

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2015/3**av den 30 september 2014****om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EG) nr 1060/2009 med avseende på tekniska tillsynsstandarder för informationskrav för strukturerade finansiella instrument****(Text av betydelse för EES)**

EUROPEISKA KOMMISSIONEN HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av Europaparlamentets och rådets förordning (EG) nr 1060/2009 av den 16 september 2009 om kreditvärderingsinstitut ⁽¹⁾, särskilt artikel 8b.3 tredje stycket,

av följande skäl:

- (1) I enlighet med artikel 8b i förordning (EG) nr 1060/2009, bör investerare få tillräckligt med information om sina underliggande tillgångars kvalitet och resultat för att göra det möjligt för dem att utföra en informerad bedömning av de strukturerade finansiella instrumentens kreditvärdighet. Detta skulle även minska investerarnas beroende av kreditbetyg och underlätta utfärdandet av kreditbetyg på eget initiativ.
- (2) Denna förordning bör gälla för alla finansiella instrument eller andra tillgångar som är resultatet av en värdepapperiseringstransaktion eller ett värdepapperiseringsprogram som avses i artikel 4.1.61 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 ⁽²⁾ under förutsättning att emittenten, originatorn eller det medverkande institutet är etablerat, och för detta ändamål har sitt säte, inom unionen. Denna förordning bör därför endast omfatta finansiella instrument eller andra tillgångar som är ett resultat av transaktioner eller program varigenom den kreditrisk som är förenad med en exponering eller en grupp exponeringar delas upp i trancher, och som har de egenskaper som avses i artikeln. En exponering som, i linje med nämnda förordning, skapar en direkt betalningsskyldighet för en transaktion eller ett program som används för att finansiera eller förvalta materiella tillgångar bör därför inte betraktas som en exponering mot en värdepapperisering, även om transaktionen eller programmet har betalningsskyldigheter av varierande senioritet.
- (3) Denna förordnings tillämpningsområde bör inte begränsas till emission av strukturerade finansiella instrument som betecknas som värdepapper, utan bör även inkludera andra finansiella instrument och tillgångar som är resultatet av en värdepapperiseringstransaktion eller ett värdepapperiseringsprogram, såsom penningmarknadsinstrument, inklusive program för tillgångsbaserade certifikat. Denna förordning ska dessutom tillämpas på strukturerade finansiella instrument med och utan kreditbetyg som tilldelats av ett kreditvärderingsinstitut som är registrerat inom unionen. Privata och bilaterala transaktioner bör också omfattas av förordningen, liksom transaktioner som inte erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel på en reglerad marknad.
- (4) Denna förordning innehåller standardmallar för information om ett antal tillgångsklasser. Utan att det påverkar förordningens tillämpningsområde och fram till dess att rapporteringsskyldigheter har tagits fram av Esma och antagits av kommissionen, bör sådana standardmallar och alla rapporteringsskyldigheter enligt denna förordning endast gälla för strukturerade finansiella instrument som bygger på underliggande tillgångar som ingår i förteckningen över underliggande tillgångsklasser som specificeras i denna förordning och som dessutom inte är av privat eller bilateral natur.
- (5) Vid efterlevnad av denna förordning bör emittenter, originatorer och medverkande institut uppfylla kraven i nationell rätt eller unionsrätten om källskydd eller behandling av personuppgifter, för att undvika eventuella överträdelser av sådan lagstiftning.

⁽¹⁾ EUT L 302, 17.11.2009, s. 1.⁽²⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 av den 26 juni 2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 (EUT L 176, 27.6.2013, s. 1).

- (6) Emittenten, originatorn och det medverkande institutet kan utse en enhet med ansvar för att rapportera informationen till webbplatsen som ska inrättas av Esma i enlighet med artikel 8b.4 i förordning (EG) nr 1060/2009 (nedan kallad *webbplatsen för strukturerade finansiella instrument*). Utkontraktering av rapporteringsskyldighet till annan enhet, till exempel ett serviceföretag, bör även vara möjligt. Detta bör inte påverka emittentens, originatorns och det medverkande institutets ansvar enligt denna förordning.
- (7) Ett antal tekniska rapporteringsinstruktioner, bland annat angående överföring eller format på de filer som ska lämnas av emittenter, originatorer och medverkande institut, bör göras tillgängliga av Esma på myndighetens webbplats. Esma bör meddela sådana tekniska rapporteringsinstruktioner i god tid före tillämpningsdagen för de rapporteringsskyldigheter som fastställts i denna förordning, för att ge emittenter, originatorer, medverkande institut och övriga parter tillräckligt med tid för att utveckla lämpliga system och förfaranden i enlighet med de meddelade tekniska instruktionerna.
- (8) Den information som ska tillhandahållas i enlighet med denna förordning ska lämnas i standardiserat format för att medge automatisk bearbetning av uppgifterna på webbplatsen för strukturerade finansiella instrument. Informationen ska även offentliggöras i ett format som är lättåtkomligt för alla som använder webbplatsen. Esma ska se till att behöriga sektorsmyndigheter har åtkomst till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument för att kunna utföra de uppgifter som tilldelats dem enligt förordning (EG) nr 1060/2009.
- (9) Denna förordning grundar sig på förslaget till tekniska tillsynsstandarder som lämnats av Esma till kommissionen i enlighet med artikel 10 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 ⁽¹⁾.
- (10) Esma har utfört ett öppet offentligt samråd om förslaget till tekniska tillsynsstandarder som ligger till grund för denna förordning, analyserat de potentiella kostnaderna och fördelarna i samband med detta och begärt ett utlåtande av intressentgruppen för värdepapper och marknader i enlighet med artikel 37 i förordning (EU) nr 1095/2010.
- (11) En rimlig tidsperiod är nödvändig för att tillåta emittenter, originatorer och medverkande institut avseende ett strukturerat finansiellt instrument, som är etablerade i unionen, att anta och vidta de nödvändiga åtgärderna för att uppfylla kraven i denna förordning, och för att göra det möjligt för Esma att utveckla webbplatsen för strukturerade finansiella instrument där den information som krävs enligt denna förordning kommer att offentliggöras. Denna förordning bör därför träda i kraft den 1 januari 2017. Esma bör dock meddela nödvändiga tekniska rapporteringsinstruktioner i god tid före dagen för ikraftträdande av denna förordning. Detta är nödvändigt för att ge emittenter, originatorer och medverkande institut avseende ett strukturerat finansiellt instrument, som är etablerade i unionen, tillräckligt med tid för att utveckla lämpliga system och förfaranden enligt dessa tekniska instruktioner för att garantera fullständig och korrekt rapportering och beakta ytterligare utvecklingar på de finansiella marknaderna i unionen.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Tillämpningsområde

Denna förordning ska gälla för strukturerade finansiella instrument där emittenten, originatorn eller det medverkande institutet är etablerade inom unionen och vilka emitteras efter dagen för ikraftträdande av denna förordning.

Artikel 2

Rapporteringsenhet

1. Emittenten, originatorn och det medverkande institutet avseende ett strukturerat finansiellt instrument får utse en eller flera rapporteringsenheter som offentliggör den information som krävs enligt artiklarna 3, 4 och 5.3 i denna förordning på webbplatsen som det hänvisas till i artikel 8b.4 i förordning (EG) nr 1060/2009 (nedan kallad *webbplatsen för strukturerade finansiella instrument*). Sådana enheter ska offentliggöra den erforderade informationen på webbplatsen för strukturerade finansiella instrument i enlighet med artiklarna 4–7 i denna förordning.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 av den 24 november 2010 om inrättande av en europeisk tillsynsmyndighet (Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten), om ändring av beslut nr 716/2009/EG och om upphävande av kommissionens beslut 2009/77/EG (EUT L 331, 15.12.2010, s. 84).

