificatiecode toegekend aan de ABCP-securitisatie. | Wanneer beschikbaar op grond van rubriek 3.1 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT2     | N.v.t.                                 | Legal Entity Identifier (LEI)  | De identificatiecode voor rechtspersonen (LEI) van de initiator(s) en/of sponsor(s) (voor zover beschikbaar).  | Rubriek 4.2 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                   |
| STSAT3     | N.v.t.                                 | Identificatiecode kennisgeving | Bij het rapporteren van een bijwerking het unieke referentienummer dat door ESMA aan de vorige STS-kennisgeving is toegekend.  | N.v.t.   |
| STSAT4     | N.v.t.                                 | Unieke identificatiecode       | De unieke door de rapporterende entiteit in overeenstemming met artikel 11, lid 2, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 aan deze ABCP-transactie toegekende identificatiecode.              | N.v.t.   |
| STSAT5     | N.v.t.                                 | Identificatiecode prospectus   | De door de betrokken bevoegde autoriteit toegekende identificatiecode van het prospectus (voor zover beschikbaar).   | N.v.t.   |
| STSAT6     | N.v.t.                                 | Securitisatieregister          | De naam van het geregistreerde securitisatieregister (voor zover beschikbaar).   | N.v.t.   |
| STSAT7     | N.v.t.                                 | Naam securitisatie             | De naam van de securitisatie (voor zover beschikbaar) of, bij gebreke daarvan, de naam van de code en de gebruikte naam.   | Afdeling 4 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                    |
| STSAT8     | Artikel 18 en artikel 27, lid 3        | Land van vestiging             | Het land van vestiging van de initiator(s), sponsor(s) en SSPE("s) (voor zover beschikbaar).   | N.v.t.   |
| STSAT9     | N.v.t.                                 | Indeling securitisatie         | Soort securitisatie:<br>— niet-ABCP,<br>— ABCP,<br>— ABCP-programma.   | N.v.t.   |

|         |                   |  |   |        |
|---------|-------------------|--|---|--------|
| STSAT10 | N.v.t.            | Indeling onderliggende blootstellingen | <p>Het soort onderliggende blootstellingen, waaronder:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. woningkredieten die gedekt zijn door een of meer hypotheke op voor bewoning bestemde onroerende goederen of die volledig worden gegarandeerd door een van de in artikel 201, lid 1, van Verordening (EU) nr. 575/2013 bedoelde in aanmerking komende protectiegevers en waaraan kredietkwaliteitscategorie 2 of hoger kan worden toegekend, zoals bepaald in deel drie, titel II, hoofdstuk 2, van die verordening;</li> <li>2. zakelijke leningen die gedekt zijn door een of meer hypotheke op zakelijk onroerend goed, met inbegrip van kantoren of andere handelspanden;</li> <li>3. kredietfaciliteiten aan particulieren voor persoonlijke, familiale of huishoudelijke consumptieve doeleinden;</li> <li>4. kredietfaciliteiten, met inbegrip van leningen en leases, aan alle typen ondernemingen of vennootschappen;</li> <li>5. autoleningen/-leases;</li> <li>6. kredietkaartvorderingen;</li> <li>7. handelsvorderingen;</li> <li>8. andere onderliggende blootstellingen die door de initiator of sponsor op basis van interne methodologieën en parameters als een afzonderlijke activatype worden beschouwd.</li> </ol> | N.v.t. |
| STSAT11 | N.v.t.            | Uitgiftedatum                          | <p>Wanneer een prospectus in overeenstemming met Richtlijn (EU) 2017/1129 is opgesteld, de datum waarop het prospectus is goedgekeurd.</p> <p>Anders, de datum van uitgifte van de ABCP-securitisatie.</p>  | N.v.t. |
| STSAT12 | N.v.t.            | Kennisgevingsdatum                     | Datum kennisgeving aan ESMA.  | N.v.t. |
| STSAT13 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij        | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, een verklaring dat de inachtneming van de STS-criteria is bevestigd door die vergunninghoudende derde partij.   | N.v.t. |
| STSAT14 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij        | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, de naam van die derde partij en haar land van vestiging.  | N.v.t. |



|         |                   |   |   |        |
|---------|-------------------|---|---|--------|
| STSAT15 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij   | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, de naam van de bevoegde autoriteit die haar de vergunning heeft afgegeven.                          | N.v.t. |
| STSAT16 | Artikel 27, lid 5 | STS-status  | Wanneer de originator en/of sponsor heeft kennis gegeven dat de ABCP-securitisatie niet langer als STS geldt, en de redenen voor die kennisgeving.  | N.v.t. |
| STSAT17 | Artikel 27, lid 3 | Initiator (of oorspronkelijke kredietverstrekker) niet zijnde een kredietinstelling | Een “ja”- of “neen”-verklaring over de vraag of de initiator of oorspronkelijke kredietverstrekker een in de Unie gevestigde kredietinstelling of beleggingsonderneming is.   | N.v.t. |
| STSAT18 | Artikel 27, lid 3 | Bevestiging kredietverleningscriteria   | Wanneer het antwoord in veld STSS17 “neen” is, bevestiging dat de kredietverleningscriteria, processen en systemen bij de initiator of de oorspronkelijke kredietverstrekker zijn uitgevoerd in overeenstemming met artikel 9 van Verordening (EU) 2017/2402. | N.v.t. |
| STSAT19 | Artikel 27, lid 3 | Bevestiging dat op de kredietverlening toezicht wordt uitgeoefend.                  | Wanneer het antwoord in veld STSS17 “neen” is, bevestiging dat de kredietverlening als bedoeld in artikel 27, lid 3, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 toezicht wordt uitgeoefend.   | N.v.t. |

(<sup>1</sup>) In voorkomend geval een verwijzing opnemen naar de desbetreffende onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is).