2. Emittenten, originatorn och det medverkande institutet avseende ett strukturerat finansiellt instrument som har utsett den enhet eller de enheter som det hänvisas till i punkt 1 ska anmäla detta till Esma utan otillbörligt dröjsmål för varje enhet som har utsetts i enlighet med den punkten. Utnämmandet ska inte inverka på emittentens, originatorns och det medverkande institutets skyldighet att uppfylla kraven i artikel 8b i förordning (EG) nr 1060/2009.

Artikel 3

Information att rapportera

När någon av de underliggande tillgångar som avses i artikel 4 ligger bakom ett strukturerat finansiellt instrument ska den rapporterande enheten tillhandahålla följande information till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument:

- a) Information om lånenivå genom rapporteringsmallarna i bilagorna I–VII.
- b) Om tillämpligt för ett strukturerat finansiellt instrument ska följande dokument tillhandahållas, inklusive en detaljerad beskrivning av det strukturerade finansiella instrumentets prioritetsordning för kontantflöden för betalningar:
 - i) Det slutgiltiga emissionsdokumentet eller -prospektet, tillsammans med de avslutande transaktionsdokumenten, inklusive eventuella offentliga dokument som det hänvisas till i prospektet eller som reglerar transaktionens funktion och exklusive rättsliga utlåanden.
 - ii) Tillgångens försäljningsavtal, överlåtelse-, novations- eller överföringsavtal och alla relevanta förklaringar angående tillgången.
 - iii) Avtal om förvaltning, säkerhetsförvaltning, administration och likviditetsförvaltning.
 - iv) Stiftelseurkund, säkerhetsavtal, avtal med institut, bankkontoavtal, kontrakt om investeringsgaranti, införlivade villkor eller masterfondramverk eller masterdefinitionsavtal.
 - v) Alla relevanta avtal mellan borgenärer, swapdokumentation, avtal om förlagslån, låneavtal för nyetableringar och avtal om likviditetsfaciliteter.
 - vi) All övrig underliggande dokumentation som är nödvändig för en förståelse av transaktionen.
- c) Om ett prospekt inte har avfattats i enlighet med Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/71/EG ⁽¹⁾, en transaktionssammanfattning eller översikt över ett strukturerat finansiellt instruments huvudegenskaper, inklusive
 - i) affärsstruktur,
 - ii) tillgångens egenskaper, kassaflöden, kreditförstärkning och funktioner för likviditetsstöd,
 - iii) tillgångsinnehavarens rösträtt, förhållandet mellan tillgångsinnehavare och andra borgenärer med säkerhetsrätt i en transaktion,
 - iv) en lista över alla utlösande faktorer och händelser som det hänvisas till i de dokument som tillhandahålls webbplatsen för strukturerade finansiella instrument i enlighet med punkt b som kan få en väsentlig inverkan på de strukturerade finansiella instrumentens resultat,
 - v) strukturdiagram som innehåller en översikt av transaktionen, kassaflödena och ägarstrukturen.
- d) Investerarrapporter som innehåller den information som anges i bilaga VIII.

Artikel 4

Underliggande tillgångar

De informationskrav som avses i artikel 3 ska gälla för strukturerade finansiella instrument som bygger på följande underliggande tillgångar:

- a) Privata hypotekslån: denna klass av strukturerade finansiella instrument inbegriper strukturerade finansiella instrument som bygger på hypotekslån med högsta och annan kreditvärdighet och lån med bostäder som säkerhet. För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga I lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/71/EG av den 4 november 2003 om de prospekt som skall offentliggöras när värdepapper erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel och om ändring av direktiv 2001/34/EG (EUT L 345, 31.12.2003, s. 64)

- b) Kommersiella hypotekslån: Denna klass av strukturerade finansiella instrument inbegriper strukturerade finansiella instrument med affärs- eller kontorsfastighetslån, sjukhuslån, vårdhemslån, lån till lagringsanläggningar, hotelllån, sjukhemslån, industrilån och lån till flerfamiljsfastigheter som säkerhet. För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga II lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.
- c) Lån till små och medelstora företag: För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga III lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.
- d) Billån: För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga IV lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.
- e) Lån till konsumenter: För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga V lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.
- f) Kreditkortslån: För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga VI lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.
- g) Leasingavtal till enskilda personer eller företag: För denna klass av strukturerade finansiella instrument ska information enligt mallen i bilaga VII lämnas till webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.

Artikel 5

Rapporteringsfrekvens

1. Den information som avses i artikel 3 a och d ska göras tillgänglig på kvartalsbasis, inte senare än en månad efter förfallodatum för betalning av ränta på det berörda strukturerade finansiella instrumentet.
2. Den information som avses i artikel 3 b och c ska utan dröjsmål göras tillgänglig efter emissionen av ett strukturerat finansiellt instrument.
3. Utöver de krav som fastställts i punkterna 1 och 2 gäller följande:
 - a) Om de krav som fastställts i artikel 17 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 596/2014⁽¹⁾ om insiderhandel och otillbörlig marknadspåverkan (marknadssmissbruk) även gäller med avseende på ett strukturerat finansiellt instrument ska allt offentliggörande av information i enlighet med denna artikel även därefter offentliggöras utan dröjsmål av den rapporterande enheten på webbplatsen för strukturerade finansiella instrument.
 - b) Om punkt a inte gäller ska den rapporterande enheten utan dröjsmål offentliggöra alla betydande ändringar eller händelser på webbplatsen för strukturerade finansiella instrument i samtliga följande fall:
 - i) Brott mot skyldigheter som fastställts i de dokument som tillhandahållits i enlighet med artikel 3 b.
 - ii) Strukturella funktioner som väsentligt kan inverka på det strukturerade finansiella instrumentets resultat.
 - iii) Riskegenskaper hos det strukturerade finansiella instrumentet och de underliggande tillgångarna.

Artikel 6

Rapporteringsförfaranden

1. Den rapporterande enheten ska lämna in datafiler i enlighet med rapporteringssystemet på webbplatsen för strukturerade finansiella instrument och de tekniska instruktioner som Esma meddelar på sin webbplats.

⁽¹⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 596/2014 av den 16 april 2014 om marknadssmissbruk (marknadssmissbruksförordning) och om upphävande av Europaparlamentets och rådets direktiv 2003/6/EG och kommissionens direktiv 2003/124/EG, 2003/125/EG och 2004/72/EG (EUT L 173, 12.6.2014, s. 1).

2. Esma ska offentliggöra sådana tekniska instruktioner på sin webbplats senast den 1 juli 2016.
3. Den rapporterande enheten ska lagra de filer som skickats till och mottagits av webbplatsen för strukturerade finansiella instrument i elektroniskt format under minst fem år. På begäran ska dessa filer göras tillgängliga av den rapporterande enheten eller emittenten, originatorn eller det medverkande institutet till behöriga sektorsmyndigheter enligt definitionen i artikel 3.1 r i förordning (EG) nr 1060/2009.
4. Om den rapporterande enheten eller emittenten, originatorn eller det medverkande institutet identifierar sakfel i de uppgifter som har tillhandahållits webbplatsen för strukturerade finansiella instrument, ska de utan otillbörligt dröjsmål korrigera uppgifterna i fråga.

Artikel 7

Rapportering mellan dagen för ikraftträdande och tillämpningsdagen

1. Med hänsyn till de strukturerade finansiella instrument som emitterats i tidsperioden mellan dagen för ikraftträdande och dagen för tillämpning av denna förordning, ska emittenten, originatorn och det medverkande institutet uppfylla de krav som fastställts i denna förordning enbart i förhållande till de strukturerade finansiella instrument som fortfarande är utestående vid tillämpningsdagen för denna förordning.
2. Emittenten, originatorn och det medverkande institutet ska inte vara skyldiga att hålla en kopia av den information som krävs för denna förordning mellan dagen för ikraftträdande och dagen för tillämpning av denna förordning.

Artikel 8

Ikraftträdande

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Den ska tillämpas från och med den 1 januari 2017.

Artikel 6.2 ska emellertid gälla från och med den dag då denna förordning träder i kraft.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater.

Utfärdad i Bryssel den 30 september 2014.