### Specifieke informatie

| Veldnummer | Artikel van Verordening (EU) 2017/2402 | VELDNAAM                                     | Bevestiging | Beknopte toelichting | Nadere toelichting | TE RAPPORTEREN INHOUD ( <sup>1</sup> )   | AANVULLENDE INFORMATIE  |
|------------|--|--|-------------|----------------------|--------------------|--|---|
| STSAT20    | Artikel 24, lid 1                      | Onderliggende activa verworven via true sale |             | √                    |                    | Een beknopte toelichting over de wijze waarop de overdracht van de onderliggende blootstellingen via true sale of cessie heeft plaatsgevonden met dezelfde rechtsgevolgen op een wijze die afdwingbaar is tegenover de verkoper of een andere derde partij.  | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Geledeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT21    | Artikel 24, lid 2                      | Geen strenge terugvordering                  |             | √                    |                    | Een beknopte toelichting over de vraag of de in artikel 24, lid 2, onder a) of b), van Verordening (EU) 2017/2402 genoemde bepalingen inzake strenge terugvordering, in de securitisatie te vinden zijn, en een verklaring of het bepaalde in artikel 24, lid 3, van Verordening (EU) 2017/2402 van toepassing is. | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Geledeerde Verordening (EU) 2019/980 |

|         |                   |   |   |   |  |   |   |
|---------|-------------------|---|---|---|--|---|---|
| STSAT22 | Artikel 24, lid 3 | Vrijstelling van terugvorderingsbepalingen uit nationale insolventiewetgeving   | √ |   |  | In samenhang met STSS21, in voorkomend geval, een bevestiging dat er geen omstandigheden zijn die aanleiding kunnen geven tot terugvorderingsbepalingen in overeenstemming met artikel 24, leden 1 en 2, van Verordening (EU) 2017/2402.  | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT23 | Artikel 24, lid 4 | Overdracht waarbij verkoper niet oorspronkelijke kredietverstrekker is.   | √ |   |  | Wanneer de verkoper niet de oorspronkelijke kredietverstrekker is, een bevestiging dat met de securitisatie artikel 24, leden 1 tot en met 3, van Verordening (EU) 2017/2402 in acht wordt genomen.   | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT24 | Artikel 24, lid 5 | Overdracht door middel van cessie en in een later stadium voltooid  |   | √ |  | Wanneer de overdracht van de onderliggende blootstellingen plaatsvindt door middel van een cessie en wordt voltooid in een later stadium dan bij de closing van de transactie, een beknopte toelichting geven over de vraag hoe en of die voltooiing is uitgevoerd via de vereiste minimale vooraf bepaalde event triggers die in artikel 24, lid 5, van Verordening (EU) 2017/2402 zijn opgesomd.  | Rubriek 3.3 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT25 | Artikel 24, lid 6 | Verklaringen en garanties   |   | √ |  | Een beknopte toelichting over de vraag of door de verkoper verklaringen en garanties worden verstrekt dat de activa die de securitisatie omvat, niet bezwaard zijn of anderszins in een toestand verkeren waarvan te voorzien is dat deze een negatieve invloed zal hebben op de afdwingbaarheid van de true sale, cessie of overdracht met dezelfde rechtsgevolgen.  | Rubriek 2.2.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT26 | Artikel 24, lid 7 | Toelaatbaarheidscriteria die geen ruimte laten voor actief portefeuillebeheer van de onderliggende blootstellingen op discretionaire basis. |   | √ |  | Een beknopte toelichting over de volgende punten: <ul style="list-style-type: none"> <li>— hoe de onderliggende blootstellingen die de verkoper overdraagt of cedeert aan de SSPE, voldoen aan vooraf vastgestelde, duidelijke en gedocumenteerde toelaatbaarheidscriteria die geen ruimte laten voor actief portefeuillebeheer van die blootstellingen op discretionaire basis;</li> <li>— hoe de selectie en overdracht van de onderliggende blootstellingen in de securitisatie is gebaseerd op duidelijke processen die het mogelijk maken te identificeren welke blootstellingen zijn geselecteerd voor of worden overgedragen naar de securitisatie en die geen ruimte laten voor actief portefeuillebeheer van die blootstellingen op discretionaire basis.</li> </ul> | Afdeling 2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980    |

|         |                    |  |   |  |   |  |  |
|---------|--------------------|--|---|--|---|--|--|
| STSAT27 | Artikel 24, lid 8  | Geen hersecuritisatie  | √ |  |   | Bevestiging dat de onderliggende blootstellingen geen securitisatieposities bevatten en dat de securitisatie waarvan wordt kennisgegeven, dus geen hersecuritisatie is.  | Rubriek 2.2.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSAT28 | Artikel 24, lid 9  | Overgedragen onderliggende blootstellingen zonder blootstellingen in wanbetaling   |   |  | √ | Een nadere toelichting over de vraag hoe de overgedragen onderliggende blootstellingen, op het tijdstip van selectie, geen blootstellingen in wanbetaling (of geherstructureerde blootstellingen) in de zin van artikel 24, lid 9, van Verordening (EU) 2017/2402 bevatten, voor zover van toepassing. In voorkomend geval een duidelijke verklaring of de securitisatie enige verminderde kredietwaardigheid bevat op het tijdstip van securitisatie zoals genoemd in artikel 24, lid 9, onder a), i) van Verordening (EU) 2017/2402.<br>Bevestiging dat:<br>— op het tijdstip van initiëring aan de vereisten van artikel 24, lid 9, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan;<br>— op het tijdstip van selectie aan de vereisten van artikel 24, lid 9, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan. | Rubriek 2.2.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSAT29 | Artikel 24, lid 10 | Ten minste één betaling op tijdstip overdracht   | √ |  |   | Bevestiging dat, op het tijdstip van overdracht van de blootstellingen, de debiteuren ten minste één betaling hebben gedaan.<br>Wanneer geen betaling is gedaan, een verklaring waarom dit het geval is, samen met een verklaring over de vraag of het bij de redenen daarvoor gaat om een van de op grond van artikel 20, lid 12, van Verordening (EU) 2017/2402 toegestane uitzonderingen gaat.  | Rubrieken 3.3 en 3.4.6 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT30 | Artikel 24, lid 11 | De structuur van de terugbetaling van de houders is niet van dien aard dat de terugbetaling overwegend afhankelijk is van de verkoop van activa. |   |  | √ | Een nadere toelichting bij de mate waarin de terugbetalingen van de houders van de securitisatiepositie afhankelijk is van de verkoop van activa die onderliggende blootstellingen afdekken. In voorkomend geval, een nadere verklaring over de vraag of terugbetalingen van de beleggers niet afhankelijk geacht worden van de verkoop van activa, zoals gespecificeerd in artikel 24, lid 11, tweede alinea, van Verordening (EU) 2017/2402.   | Rubriek 3.4.1 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |

|         |                    |  |   |   |  |  |  |
|---------|--------------------|--|---|---|--|--|--|
| STSAT31 | Artikel 24, lid 12 | Limitering rente- (IR) en valutarisico's (FX)  |   | √ |  | Een beknopte toelichting over de vraag of en hoe rente- en valutarisico's passend worden gelimiteerd en een bevestiging dat over de daartoe genomen maatregelen informatie wordt verschaft.<br>Een beknopte toelichting over de vraag of gebruikte hedginginstrumenten volgens breed aanvaarde normen zijn overgenomen en gedocumenteerd.  | Rubrieken 3.4.2 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT32 | Artikel 24, lid 12 | Door SSPE gekochte/verkochte derivaten   |   | √ |  | Tenzij voor het afdekken van rente- of valutarisico, een beknopte toelichting over de vraag of de SSPE geen derivatencontracten heeft gesloten.  | Rubrieken 3.4.2 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT33 | Artikel 24, lid 12 | Derivaten in onderliggende blootstellingen   |   | √ |  | Een beknopte toelichting over de aanwezigheid van derivaten in de pool onderliggende blootstellingen.  | Rubrieken 3.4.2 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT34 | Artikel 24, lid 12 | Derivaten waarvoor gebruikelijke normen worden gebruikt.                                   |   | √ |  | Een beknopte verklaring over de vraag of op grond van artikel 24, lid 12, toegelaten derivaten worden overgenomen en gedocumenteerd volgens de in de internationale financiële wereld gebruikelijke normen.  | Rubrieken 3.4.7 en 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980   |
| STSAT35 | Artikel 24, lid 13 | Duidelijke en consistente definities met betrekking tot de behandeling van problemleningen | √ |   |  | Bevestiging dat in de onderliggende documentatie duidelijke en consistente definities, remedies en maatregelen met betrekking tot de in artikel 24, lid 13, Verordening (EU) 2017/2402 genoemde schuldsituaties worden gegeven.  | Rubriek 2.2.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980            |
| STSAT36 | Artikel 24, lid 13 | Betalingsrangorde en trigger-events  | √ |   |  | Bevestiging dat de transactiedocumentatie de betalingsrangorde en trigger-events overeenkomstig artikel 24, lid 13, van Verordening (EU) 2017/2402 geeft.  | Rubrieken 3.4.7 en 3.4.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT37 | Artikel 24, lid 14 | Gegevens historische wanbetalings- en verliesprestaties                                    | √ |   |  | Bevestiging dat de op grond van artikel 24, lid 14, van Verordening (EU) 2017/2402 verplicht beschikbaar te stellen gegevens beschikbaar zijn, met de duidelijke vermelding waar de informatie vóór de beprijzing voor potentiële beleggers beschikbaar is.<br>Wanneer de sponsor geen toegang tot die gegevens heeft, bevestiging dat de verkoper toegang heeft gegeven tot gegevens overeenkomstig artikel 24, lid 14, van Verordening (EU) 2017/2402. | Rubriek 2.2.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980            |