På kommissionens vägnar

José Manuel BARROSO

Ordförande

BILAGA I

Rapporteringsmall för strukturerade finansiella instrument med privata hypotekslån som säkerhet

TILLGÅNGAR:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Poolens brytdatum	Dynamisk	Datum	Brytdatum för poolen eller portföljen. Alla datum har formatet ÅÅÅÅ-MM-DD.
Kod för pool	Statisk	Text/numerisk	Kod för pool eller portfölj/transaktionsnamn.
Lånekod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod (ID) för varje lån. Låne-ID bör inte ändras under transaktionens löptid.
Originator	Statisk	Text	Långivare som förskottrade det ursprungliga lånet.
Serviceföretagets kod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod per serviceföretag för att flagga vilken enhet som finansierar lånet.
Låntagarkod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod (ID) per låntagare (det riktiga namnet visas inte) – för att göra det möjligt att identifiera låntagare med flera lån i poolen (t.ex. visas ytterligare förskott/sekundära panträtter som separata poster). Bör inte förändras under transaktionens löptid.
Fastighetskod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod per fastighet för att göra det möjligt att identifiera fastigheter med flera lån i poolen (t.ex. visas ytterligare förskott/sekundära panträtter som separata poster).

Information om låntagaren

Låntagarens sysselsättningsstatus	Statisk	Lista	Sysselsättningsstatus för den primära sökanden.
Primära inkomster	Statisk	Numerisk	Låntagarens primära årliga bruttoinkomst (exklusive hyror).
Inkomstverifiering för primära inkomster	Statisk	Lista	Inkomstverifiering för primära inkomster.

Lånets egenskaper

Lånets ursprungsdatum	Statisk	Datum/numerisk	Datum för förskott på ursprungligt lån.
Datum för lånets löptid	Dynamisk	Datum/numerisk	Datum för lånets löptid.
Ändamål	Statisk	Lista	Lånets ändamål.
Lånets löptid	Statisk	Numerisk	Ursprungliga avtalsvillkor (antal månader).
Lånevalutans beteckning	Statisk	Lista	Beteckning av lånevalutan.
Ursprungligt saldo	Statisk	Numerisk	Ursprungligt lånesaldo (inklusive avgifter).

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Aktuellt saldo	Dynamisk	Numerisk	Antalet utestående lån vid poolens brytdatum. Detta bör inbegripa alla belopp med hypotekslån som säkerhet och kommer att klassas som kapitalbelopp i transaktionen.
Återbetalningsmetod	Statisk	Lista	Typ av återbetalning på kapitalbelopp.
Betalningsfrekvens	Statisk	Lista	Frekvensen av föreskrivna betalningar, dvs. antalet månader mellan betalningarna.
Föreskriven betalning	Dynamisk	Numerisk	Periodisk avtalsenlig betalning (betalning som ska ske om inga andra betalningssätt har fastställts).
Betalningstyp	Statisk	Lista	Typ av betalning på kapitalbelopp.

Räntesats

Typ av räntesats	Statisk	Lista	Typ av räntesats.
Aktuellt räntesatsindex	Dynamisk	Lista	Aktuellt räntesatsindex (den referensräntesats gentemot vilken hypotekslånets räntesats bestäms).
Aktuell räntesats	Dynamisk	Numerisk	Aktuell räntesats (%).
Aktuell räntesatsmarginal	Dynamisk	Numerisk	Aktuell räntesatsmarginal (för lån med bunden ränta är detta det samma som den aktuella räntesatsen, medan för lån med rörlig ränta är detta marginalen över [eller under vid negativ indata] indexräntan).
Återställningsintervall för räntesats	Dynamisk	Numerisk	Intervallet i månader där räntesatsen justeras (för lån med rörlig ränta).
Revidering, marginal 1	Dynamisk	Numerisk	Marginalen (%) för lånet vid det första revideringsdatumet.
Ränta, revideringsdatum 1	Dynamisk	Datum/numerisk	Datum för påföljande ändring av räntesats (t.ex. ändringar av diskontomarginal, fasta periodavslut, lån med återställning av fast ränta; detta är inte nästa återställningsdatum för Libor).
Revidering, marginal 2	Dynamisk	Numerisk	Marginalen (%) för lånet vid det andra revideringsdatumet.
Ränta, revideringsdatum 2	Dynamisk	Datum/numerisk	Datum för andra ränteändring.
Revidering, marginal 3	Dynamisk	Numerisk	Marginalen (%) för lånet vid det tredje revideringsdatumet.
Ränta, revideringsdatum 3	Dynamisk	Datum/numerisk	Datum för tredje ränteändring.
Reviderat räntesatsindex	Dynamisk	Lista	Nästa räntesatsindex.

Fastighetsinteckning och tilläggssäkerhet

Fastighetens postnummer	Statisk	Text/numerisk	Åtminstone de första två eller tre tecknen måste uppges.
Fastighetstyp	Statisk	Lista	Fastighetstyp.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Ursprunglig belåning	Statisk	Numerisk	Originatorns ursprungliga tecknade belåningsgrad (LTV). För lån mot sekundär panträtt bör detta vara den kombinerade eller totala belåningsgraden.
Värderingsbelopp	Statisk	Numerisk	Fastighetsvärde vid tidpunkten för det senaste låneförskottet före en värdepapperisering. Värderingsbelopp bör vara i samma valuta som lånet.
Ursprunglig värderingstyp	Statisk	Lista	Värderingstyp vid originering.
Värderingsdatum	Statisk	Datum/numerisk	Datum för senaste fastighetsvärdering vid tidpunkten för det senaste låneförskottet före en värdepapperisering.
Aktuell belåning	Dynamisk	Numerisk	Originatorns nuvarande belåningsgrad (LTV). För lån mot sekundär panträtt bör detta vara den kombinerade eller totala belåningsgraden.
Aktuellt värderingsbelopp	Dynamisk	Numerisk	Senaste värderingsbeloppet (om det t.ex. vid återtagande fanns flera värderingar, bör detta återspegla det lägsta). Värderingsbelopp bör vara i samma valuta som lånet.
Aktuell värderingstyp	Dynamisk	Lista	Aktuell värderingstyp.
Aktuellt värderingsdatum	Dynamisk	Datum/numerisk	Datum för den senaste värderingen.

Resultatinformation

Kontostatus	Dynamisk	Lista	Aktuell status för kontot.
Saldo för skuld som förfallit	Dynamisk	Numerisk	Aktuellt saldo för skuld som förfallit. Skuld som förfallit defieras som: det totala antalet föreskrivna betalningar till dagens datum MINUS det totala antalet mottagna betalningar till dagens datum MINUS alla kapitaliserade belopp. Detta bör inte inbegripa eventuella avgifter som tillämpas på kontot.
Antalet månaders dröjsmål	Dynamisk	Numerisk	Antalet månaders dröjsmål med lånet (vid poolens brytdatum) enligt emittentens definition.
Resterande skuld för 1 månad sedan	Dynamisk	Numerisk	Skuldsaldo (definierat enligt <i>skuldsaldo</i>) för den föregående månaden.
Resterande skuld för 2 månader sedan	Dynamisk	Numerisk	Skuldsaldo (definierat enligt <i>skuldsaldo</i>) för två månader sedan.
Rättstvist	Dynamisk	Y/N	Flagga som anger pågående rättstvisteförfaranden.
Inlösningsdatum	Dynamisk	Datum/numerisk	Datum när kontot inlöstes.
Fallisemang eller utestängande	Dynamisk	Numerisk	Totalt obetalt belopp före tillämpning av försäljningsintäkter och återvinningar.
Datum för fallisemang eller utestängande	Dynamisk	Numerisk	Datum för fallisemang eller utestängande.
Försäljningspris, lägre gräns	Dynamisk	Numerisk	Pris på försäljning av egendom vid tvångsförsäljning, avrundas till närmaste 10 000.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Förlust på försäljning	Dynamisk	Numerisk	Totalt nettounderskott exklusive avgifter, upplupna räntor etc. efter tillämpning av försäljningsinkomster (exklusive avgift för förtida betalning om underställt återvinningar på kapitalbeloppet).
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	Numerisk	Kumulativa återvinningar – endast relevant för fall med underskott.