|         |                    |  |  |  |   |  |   |
|---------|--------------------|--|--|--|---|--|---|
|         |                    |  |  |  |   | Bevestiging dat de gegevens beschikbaar zijn en duidelijk vermelden of de informatie beschikbaar is en dat de gegevens een termijn van ten minste vijf jaar bestrijken, met uitzondering van gegevens met betrekking tot handelsvorderingen en andere kortlopende vorderingen, waarvoor de gegevensreeks ten minste drie jaar beslaat.   |   |
| STSAT38 | Artikel 24, lid 15 | Homogeniteit activa                          |  |  | √ | Een nadere toelichting over de vraag hoe de securitisatie wordt gedekt door een pool van onderliggende blootstellingen die homogeen zijn, rekening houdende met de kenmerken die verband houden met de kasstromen van verschillende types activa, waaronder de contractuele, kredietrisico- en vervroegdeaflossingskenmerken ervan.  | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Ge-delegeerde Veror-dening (EU) 2019/980 |
| STSAT39 | Artikel 24, lid 15 | Verplichtingen onderliggende blootstellingen |  |  | √ | Bevestiging dat de pool van onderliggende blootstellingen een gewogen gemiddelde overblijvende looptijd heeft van niet meer dan één jaar en dat geen van de onderliggende blootstellingen een resterende looptijd van meer dan drie jaar heeft.<br>Bevestiging of de afwijking met betrekking tot pools van autoleningen, auto-leases en materieel-leasetransacties van toepassing is, overeenkomstig artikel 24, lid 15, derde alinea, van Verordening (EU) 2017/2402.  | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Ge-delegeerde Veror-dening (EU) 2019/980 |
| STSAT40 | Artikel 24, lid 15 | Verplichtingen onderliggende blootstellingen |  |  | √ | In voorkomend geval bevestiging dat de onderliggende activa:<br>— geen leningen bevatten die gedekt zijn door hypothecaire leningen voor woondoeleinden of zakelijke doeleinden of volledig gedekte woonkredieten als bedoeld in Verordening (EU) nr. 575/2013, artikel 129, lid 1, eerste alinea, onder e) <sup>(2)</sup> ;<br>— verplichtingen bevatten die contractueel bindend en afdwingbaar zijn, met volledig verhaalsrecht op debiteuren en met welomschreven betalingsstromen in verband met huur, hoofdsom, rente, of met betrekking tot een ander recht om baten te ontvangen uit hoofde van activa die dergelijke betalingen rechtvaardigen; | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Ge-delegeerde Veror-dening (EU) 2019/980 |

|         |                    |   |   |   |   |  |   |
|---------|--------------------|---|---|---|---|--|---|
|         |                    |   |   |   |   | — geen andere effecten, in de zin van artikel 4, lid 1, punt 44, van Richtlijn 2014/65/EU <sup>(3)</sup> , bevatten dan bedrijfsobligaties die niet op een handelsplatform zijn genoteerd.   |   |
| STSAT41 | Artikel 24, lid 16 | Referentierentebetalings op basis van algemeen gebruikelijke rentevoeten                                      |   | √ |   | Een beknopte toelichting over de vraag hoe en of referentierentebetalings in het kader van de activa en verplichtingen van de ABCP-securitisatie zijn berekend op basis van algemeen gebruikelijke marktrentevoeten, of op in de sector doorgaans gehanteerde rentevoeten die een weerspiegeling van de financieringskosten vormen.    | Rubrieken 2.2.2 en 2.2.13 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT42 | Artikel 24, lid 17 | Geen insluiting van contanten na een sommatie tot nakoming of een sommatie tot vervroegde betaling            |   | √ |   | Een beknopte toelichting over de vraag of aan elk van de vereisten van artikel 24, lid 17, van Verordening (EU) 2017/2402 is voldaan, met inbegrip van een beknopte toelichting bij gevallen van insluiting van contanten.   | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |
| STSAT43 | Artikel 24, lid 17 | a) Geen insluiting van contanten na een sommatie tot nakoming of tot vervroegde betaling                      | √ |   |   | Bevestiging dat geen contanten ingesloten raken na een sommatie tot nakoming of een sommatie tot vervroegde betaling.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |
| STSAT44 | Artikel 24, lid 17 | b) Ontvangen hoofdsommen moeten worden doorgegeven aan beleggers.   | √ |   |   | Bevestiging dat uit hoofde van de onderliggende blootstellingen ontvangen hoofdsommen via sequentiële aflossing van de securitisatieposities, als bepaald door de rangorde van de securitisatiepositie, aan beleggers worden doorgegeven.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |
| STSAT45 | Artikel 24, lid 17 | c) Geen bepalingen die automatische liquidatie van de onderliggende blootstellingen tegen marktwaarde vergen. | √ |   |   | Bevestiging dat geen bepalingen automatische liquidatie onderliggende blootstellingen tegen marktwaarde vergen.  | Rubriek 3.4.5 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |
| STSAT46 | Artikel 24, lid 18 | Gedegenheid afsluitstandaarden  |   |   | √ | Een nadere toelichting over de vraag of de onderliggende blootstellingen zijn geïnitieerd in het kader van de normale bedrijfsuitoefening van de verkoper, waarbij wordt gespecificeerd of de toegepaste afsluitstandaarden niet minder streng zijn dan die welke zijn gehanteerd voor blootstellingen die niet waren gesecuritiseerd. | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980             |

|         |                    |  |   |  |   |   |  |
|---------|--------------------|--|---|--|---|---|--|
|         |                    |  |   |  |   | Een nadere toelichting over de vraag of aan de sponsor en aan andere rechtstreeks aan de ABCP-securitisatie blootgestelde partijen alle informatie over materiële wijzigingen van eerdere afsluitstandaarden is verschaft.                    |  |
| STSAT47 | Artikel 24, lid 18 | Expertise verkoper   |   |  | √ | Een nadere toelichting over de vraag of de verkoper beschikt over expertise in het initiëren van blootstellingen die vergelijkbaar zijn met die welke worden gesecuritiseerd.   | Rubriek 2.2.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980        |
| STSAT48 | Artikel 24, lid 19 | Revolverende ABCP-transactie/trigger kredietkwaliteit                    |   |  | √ | Een beknopte toelichting over de vraag hoe de bepalingen of triggers uit artikel 24, lid 19, van Verordening (EU) 2017/2402 is opgenomen in de securitisatiedocumentatie.   | Rubrieken 2.3 en 2.4 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAT49 | Artikel 24, lid 20 | Taken deelnemer securitisatie  | √ |  |   | Bevestiging dat de securitisatiedocumenten de contractuele verplichtingen, taken en verantwoordelijkheden van de sponsor, de servicer en de eventuele trustee, en van andere aanbidders van verwante diensten bevat.                          | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSAT50 | Artikel 24, lid 20 | Continuïteitsbepalingen servicing  | √ |  |   | Bevestiging dat de securitisatiedocumentatie de processen en verantwoordelijkheden bevat die noodzakelijk zijn om ervoor te zorgen dat een wanbetaling of insolventie van de servicer niet in een beëindiging van de servicing resulteert.    | Rubriek 3.7 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSAT51 | Artikel 24, lid 20 | Continuïteitsbepalingen tegenpartijen derivaten en rekeninghoudende bank | √ |  |   | Bevestiging dat de securitisatiedocumentatie bepalingen bevat die, in voorkomend geval, zorgen voor de vervanging van tegenpartijen bij derivaten en de rekeninghoudende bank bij wanbetaling, insolventie en andere vermelde gebeurtenissen. | Rubriek 3.8 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |
| STSAT52 | Artikel 24, lid 20 | Robuustheid sponsor  | √ |  |   | Bevestiging dat de securitisatiedocumentatie bepalingen bevat over de wijze waarop de sponsor aan de vereisten van artikel 25, lid 3, van Verordening (EU) 2017/2402 voldoet.   | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980          |

(<sup>1</sup>) In voorkomend geval een verwijzing opnemen naar de desbetreffende onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is).

(<sup>2</sup>) Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad van 26 juni 2013 betreffende prudentiële vereisten voor kredietinstellingen en beleggingsondernemingen en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (PB L 176 van 27.6.2013, blz. 1).

(<sup>3</sup>) Richtlijn 2014/65/EU van het Europees Parlement en de Raad van 15 mei 2014 betreffende markten voor financiële instrumenten en tot wijziging van Richtlijn 2002/92/EG en Richtlijn 2011/61/EU (PB L 173 van 12.6.2014 blz. 349).

## BIJLAGE III

Met betrekking tot ABCP-programma's bij ESMA overeenkomstig de artikelen 25 en 26 van Verordening (EU) 2017/2402 in te dienen informatie

## Algemene informatie

| Veldnummer | Artikel van Verordening (EU) 2017/2402 | VELDNAAM                       | TE RAPPORTEREN INHOUD <sup>(1)</sup>  | AANVULLENDE INFORMATIE   |
|------------|--|--------------------------------|---|--|
| STSAP0     | Artikel 27, lid 1                      | Eerste aanspreekpunt           | Identificatiecode voor rechtspersonen (Legal Entity Identifier — LEI) van de als eerste aanspreekpunt aangewezen entiteit en naam van de betrokken bevoegde autoriteit.             | Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                  |
| STSAP1     | N.v.t.                                 | Identificatiecode instrument   | Aan de ABCP-programma's toegekende internationa(a)l(e) effectenidentificatienummer(s) (ISIN) (voor zover beschikbaar).  | Wanneer beschikbaar op grond van rubriek 3.1 van bijlage 19 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAP2     | N.v.t.                                 | Legal Entity Identifier (LEI)  | De identificatiecode voor rechtspersonen (LEI) van de sponsor(s) en/of ABCP-programma(s) (voor zover beschikbaar).  | Rubriek 4.2 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                   |
| STSAP3     | N.v.t.                                 | Identificatiecode kennisgeving | Bij het rapporteren van een bijwerking het unieke referentienummer dat door ESMA aan de vorige STS-kennisgeving is toegekend.   | N.v.t.   |
| STSAP4     | N.v.t.                                 | Unieke identificatiecode       | De unieke door de rapporterende entiteit in overeenstemming met artikel 11, lid 1, van Gedelegeerde Verordening (EU) 2020/1224 aan dit ABCP-programma toegekende identificatiecode. | N.v.t.   |
| STSAP5     | N.v.t.                                 | Identificatiecode prospectus   | De door de betrokken bevoegde autoriteit toegekende identificatiecode van het prospectus (voor zover beschikbaar).  | N.v.t.   |
| STSAP6     | N.v.t.                                 | Securitisatieregister          | De naam van het geregistreerde securitisatieregister (voor zover beschikbaar).  | N.v.t.   |
| STSAP7     | N.v.t.                                 | Naam securitisatie             | De naam van het ABCP-programma.   | Afdeling 4 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                    |
| STSAP8     | Artikel 18 en artikel 27, lid 3        | Land van vestiging             | Het land van vestiging van de sponsor(s).   | Rubriek 4.3 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980                                   |
| STSAP9     | N.v.t.                                 | Indeling securitisatie         | Het soort securitisatie (niet-ABCP, ABCP, ABCP-programma).  | N.v.t.   |