INFORMATION OM OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Fält för säkerhet eller uppgifter om obligationernas nivå			
Rapportdatum	Dynamisk	Datum	Det datum då transaktionsrapporten utfärdades. Alla datum har formatet ÅÅÅÅ-MM-DD.
Utfärdare	Statisk	Text	Namnet på emittenten och emissionsserien, om tillämpligt.
Dragningar under likviditetsfacilitet	Dynamisk	Y/N	Bekräfta huruvida det gjorts en dragning i likviditetsfaciliteten under perioden fram till datumet för den sista räntebetalningen.

Fält för uppgifter om säkerhetsnivå

Utlösning av mätningar/nyckeltal	Dynamisk	Y/N	Status för olika typer av kriminellt beteende, utspädning, försummelser, förlust och liknande säkerhetsmätningar och nyckeltal i förhållande till deras förtida amortering eller andra utlösande händelsenivåer, vid aktuellt fastställt datum. Har en utlösande händelse inträffat?
Genomsnittskurs för konstant förskottsbetalning	Dynamisk	Numerisk	Rapporten ska innehålla den genomsnittliga konstanta förskottsbetalningskursens (CPR) takt för de underliggande hypotekslånen. I vissa jurisdiktioner kan hypotekspoolen även omfatta kommersiella lån. Genomsnittskursen för den konstanta förskottsbetalningstakten är beloppet uttryckt som en förskottsbetalning av kapitalbeloppet på en årlig basis som överstiger de planerade återbetalningarna. Genomsnittskursen för den konstanta förskottsbetalningstakten beräknas genom att först dela det aktuella bostadslånets kapitalbalans (dvs. det faktiska saldot) med det planerade bostadslånets kapitalbalans förutsatt att inga förskottsbetalningar har gjorts (dvs. att endast de planerade återbetalningarna har gjorts). Denna kvot höjs sedan till en nivå där exponenten är kvantiteten tolv delat med antalet månader sedan utfärdandet. Subtrahera detta resultat från ett och multiplicera det sedan med hundra (100) för att bestämma den genomsnittliga konstanta förskottsbetalningskursens takt. Denna beräkning uttrycks enligt följande: $\text{Genomsnitt CPR} = 100 \left(1 - \left(\left(\frac{\text{Det aktuella planerade bostadslånets kapitalbalans}}{\text{det planerade bostadslånets kapitalbalans}} \right)^{\frac{12}{\text{Månader sedan utfärdandet}}} \right) \right)$

Transaktionsrapportens kontaktinformation

Referenskontakt	Statisk	Text	Namnet på avdelningen eller informationskällornas referensperson(er).
Kontaktinformation	Statisk	Text	Telefonnummer och e-postadress.

OBLIGATIONSINFORMATION EFTER TRANCH:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Fält för tranchnivå			
Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) ges till en tranch av RMBS som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, dvs. serie 1, klass A1 etc.
ID-nummer för internationella värdepapper	Statisk	Text/numerisk	Den internationella säkerhetskoden eller -koderna, eller vid avsaknad av Isin, i sådant fall alla andra unika koder för värdepapper såsom en Cusipkod, som har tilldelats till denna tranch genom en börs eller annan enhet. Om mer än en kod förekommer, avgränsa med komma.
Datum för betalning av ränta	Dynamisk	Datum	Det periodiska datumet vid vilket en betalning av ränta till innehavare av en specifik del av strukturerade finansiella instrument med hypotekslån som säkerhet är planerad att ske.
Datum för betalning på kapitalbeloppet	Dynamisk	Datum	Det periodiska datumet vid vilket en betalning av kapitalbelopp till innehavare av en specifik del av strukturerade finansiella instrument med hypotekslån som säkerhet är planerad att ske.
Valuta	Statisk	Text	De kursvärden enligt vilka saldon efter säkerhetsnivå och betalningar rapporteras.
Referensränta	Statisk	Lista	Ränteindexet för basreferens enligt vad som avses i emissionsdokumentet (t.ex. tre månaders Euribor) gäller för en specifik del av strukturerade finansiella instrument med hypotekslån som säkerhet.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	Datum	Det datum då obligationerna emitterades.

BILAGA II

Uppgifter om lånenivå – Rapporteringsmall för strukturerade finansiella instrument med kommersiella hypotekslån som säkerhet

LÅN:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Lånekoder			
Kod för transaktionspool	Statisk	Text/numerisk	Transaktionens eller affärens unika beteckning
Poolens brytdatum	Dynamisk	Datum	Aktuellt brytdatum för poolen eller portföljen.
Värdepapperiseringsdatum	Statisk	Datum	Datum för utfärdande av affären – datum för första obligationsnotering
Ursprungliga lånevillkor			
Gruppkod	Statisk	Text/numerisk	Den alfanumeriska kod som tilldelats varje lånegrupp i ett utfärdande.
Kod för lånets serviceföretaget	Statisk	Text/numerisk	Unik kodsträng för lånets serviceföretag som tilldelas lånet.
Emissionscirkulärets lånekod	Statisk	Text/numerisk	Emissionscirkulärets eller -prospektets unika nummer, eller namn på lånetransaktionen som tilldelats lånet inom transaktionen eller poolen.
Lånesponsor	Statisk	Text/numerisk	Lånesponsor.
Lånets ursprungsdatum	Statisk	Datum	Datum för förskott på ursprungligt lån.
Lånevaluta	Statisk	Lista	Beteckning av lånevalutan.
Hela lånebalansen vid ursprungsdatumet	Statisk	Numerisk	Hela lånebalansen vid origineringen utgör en 100 % fullständig facilitet, dvs. värdepapperiserade och icke värdepapperiserade/ägda och icke ägda belopp (i lånevaluta).
Ursprunglig löptid för lån	Statisk	Numerisk	Avtalsvillkor (i månader) vid origineringsdatumet.
Startdatum för amortering	Statisk	Datum	Det datum som amorteringen kommer att inledas på hela lånet (detta kan vara ett datum som ligger före värdepapperiseringsdatumet).
Kod för räntesatsindex	Statisk	Lista	Aktuellt räntesatsindex (den referensräntesats gentemot vilken hypotekslånets räntesats bestäms).
Ursprunglig lånräntesats	Statisk	Numerisk	Lånets totala räntesats vid dess ursprungsdatum. Vid flera delar med olika räntesatser, ska en viktad genomsnittsräntesats tillämpas.
Förfalldatum för första räntebetalning	Statisk	Datum	Det datum när den första räntebetalningen löpte ut på lånet efter ursprungsdatumet.
Låneland	Statisk	Lista	Låneland.
Lånets ändamål	Statisk	Lista	Lånets ändamål.
Hypotekslån som säkerhet	Statisk	Y/N	Har fastigheten intecknas som säkerhet för lånet?