|         |                   |                                 |   |  |
|---------|-------------------|---------------------------------|---|--|
| STSAP10 | N.v.t.            | Uitgiftedatum                   | Datum van de eerste uitgifte van het ABCP-programma.  | Rubriek 4 van bijlage 9 bij Gedelegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAP11 | N.v.t.            | Kennisgevingsdatum              | Datum STS-kennisgeving aan ESMA.  | N.v.t.   |
| STSAP12 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, een verklaring dat de inachtneming van de STS-criteria is bevestigd door die vergunninghoudende derde partij. | N.v.t.   |
| STSAP13 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, de naam van die derde partij en haar plaats van vestiging.  | N.v.t.   |
| STSAP14 | Artikel 27, lid 2 | Vergunninghoudende derde partij | Wanneer een vergunninghoudende derde partij STS-controlediensten heeft verricht in overeenstemming met artikel 27, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402, de naam van de bevoegde autoriteit die haar de vergunning heeft afgegeven.                                    | N.v.t.   |
| STSAP15 | Artikel 27, lid 5 | STS-status                      | Kennisgeving van de sponsor dat het ABCP-programma niet langer als STS geldt en de redenen voor die verandering.  | N.v.t.   |

(<sup>1</sup>) In voorkomend geval een verwijzing opnemen naar de desbetreffende onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is).

### Specifieke informatie

| Veldnummer | Artikel van Verordening (EU) 2017/2402 | VELDNAAM   | Bevestiging | Beknopte toelichting | Nadere toelichting | TE RAPPORTEREN INHOUD ( <sup>1</sup> )  | AANVULLENDE INFORMATIE |
|------------|--|--|-------------|----------------------|--------------------|---|------------------------|
| STSAP16    | Artikel 25, lid 1                      | Sponsor is onder toezicht vallende kredietinstelling   | √           |                      |                    | Bevestiging dat de sponsor van het programma een onder toezicht vallende kredietinstelling is en link naar een document dat die status staft.   | N.v.t.                 |
| STSAP17    | Artikel 25, lid 2                      | Ondersteuning door sponsor als liquiditeitsverschaffer | √           |                      |                    | Bevestiging dat de sponsor van het ABCP-programma een liquiditeitsfaciliteit aanbiedt en dat hij alle securitisatieposities op het ABCP-programma ondersteunt, alsmede een beschrijving van de liquiditeitsfaciliteit en een link naar een document waaruit blijkt dat die faciliteit wordt aangeboden. | N.v.t.                 |

|         |                   |   |   |   |  |  |  |
|---------|-------------------|---|---|---|--|--|--|
| STSAP18 | Artikel 25, lid 3 | Bewijsvoering ten genoegen van bevoegde autoriteit kredietinstelling  | √ |   |  | Bevestiging dat de kredietinstelling, wat haar rol als sponsor betreft, haar solvabiliteit en liquiditeit niet in gevaar brengt, en (voor zover beschikbaar) een link naar het document waaruit blijkt dat zij deze positie ten genoegen van haar bevoegde autoriteit heeft aangetoond.  | N.v.t.   |
| STSAP19 | Artikel 25, lid 4 | Inachtneming due diligence-vereisten sponsor  | √ |   |  | Bevestiging dat de sponsor de due diligenceverplichtingen van, naargelang het geval, artikel 5, leden 1 en 3, van Verordening (EU) 2017/2402 in acht neemt. Bevestiging dat de sponsor is nagegaan dat de verkoper beschikt over de vereiste servicingcapaciteiten en inningsprocessen die voldoen aan de vereisten van artikel 265, lid 2, onder i) tot en met p), van Verordening (EU) nr. 575/2013, of aan gelijkwaardige vereisten in derde landen.  | N.v.t.   |
| STSAP20 | Artikel 25, lid 5 | De verkoper (op transactieniveau) of de sponsor (op ABCP-programmaniveau) voldoet aan de in artikel 6 bepaalde risicobehoudvereisten. |   | √ |  | Een beknopte toelichting bij de vraag hoe de verkoper (ABCP-securitisatie) of de sponsor (ABCP-programma) voldoet aan de in artikel 6 van Verordening (EU) 2017/2402 bepaalde risicobehoudvereisten, met vermelding van de optie die voor het risicobehoud is gebruikt, waaronder: <ol style="list-style-type: none"> <li>1) vertical slice — d.w.z. artikel 6, lid 3, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>2) aandeel van de verkoper — d.w.z. artikel 6, lid 3, onder b), van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>3) willekeurig gekozen blootstellingen die op de balans worden gehouden — d.w.z. artikel 6, lid 3, onder c), van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>4) eersteverliestranché — d.w.z. artikel 6, lid 3, onder d), van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>5) eersteverliesblootstelling bij elk actief — artikel 6, lid 3, onder e), van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>6) niet-inachtneming van risicobehoudvereisten van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>7) andere.</li> </ol> | Rubriek 3.4.3 van bijlage 19 bij Ge-delegeerde Verordening (EU) 2019/980 |
| STSAP21 | Artikel 25, lid 6 | Inachtneming artikel 7 van Verordening (EU) 2017/2402 op niveau ABCP-programma  | √ |   |  | Bevestiging dat: <ul style="list-style-type: none"> <li>— de sponsor verantwoordelijk is voor de inachtneming van artikel 7 Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>— de sponsor artikel 7 in acht neemt op het niveau van het ABCP-programma;</li> </ul>   | N.v.t.   |

|         |   |   |  |   |   |  |        |
|---------|---|---|--|---|---|--|--------|
|         |   |   |  |   |   | <ul style="list-style-type: none"> <li>— de sponsor aan potentiële beleggers vóór beprijzing en op hun verzoek heeft beschikbaar gesteld: de krachtens artikel 7, lid 1, eerste alinea, onder a), van Verordening (EU) 2017/2402 vereiste geaggregeerde informatie, en de krachtens artikel 7, lid 1, eerste alinea, onder b) tot en met e), van Verordening (EU) 2017/2402 vereiste informatie, ten minste in ontwerpvorm of in initiële vorm.</li> </ul>   |        |
| STSAP22 | Artikel 25, lid 7                         | Opname liquiditeitsfaciliteit, wanneer financieringstoezeggingen van de liquiditeitsfaciliteit niet door de sponsor worden verlengd.    |  | √ |   | Een beknopte verklaring van de sponsor over de vraag of de liquiditeitsfaciliteit wordt opgenomen en de vervallen effecten worden terugbetaald ingeval de sponsor de financieringstoezegging van de liquiditeitsfaciliteit niet vóór het verstrijken ervan verlengt.   | N.v.t. |
| STSAP23 | Artikel 26, lid 1                         | Inachtneming door ABCP-securitisaties binnen een ABCP-programma van artikel 24, leden 1 t/m 8 en leden 12 t/m 20.                       |  | √ |   | Bevestiging dat alle ABCP-securitisaties binnen het programma aan de volgende vereisten voldoen: <ul style="list-style-type: none"> <li>— artikel 24, leden 1 tot en met 8, van Verordening (EU) 2017/2402;</li> <li>— artikel 24, leden 12 tot en met 20, van Verordening (EU) 2017/2402.</li> </ul>  | N.v.t. |
| STSAP24 | Artikel 26, lid 1, tweede en derde alinea | Max. 5 % geaggregeerde bedrag onderliggende blootstellingen van de ABCP mag tijdelijk niet aan bepaalde vereisten voldoen.              |  |   | √ | Een nader toelichting over de vraag of en zo ja welke van de vereisten van artikel 24, lid 9, 10 of 11, van Verordening (EU) 2017/2402 tijdelijk niet in acht worden genomen en het percentage van het geaggregeerde bedrag van de onderliggende blootstellingen van de ABCP-securitisaties die dat vertegenwoordigt, en de redenen waarom het programma tijdelijk die vereisten heeft overtreden. Bevestiging dat een steekproef van de onderliggende blootstellingen regelmatig wordt onderworpen aan een externe verificatie door een passende en onafhankelijke partij op de naleving. | N.v.t. |
| STSAP25 | Artikel 26, lid 2                         | Gewogen gemiddelde overblijvende looptijd (WAL) van de onderliggende blootstellingen van een ABCP-programma is niet meer dan twee jaar. |  | √ |   | Bevestiging dat de maximale gewogen gemiddelde overblijvende looptijd van de onderliggende blootstellingen van een ABCP-programma niet meer dan twee jaar belooft.   | N.v.t. |

|         |                             |  |   |   |   |  |        |
|---------|-----------------------------|--|---|---|---|--|--------|
| STSAP26 | Artikel 26, lid 3           | Volledig ondersteund ABCP-programma (ondersteuning sponsor)  |   | √ |   | Een beknopte toelichting bij de vraag of het ABCP-programma al dan niet volledig door een sponsor wordt ondersteund overeenkomstig artikel 25, lid 2, van Verordening (EU) 2017/2402.  | N.v.t. |
| STSAP27 | Artikel 26, lid 4           | Geen hersecuritisaties en geen kredietverbetering doet een tweede laag van onderverdeling in tranches ontstaan op het niveau van het ABCP-programma. | √ |   |   | Bevestiging dat het ABCP-programma geen hersecuritisaties bevat en dat de kredietverbetering geen tweede laag van onderverdeling in tranches op het niveau van het programma doet ontstaan.  | N.v.t. |
| STSAP28 | Artikel 26, lid 5           | Geen callopties  | √ |   |   | Bevestiging dat het ABCP-programma geen calloptie of andere clausules met effect op de eindvervaldag van effecten, die naar eigen goeddunken van de verkoper, sponsor of SSPE kunnen worden uitgeoefend of uitgevoerd.   | N.v.t. |
| STSAP29 | Artikel 26, lid 6           | Rente- en valutarisico's op niveau ABCP-programma afdoende gelimiteerd en gedocumenteerd   |   |   | √ | Een nadere toelichting bij de vraag of en hoe de rente- en valutarisico's die op het niveau van het ABCP-programma ontstaan, afdoende worden gelimiteerd en over alle daartoe genomen maatregelen, met inbegrip van de vraag of de SSPE derivatencontracten heeft afgesloten om andere redenen dan die welke in artikel 26, lid 6, van Verordening (EU) 2017/2402 worden genoemd, en een beschrijving van de wijze waarop die derivaten worden overgenomen en gedocumenteerd, en met name of dit in overeenstemming met in de internationale financiële wereld gebruikelijke normen gebeurt. | N.v.t. |
| STSAP30 | Artikel 26, lid 7, onder a) | Vereisten voor documentatie ABCP-programma (verantwoordelijkheden trustee t.o.v. beleggers)  | √ |   |   | Bevestiging dat de verantwoordelijkheden van de eventuele trustee en eventuele andere entiteiten met fiduciaire verplichtingen tegenover de beleggers duidelijk in de documentatie ABCP-programma zijn vermeld.  | N.v.t. |
| STSAP31 | Artikel 26, lid 7, onder b) | Vereisten voor documentatie ABCP-programma (contractuele verplichtingen sponsor)   | √ |   |   | Bevestiging dat de contractuele verplichtingen, taken en verantwoordelijkheden van de sponsor, de eventuele trustee en andere aanbieders van verwante diensten duidelijk zijn vermeld in de documentatie van het ABCP-programma.   | N.v.t. |