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Lånestatistik vid värdepapperiseringsdatumet			
Skuldbetalningens räntetäckningsgrad för lånet (hela) vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Skuldbetalningens räntetäckningsgrad för lånet (hela) vid värdepapperiseringsdatumet.
Belåningsgraden för lånet (hela) vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Belåningsgraden för lånet (hela) vid värdepapperiseringsdatumet.
Räntetäckningsgrad (A-lån) vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Vid beräkning av värdepapperiseringens räntetäckningsgrad för A-lånet baserat på emissionsdokumentationen.
Skuldbetalningens räntetäckningsgrad (A-lån) vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Vid beräkning av skuldbetalningens räntetäckningsgrad för A-lånet för värdepapperiseringen baserad på emissionsdokumentationen.
Belåningsgrad (A-lån) vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Vid beräkning av värdepapperiseringens räntetäckningsgrad (LTV) för A-lånet baserat på emissionsdokumentationen.
Kapitalbalans vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Hela lånets balans, inbegripet eventuella outnyttjade belopp, vid värdepapperiseringsdatumet.
Faktisk kapitalbalans vid värdepapperiseringsdatumet (hela lånet)	Statisk	Numerisk	Faktisk kapitalbalans för hela lånet vid värdepapperiseringsdatumet enligt vad som avses i emissionscirkuläret.
Periodisk betalning av kapitalbelopp och ränta vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Planerade belopp (kapitalbelopp och ränta) som förfaller vid nästa betalningsdatum för lånet liksom vid värdepapperiseringsdatumet.
Låneränta vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Den totala räntesatsen (t.ex. Libor + marginal) som används för att beräkna räntan som ska betalas på lånet vid värdepapperiseringsdatumet.
Förmånsrättslig ställning för kostnad vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Lista	Är den säkerhet som ställts för värdepapperiseringen en säkerhet av prioriterad ställning?
Återstående löptid vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Återstående antal månader (exklusive eventuella förlängningsalternativ) tills lånet löper ut vid värdepapperiseringsdatumet.
Återstående amorteringstid vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Antalet månader som återstår tills lånets amorteringstid löper ut. Om amortering inte har påbörjats vid värdepapperiseringsdatumet blir detta mindre än den återstående tiden vid värdepapperiseringsdatumet.
Lånets förfallodag vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Datum	Förfallodagen för lånet enligt låneavtalet. Detta skulle inte beakta en eventuell utökad förfallotid som kan tillåtas enligt låneavtalet, utan den ursprungliga förfallodagen.
Faktisk kapitalbalans vid värdepapperiseringsdatumet (A-lån)	Statisk	Numerisk	Faktisk kapitalbalans för A-lån vid värdepapperiseringsdatumet enligt vad som avses i emissionscirkuläret.
Möjlighet att förlänga	Dynamisk	Y/N	Ange om det finns en möjlighet att förlänga lånet och driva fram förfallodagen.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Kortaste förlängningsperiod som är möjlig	Statisk	Numerisk	Tid i månader för det kortaste förlängningsalternativet som finns tillgängligt för lånet.
Typ av förlängningsalternativ	Statisk	Lista	Typ av förlängningsalternativ.

Närmare uppgifter om säkerheter

Antal fastigheter vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Antal fastigheter som fungerar som säkerhet för lånet vid värdepapperiseringsdatumet.
Antal fastigheter vid poolens brytdatum	Dynamisk	Numerisk	Antal fastigheter som fungerar som säkerhet för lånet vid poolens brytdatum.
Fastigheter som ställts som säkerhet för lånet vid värdepapperiseringen	Statisk	Text/numerisk	Ange de unika fastighetskoderna (PC1) för fastigheter som fungerade som säkerhet för lånet vid värdepapperiseringsdatumet.
Fastigheter som ställts som säkerhet för lånet vid poolens brytdatum	Dynamisk	Text/numerisk	Ange de unika fastighetskoderna (PC1) för fastigheter som fungerade som säkerhet för lånet vid poolens brytdatum.

Detaljer om låneavtal

Metod för räntetäckningsgrad (hela lån)	Statisk	Lista	Definiera beräkningen av räntetäckningsgradens finansiella avtalskrav på hela lånenivån, den metod som föreligger för beräkning.
Metod för skuldbetalningens räntetäckningsgrad (hela lån)	Statisk	Lista	Definiera beräkningen av de finansiella avtalskraven på hela lånenivån för skuldbetalningens räntetäckningsgrad, den metod som föreligger för beräkning.
Metoden för belåningsgrad (hela)	Statisk	Lista	Definiera beräkningen av belåningsgradens finansiella avtalskrav på hela lånenivån, den metod som föreligger för beräkning.
Övriga finansiella avtalskoder (hela)	Statisk	Lista	Om det krävs en annan kod för räntetäckningsgraden eller de finansiella avtalskraven på hela lånenivån för skuldbetalningens räntetäckningsgrad.
Metod för räntetäckningsgrad (A-lån)	Statisk	Lista	Definiera metod för beräkning av A-lånets räntetäckningsgrad.
Metod för beräkning av skuldbetalningens räntetäckningsgrad (A-lån)	Statisk	Lista	Definiera metod för beräkning av A-lånets räntetäckningsgrad för skuldbetalning.
Metod för beräkning av belåningsgrad (A-lån)	Statisk	Lista	Definiera metod för beräkning av A-lånets belåningsgrad.

Underliggande fastighetsstatistik vid värdepapperiseringsdatumet

Intäkter vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	De totala garanterade inkomsterna från alla källor för en fastighet som beskrivs i emissionscirkuläret. Vid flera fastigheter ska fastigheternas värden summeras.
Rörelsekostnader vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	De totala garanterade driftskostnaderna för fastigheterna som beskrivs i emissionscirkuläret. Dessa kan inbegripa fastighetsskatt, försäkringar, skötsel, allmänna nyttigheter, underhåll och reparationer och direkta fastighetskostnader till hyresvärden; anläggningskostnader och leasingavgifter är undantagna.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Nettorörelseintäkter vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Intäkter minus rörelsekostnader vid värdepapperiseringsdatumet (fältet "Intäkter vid värdepapperiseringsdatumet" minus "Rörelsekostnader vid värdepapperiseringsdatumet"). Vid flera fastigheter ska värdena summeras.
Kapitalkostnader vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Capex vid värdepapperiseringsdatumet (i motsats till reparationer och underhåll) om fastställt i emissionscirkuläret.
Nettokassaflöde vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Nettorörelseintäkter minus Capex vid värdepapperiseringsdatumet (fältet "Nettorörelseintäkter vid värdepapperiseringsdatumet" minus "Anläggningskostnader vid värdepapperiseringsdatumet").
Valuta i den finansiella rapporteringen vid värdepapperisering	Statisk	Lista	Den valuta som används i den inledande finansiella rapporteringen i fälten "Intäkter vid värdepapperiseringsdatumet" minus "NCF vid värdepapperiseringsdatumet".
ICR-/DSCR-indikator vid värdepapperiseringsdatum	Statisk	Lista	Hur skuldbetalningens räntetäckningsgrad beräknas/tillämpas när ett lån avser flera fastigheter.
Fastigheternas portföljvärde vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Värdering av fastigheterna som ställts som säkerhet för lånet vid värdepapperiseringsdatumet enligt vad som beskrivs i emissionscirkuläret. Vid flera olika fastigheter ska fastigheternas värde summeras, annars ND.
Fastigheternas portföljvaluta vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Lista	Värderingsvalutan i "Fastigheternas portföljvärde vid värdepapperiseringsdatumet".
Värderingsdag vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Datum	Det datum som värderingen utarbetades för de värden som redovisas i emissionscirkuläret. Vid flera olika datum, för flera fastigheter, ska det senaste datumet väljas.
Ekonomisk uthyrningsgrad vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Andelen uthyrningsbart utrymme med under-tecknat hyresavtal i laga kraft vid värdepapperiseringsdatumet redovisas i emissionscirkuläret (hyresgäster kanske inte upptar utrymmet, men betalar hyra). Vid flera olika fastigheter ska ett viktat medelvärde användas genom beräkningen {nuvarande tilldelad % (fastighet) × (uthyrningsgrad)} för varje fastighet.
Belopp som innehas i deposition vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Det totala saldot för de lagenligt belastade reservkontona på lånenivå vid värdepapperiseringsdatumet.
Insamling av deposition	Statisk	Y/N	Ange Y om eventuella betalningar hålls på reservkonton för att täcka endast markleasingavgifter, försäkringar eller skatter (inte underhåll, förbättringar, capex etc.) som krävs enligt låneavtalet, om detta inte görs, ange N.
Insamling av övriga reserver	Statisk	Y/N	Hålls några övriga belopp annat än skatter för markhyra eller försäkringar på reservkonton som erfordras enligt villkoren i låneavtalet för hyresgästens förbättringar, leasingavgifter och liknande poster för den relaterade egendomen eller i syfte att tillhandahålla ytterligare säkerhet för sådana lån?

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Deposition hålls vid utlösande händelse	Statisk	Y/N	Krävs det enligt låneavtalet att reservbelopp betalas ut vid förekomst av eventuella utlösande händelser?
Utlösande faktor för att hålla inne deposition	Statisk	Lista	Typ av utlösande händelse.
Kalkylerade depositionsbelopp/reserver	Statisk	Numerisk	Kalkylerade depositionsbelopp/reserver.
Depositionsbeloppets frisläppningsvillkor	Statisk	Text	Frisläppningsvillkor för depositionsbeloppet.
Villkor för uttag från kontantreserv	Statisk	Lista	När kontantreserven kan användas.
Depositionsvaluta	Statisk	Lista	Valuta för depositionsbetalningar. Fälten "Belopp som hålls inne som deposition vid värdepapperiseringsdatumet" och "Kalkylerade depositionsbelopp/reserver".

Information om långruppering och substitutioner

Säkerhet som ställts för flera lån	Statisk	Y/N	Ange om detta är en säkerhet som ställts för mer än ett lån (exempel: lån 1 och 44 har samma säkerhet som lån 4 och 47).
Nytt lån	Dynamisk	Y/N	Är detta lån ett substitut för ett lån på ett datum som ligger efter värdepapperiseringsdatumet?
Datum för substitution	Dynamisk	Datum	Om lånet ersattes efter värdepapperiseringsdatumet, datumet för denna ersättning.
Respittdagar tillåts	Statisk	Numerisk	Antalet dagar efter en förfallen betalning under vilka långivaren inte kommer att ta ut dröjsmålsränta eller rapportera betalningen som sen.
Indikator för tilläggsfinansiering	Statisk	Lista	Har hela lånet haft tilläggsfinansiering/blandad skuld?

Information om lånets räntesats (vid värdepapperiseringsdatumet)

Typ av räntesats	Statisk	Lista	Typ av räntesats som tillämpas på lånet.
Kod för periodiserad ränta	Statisk	Lista	Bruket av "dagar" används för att beräkna ränta.
Dröjsmålsränta	Statisk	Y/N	Betalas den ränta som ackumuleras på lånet i efterhand?
A-lånets amorteringstyp (om tillämpligt)	Statisk	Lista	Amorteringstyp för A-lån.

Information om amortering av helt lån (vid värdepapperiseringsdatum)

Amorteringstyp för helt lån (om tillämpligt)	Statisk	Lista	Amorteringstyp för helt lån.
Ränta får läggas till kapitalet	Statisk	Y/N	Tillåter lånedokumentet att ränta läggs till och kapitaliseras?

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Slutdatum för lockout av förtida inlösen av lånet	Statisk	Datum	Datum efter vilket långivaren tillåter förtida inlösen av lånet.
Slutdatum för ränteskillnadsersättning	Statisk	Datum	Datum efter vilket långivaren tillåter förtida inlösen av lånet utan krav på en avgift för förtida inlösen eller inbetalning av ränteskillnadsersättning. Det datum efter vilket lånet kan lösas in i förtid utan ränteskillnadsersättning.
Slutdatum för ersättning vid förtida inlösen	Statisk	Datum	Datum efter vilket långivaren tillåter låntagaren att lösa lånet i förtid utan krav på en avgift för förtida inlösen.
Beskrivning av villkor för att lösa lån i förtid	Statisk	Text/numerisk	Bör återspegla informationen i emissionscirkuläret. Om villkoren för en förtida inlösen, till exempel, är en avgift på 1 % under lånets första år, 0,5 % under det andra året och 0,25 % under det tredje året kan detta anges i emissionscirkuläret som: 1 % (12), 0,5 % (24), 0,25 % (36).
Utgör uteblivna betalningar på tidigare anspråk på företrädesordning ett fallisemang av lånet?	Statisk	Y/N	Utgör uteblivna betalningar på tidigare anspråk på företrädesordning ett fallisemang av lånet?
Utgör uteblivna betalningar på lån med lika företrädesordning ett fallisemang av egendom?	Statisk	Y/N	Utgör uteblivna betalningar på lån med lika företrädesordning ett fallisemang av egendom?

Information om kurssäkring för lånet (vid värdepapperiseringsdatumet)

Övre gräns för livränta	Statisk	Numerisk	Högsta ränta som låntagaren måste betala på ett lån med rörlig ränta som krävs enligt villkoren i låneavtalet.
Lägre gräns för livränta	Statisk	Numerisk	Lägsta ränta som låntagaren måste betala på ett lån med rörlig ränta som krävs enligt villkoren i låneavtalet.
Typ av swap av lånenivå	Statisk	Lista	Beskriv vilken typ av swap av lånenivå som tillämpas.
Bank som tecknar swapavtal för lån	Dynamisk	Text	Namn på banken som tillhandahåller swapavtal.
Typ av räntekurs vid swap av lånenivå	Statisk	Lista	Beskriv vilken typ av ränteswap som gäller för lånet.
Typ av valutaswap på lånet	Statisk	Lista	Beskriv typen av valutaswap.
Växelkurs vid swap av lånenivå	Statisk	Numerisk	Den valutakurs som fastställts för en valutaswap.
Startdatum för swap av lånenivå	Statisk	Datum	Startdatum för swap av lånenivå.
Slutdatum för swap av lånenivå	Statisk	Datum	Slutdatum för swap av lånenivå.
Låntagarens skyldighet att betala ränteskillnadsersättning vid swap av lånenivå	Statisk	Lista	När låntagaren är skyldig att betala ränteskillnadsersättning till serviceföretaget som tillhandahåller en låneswap.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
----------	------------------	---------	-----------------------------------

Uppgifter om justering av låneränta (vid värdepapperiseringsdatumet)

Betalningsfrekvens	Statisk	Lista	Frekvensen av inbetalning av ränta och amorteringar på lån enligt de ursprungliga lånedokumenten.
Räntans återställningsfrekvens	Statisk	Lista	Frekvensen med vilken räntesatsen återställs enligt de ursprungliga lånedokumenten.
Återställningsfrekvens för betalningar	Statisk	Lista	Frekvensen enligt vilken räntesatsen återställs i linje med de ursprungliga lånedokumenten.
Indexhistorik i dagar	Statisk	Numerisk	Antalet dagar före räntebetalningsdatumet som räntesatsen fastställs (t.ex. Euribor fastställs två dagar före räntebetalningsdatumet).
Indexbestämningsdatum	Statisk	Datum	Om låneavtalet avser specifika datum för fastställande av index, ska påföljande datum för fastställande av index anges.

Information om lånesyndikering och deltagande

Lånestruktur	Statisk	Lista	Använd lånestrukturkoden för att beskriva vilken struktur som gäller för detta lån, t.ex. hela lånet, A/B-delningar, syndikerade.
Syndikerat lån	Statisk	Y/N	Ingår lånet i ett syndikerat lån?
Andel av total lånefacilitet som värdepapperiseras	Statisk	Numerisk	Andel av det totala lånet i värdepapperisering vid värdepapperiseringsdatumet.
Rättigheter att kontrollera part för materiella beslut	Statisk	Y/N	Har ägaren av något annat deltagande än emitenten rätt att fatta större beslut?
Syndikeringens korrespondentbank	Statisk	Text	Korrespondentbank.

Diverse lånedetaljer

Åtgärder vid brott mot finansiella avtalsbestämmelser	Statisk	Lista	Åtgärder vid brott mot finansiella avtalsbestämmelser.
Låneoriginator	Statisk	Text	Namn på originatorn/långivaren som sålde lånet till emittenten. Namnet på enheten som har det slutgiltiga ansvaret för lånets fullmakter och garantiförbindelser.
Påföljder vid inlämnande av finansiell information	Statisk	Lista	Indikator för påföljder vid låntagarens underlåtenhet att lämna in erfordrad finansiell information (rörelserapport, tidsplan etc.) enligt lånedokumentationen.
Låneregress	Statisk	Y/N	Finns det möjlighet till återkrav från en annan part (t.ex. borgensman) i händelse att låntagaren försummar en skyldighet enligt låneavtalet?
Avrundningskod	Statisk	Lista	Metod för avrundning av räntesatsen.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Avrundning i stigande led	Statisk	Numerisk	Den inkrementella procentandel som ett index bör avrundas till vid fastställandet av räntan som anges i låneavtalet.
Namn på särskilt serviceföretag vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Text	Namn på särskilt serviceföretag vid värdepapperiseringsdatumet.
Administrationsstandard	Statisk	Lista	Administrationsstandard (val). Administrerar lånets serviceföretag hela lånet (både A- och B-delarna) eller endast A- eller B-delen?