|         |                             |  |   |  |  |  |        |
|---------|-----------------------------|--|---|--|--|--|--------|
| STSAP32 | Artikel 26, lid 7, onder c) | Vereisten voor documentatie ABCP-programma (processen en verantwoordelijkheid in geval van servicer in wanbetaling)  | √ |  |  | Bevestiging dat de documentatie van het ABCP-programma processen en verantwoordelijkheden bevat die noodzakelijk zijn om ervoor te zorgen dat een wanbetaling of insolventie van de servicer niet in een beëindiging van de servicing resulteert.  | N.v.t. |
| STSAP33 | Artikel 26, lid 7, onder d) | Vereisten voor documentatie ABCP-programma (bepalingen m.b.t. vervanging tegenpartijen derivaten en rekeninghoudende bank)   | √ |  |  | Bevestiging dat de vereisten op grond van artikel 26, lid 7, onder d), van Verordening (EU) 2017/2402 in acht zijn genomen wat betreft de bepalingen met betrekking tot de vervanging van tegenpartijen bij derivaten en de rekeninghoudende bank op ABCP-programmaniveau bij wanbetaling, insolventie en andere gespecificeerde gebeurtenissen, indien de liquiditeitsfaciliteit deze gebeurtenissen niet dekt.   | N.v.t. |
| STSAP34 | Artikel 26, lid 7, onder e) | Vereisten voor documentatie ABCP-programma (procedures om zekerheidsstelling financieringstoezegging veilig te stellen)  | √ |  |  | Bevestiging dat de documentatie van het ABCP-programma procedures bevat die garanderen dat bij gespecificeerde gebeurtenissen, wanbetaling of insolventie van de sponsor, in remediërende stappen wordt voorzien om, al naargelang, tot zekerheidsstelling voor de financieringstoezegging of vervanging van de aanbieder van een liquiditeitsfaciliteit te komen.<br>Een verklaring met vermelding van de desbetreffende bladzijden van het prospectus of andere onderliggende documentatie die de voor de vereisten van artikel 26, lid 7, onder e), van Verordening (EU) 2017/2402 relevante informatie bevatten. | N.v.t. |
| STSAP35 | Artikel 26, lid 7, onder f) | Vereisten voor documentatie ABCP-programma (liquiditeitsfaciliteit en vervallen effecten worden terugbetaald indien sponsor financieringstoezegging liquiditeitsfaciliteit niet vóór het verstrijken ervan verlengt) | √ |  |  | Bevestiging dat de documentatie van het ABCP-programma bepalingen bevat die garanderen dat de liquiditeitsfaciliteit wordt opgenomen en de vervallen effecten worden terugbetaald indien de sponsor de financieringstoezegging van de liquiditeitsfaciliteit niet vóór het verstrijken ervan verlengt.<br>Een verklaring met vermelding van de desbetreffende bladzijden van het prospectus of andere onderliggende documentatie die de voor de vereisten van artikel 26, lid 7, onder f), van Verordening (EU) 2017/2402 relevante informatie bevatten.   | N.v.t. |

|         |                   |                    |  |  |   |  |
|---------|-------------------|--------------------|--|--|---|--|
| STSAP36 | Artikel 26, lid 8 | Expertise servicer |  |  | <p>√</p> <p>Een nadere toelichting over de vraag hoe aan de vereisten van artikel 26, lid 8, van Verordening (EU) 2017/2402 wordt voldaan, met inbegrip van de beleidslijnen en procedures die de inachtneming van deze vereisten moeten borgen.</p> <p>Een verklaring met vermelding van de desbetreffende bladzijden van het prospectus of andere onderliggende documentatie met de toepasselijke toelichting om te voldoen aan de vereisten van artikel 26, lid 8, van Verordening (EU) 2017/2402 (al naargelang) (“expertise servicer, beleidslijnen, procedures en risicobeheer”).</p> | <p>Rubriek 3.2 van bijlage 19 bij Ge-delegeerde Veror-dening (EU) 2019/980</p> |
|---------|-------------------|--------------------|--|--|---|--|

(<sup>1</sup>) In voorkomend geval een verwijzing opnemen naar de desbetreffende onderdelen van de onderliggende documentatie (voor zover die informatie beschikbaar is).