Information om betalningsdatum

Datum för betalning av lån	Dynamisk	Datum	Det datum som kapitalbeloppet och räntan betalas till emittenten. Detta är normalt sett datumet för inbetalning av räntan på lånet.
Betalas till och med datum	Dynamisk	Datum	Det datum då alla betalningar har verkställts utan något bortfall. På ett lån där alla betalningsåtaganden fullgjorts blir detta lånets betalningsdatum omedelbart före det datum som angetts i fältet "Lånets betalningsdatum".
Återställningsdatum för indexränta	Dynamisk	Datum	Vid lån med justerbar ränta, är detta påföljande datum som räntesatsen ska ändras. För lån med fast ränta, ange nästa datum för räntebetalning.
Datum för justering av nästa betalningsdatum	Dynamisk	Datum	Vid lån med justerbar ränta, påföljande datum som det planerade kapitalbeloppet och/eller räntan ska ändras. För lån med fast ränta, ange nästa datum för betalning.
Lånets förfallodag	Dynamisk	Datum	Lånets aktuella förfallodag enligt låneavtalet. Detta skulle inte beakta en eventuell förlängd förfallotid som kan tillåtas enligt låneavtalet.
Datum för nästa betalning av lån	Dynamisk	Datum	Datum för nästa lånebetalning.

Räntedetaljer

Nuvarande indexränta (helt lån)	Dynamisk	Numerisk	Den indexräntesats som används för att bestämma den aktuella räntesatsen för hela lånet. Räntesatsen (före marginal) som används för att beräkna den ränta som betalas vid betalningsdatumet för (hela) lånet i fältet "Lånets betalningsdatum".
Nuvarande marginalränta (helt lån)	Dynamisk	Numerisk	Marginalen används för att bestämma den aktuella räntesatsen på hela lånet. Den marginal som används för att beräkna den ränta som betalas på (hela) lånet vid betalningsdatumet i fältet "Lånets betalningsdatum".
Nuvarande räntesats (helt lån)	Dynamisk	Numerisk	Den totala räntesats som används för att beräkna den ränta som betalas på (hela) lånet vid betalningsdatumet i fältet "Lånets betalningsdatum" (summan av fältet "Nuvarande indexränta (helt lån)" och "Nuvarande marginalränta (helt lån)" för lån med rörlig ränta).

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Nuvarande räntesats (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Bruttosats per år som används för att beräkna den aktuella periodens planerade ränta på lånets A-del.
Nästa indexränta (helt lån)	Dynamisk	Numerisk	Den påföljande periodens indexräntesats som används för att bestämma hela lånets aktuella räntesats. Räntesatsen (före marginal) som används för att beräkna den ränta som betalas baserat på lånets faktiska utgående balans (hela lån) i fältet "Lånets faktiska utgående balans (hela lån)".
Aktuell dröjsmålsränta (helt lån)	Dynamisk	Numerisk	Total ränta som används för att beräkna den dröjsmålsränta som betalas på lånet vid betalningsdatumet i fältet "Lånets betalningsdatum".

Information om kapitalbelopp

Balans vid den aktuella periodens början (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Utestående saldo vid den aktuella periodens början. Lånets utestående saldo i början av ränteperioden som används för att beräkna den ränta som ska betalas på lånet vid betalningsdatumet i fältet "Lånets betalningsdatum".
Planerat kapitalbelopp (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Planerad betalning för kapitalbelopp på lånet för den aktuella perioden. Betalningen för kapitalbelopp som ska betalas till emittenten på lånet vid betalningsdatumet i fältet "Lånets betalningsdatum", t.ex. amorteringar men inte förskottsbetalningar.
Planerad utgående balans för aktuell period (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Utestående planerad balans med avseende på kapitalbelopp i slutet av den aktuella perioden efter amorteringar, men före eventuella förskottsbetalningar. Lånets kapitalbalans som skulle vara utestående efter den planerade betalningen för kapitalbeloppet, men före eventuella förskottsbetalningar (fältet "Aktuell start av ingående balans (hela lån)" minus "Planerat kapitalbelopp (hela lån)").
Oplanerad inkassering av kapitalbelopp (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Oplanerade betalningar av kapitalbelopp som mottagits under den aktuella perioden. Övriga betalningar för kapitalbelopp som mottagits under ränteperioden som ska användas för avbetalning av lånet. Detta kan avse försäljningsintäkter, frivilliga förskottsbetalningar eller likvidationsbelopp.
Övriga justeringar av kapitalbelopp (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Justeringar av oplanerat kapitalbelopp för ränteperioden, som inte står i samband med förflyttningen av kontanta medel. Alla andra belopp som skulle kunna orsaka att lånets saldo sjunker eller ökar under den aktuella perioden, som inte beaktas som oplanerade inkasseringar av kapitalbelopp och som inte är planerade kapitalbelopp.
Faktiskt kapitalbelopp som har betalats	Dynamisk	Numerisk	Det faktiska kapitalbeloppet som har betalats från och med den senaste IPD.
Lånets faktiska utestående balans (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Utestående faktisk kapitalbalans i slutet av den aktuella perioden. Det faktiska saldot av det utestående lånet för den påföljande ränteperioden efter alla betalningar på kapitalbelopp.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Aktuell ingående balans (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Utestående balans (A-lån) vid den aktuella periodens början. A-lånets utestående balans i början av ränteperioden som används för att beräkna den ränta som ska betalas på lånet vid betalningsdatumet.
Totala inkasseringar för kapitalbeloppet (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Alla betalningar för kapitalbelopp (A-lån) som mottagits under den aktuella perioden. Betalningen för kapitalbelopp på A-lånet som ska betalas till emittenten vid betalningsdatumet i fältet "Lånets betalningsdatum", t.ex. amorteringar men inte förskottsbetalningar.
Lånets faktiska utestående balans (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Utestående faktisk kapitalbalans (A-lån) i slutet av den aktuella perioden. A-lånets kapitalbalans som skulle vara utestående efter den planerade betalningen för kapitalbeloppet.
Facilitetens outnyttjade lånebalans (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Det totala hela lånets (prioriterad skuld) återstående facilitet/outnyttjade balans i slutet av perioden. Det totala hela lånets (prioriterad skuld) återstående facilitet efter datumet för betalning av den ränta som låntagaren fortfarande kan utnyttja.

Ränteinformation

Förfallodag för planerat räntebelopp (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Bruttoränta för perioden förutsatt att ingen återbetalning skett under den aktuella perioden för hela lånet. Den totala räntan som föreligger till betalning vid lånets betalningsdatum, förutsatt att inga förskottsbetalningar görs under ränteperioden. Räntan bör vara baserad på den underliggande räntesatsen enligt låneavtalet.
Förskottsbetalningsräntans överskott/underskott	Dynamisk	Numerisk	Underskott eller överskott av faktisk räntebetalning från den planerade räntebetalningen för den aktuella perioden som inte avser en utebliven amortering av ett lån. Resultat från en förskottsbetalning som tas emot på ett annat datum än ett planerat förfalldatum för betalning.
Övrig räntejustering	Dynamisk	Numerisk	Följande fält för övriga justeringar av kapitalbelopp (fältet "Övriga justeringar av kapitalbelopp (hela lån)") för att visa oplanerade räntejusteringar för den avsedda inkasseringsperioden.
Negativ amortering	Dynamisk	Numerisk	Negativa amortering/uppskjuten ränta/kapitaliserad ränta utan påföljd.
Faktiskt betald ränta (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Faktiskt betald ränta för hela lånet under aktuell period. Totalt belopp för ränta som betalas av låntagaren under ränteperioden eller vid lånets betalningsdatum.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Faktiskt betald ränta (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Totalt belopp för ränta som betalas för A-lånet under ränteperioden eller vid lånets betalningsdatum.
Faktisk dröjsmålsränta	Dynamisk	Numerisk	Hela lånets faktiska dröjsmålsränta som betalas under den aktuella perioden. Totalt belopp för dröjsmålsränta som betalas av låntagaren under ränteperioden eller vid lånets betalningsdatum.
Uppskjuten ränta (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Uppskjuten ränta på hela lånet. Uppskjuten ränta är det belopp genom vilket den ränta som en låntagare är skyldig att betala på ett hypotekslån är lägre än det räntebelopp som läggs till den utestående kapitalbalansen.
Kapitaliserad ränta (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Kapitaliserad ränta på hela lånet. Kapitaliserade räntor är där räntan läggs till lånebalansen i slutet av ränteperioden i enlighet med låneavtalet.

Information om kapitalbelopp och räntor

Totalt planerat kapitalbelopp och ränta som föreligger till betalning (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Planerad betalning av kapitalbelopp och ränta på lånet för den aktuella perioden och för emittenten (hela lån). Betalning av det totalt planerade kapitalbeloppet och räntan som förfaller vid lånets betalningsdatum (summan av fälten "Planerat kapitalbelopp (hela lån)" och "Planerat räntebelopp (hela lån)") – kan användas för beräkningar av DSCR.
Totala bortfall i utestående kapitalbelopp och ränta (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Kumulativa utestående kapitalbelopp och ränta som föreligger till betalning på lånet i slutet av den aktuella perioden. Summan av alla obetalda kapitalbelopp och räntan vid lånets betalningsdatum.
Övriga totalt utestående belopp	Dynamisk	Numerisk	Sammanlagt utestående belopp på lånet (t.ex. försäkringspremie, tomtarrenden, kapitalutgifter) i slutet av den aktuella perioden som har utnyttjats av emittenten/serviceföretaget. Det sammanlagda beloppet för alla förskott för skydd av egendom eller andra belopp som har förskottats av serviceföretaget eller emittenten och ännu inte har ersatts av låntagaren.
Sammanlagt utestående belopp	Dynamisk	Numerisk	Summan av fältet "Totala bortfall i utestående kapitalbelopp och ränta (hela lån)" och "Övriga totalt utestående belopp".
Utlösande faktor för amortering har uppnåtts	Dynamisk	Y/N	Har den utlösande faktorn för amortering uppnåtts?
Aktuell amorteringstyp	Dynamisk	Lista	Typen av amortering som gäller för A-lånet.
Totalt planerat kapitalbelopp och ränta som föreligger till betalning (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Planerad betalning av kapitalbelopp och ränta på A-lånet för den aktuella perioden och för emittenten.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Senaste finansiell information år till datum			
Låntagarens rapporteringsbrott	Dynamisk	Y/N	Har låntagaren brutit mot sin skyldighet att lämna in rapporter till lånets serviceföretag eller långivaren?
Senaste intäkter	Dynamisk	Numerisk	De totala intäkterna för den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet (dvs. år till datum eller avslutande 12 månader) för alla fastigheterna.
Senaste belåningsgrad (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Senaste belåningsgrad (LTV) för (hela) lånet baserat på lånedokumentationen.
Senaste skuldbetalningens räntetäckningsgrad (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Senaste skuldbetalningens räntetäckningsgrad (DSCR) för (hela) lånet baserat på lånedokumentationen.
Senaste räntetäckningsgrad (hela lån)	Dynamisk	Numerisk	Senaste räntetäckningsgrad (ICR) för (hela) lånet baserat på lånedokumentationen.
Senaste räntetäckningsgrad (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Senaste beräkning av räntetäckningsgrad för A-lånet baserat på emissionsdokumentationen.
Senaste skuldbetalningens räntetäckningsgrad (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Senaste beräkning av skuldbetalningens räntetäckningsgrad för A-lånet baserat på emissionsdokumentationen.
Senaste belåningsgrad (A-lån)	Dynamisk	Numerisk	Senaste beräkning av belåningsgrad (LTV) för A-lånet baserat på emissionsdokumentationen.
Uppgifter om reserver och depositionsbelopp			
Total reservbalans	Dynamisk	Numerisk	Det totala saldoto för reservkontona på lånenivå vid värdepapperiseringsdatumet. Omfattar underhåll, reparationer och miljöskydd etc. (utesluter reserver för skatter och försäkringskostnaden, medan reserver som avser leasingavgifter ingår). Ska fyllas i om fältet "Inkassering av övriga reserver" i låneavtalet är "J" = Ja.
Depositionsbeloppets utlösande händelse har uppstått	Dynamisk	Y/N	Ange Y om en händelse har inträffat som har resulterat i att reservbelopp har upprättats. Ange N om betalningar byggs upp som ett normalt villkor av låneavtalet.
Belopp som läggs till depositionsbelopp i den aktuella perioden	Dynamisk	Numerisk	Beloppet som har lagts till ett eventuellt depositionsbelopp eller reserver under den aktuella perioden.
Valuta för reservbalans	Dynamisk	Lista	Beteckning av reservkontots valuta.
Depositionsvaluta	Statisk	Lista	Beteckning av depositionskontots valuta.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
----------	------------------	---------	-----------------------------------

Uppgifter om likvidation och förskottsbetalning

Datum för likvidation och förskottsbetalning	Dynamisk	Datum	Det datum vid vilket ett oplanerat kapitalbelopp eller intäkter från likvidation tas emot.
Kod för likvidation och förskottsbetalning	Dynamisk	Lista	Kod som tilldelats betalningar av eventuella oplanerade kapitalbelopp eller intäkter från likvidation som tagits emot under inkasseringsperioden.

Uppgifter om låntagarens riskgarderingsnivå

Namn på banken som tillhandahåller låneswappar (låntagarnivå).	Dynamisk	Text	Namnet på banken som tillhandahåller swapavtal för lånet om låntagaren har ett direktavtal med swapavtalets motpart.
Faktiskt kreditbetyg för banken som tillhandahåller låneswappar (låntagarnivå).	Dynamisk	Text/numerisk	Identifiera kreditbetyg för swapavtalets motpart vid lånets betalningsdatum.
Fullständig eller partiell händelse för upphörande av swap av lånenivå för den aktuella perioden (låntagarnivå)	Dynamisk	Lista	Om låneswappen har slutförts under den aktuella perioden, ska orsaken fastställas.
Periodisk nettobetalning som föreligger till banken som tillhandahåller låneswappen (låntagarnivå)	Dynamisk	Numerisk	Belopp som betalats av låntagaren till swapavtalets motpart vid lånets betalningsdatum enligt kraven i swapavtalet.
Periodisk nettobetalning som föreligger från banken som tillhandahåller låneswappen (låntagarnivå)	Dynamisk	Numerisk	Belopp som betalats av swapavtalets motpart till låntagaren vid lånets betalningsdatum enligt kraven i swapavtalet.
Ränteskillnadsersättning som utgår till banken som tillhandahåller låneswappen	Dynamisk	Numerisk	Alla belopp som föreligger till betalning från låntagaren till swapavtalets motpart för partiell eller fullständig uppsägning av swapavtalet.
Underskott i ränteskillnadsersättning som ska betalas vid swap av lånenivå	Dynamisk	Numerisk	Eventuella underskott, i förekommande fall, i ränteskillnadsersättning vilket är ett resultat av ett partiellt eller fullständigt upphörande av swapavtalet, som ska betalas av låntagaren.
Ränteskillnadsersättning som föreligger från låneswappens motpart	Dynamisk	Numerisk	Eventuella vinstbelopp som betalas av swapavtalets motpart till låntagaren vid partiellt eller fullständigt upphörande.
Nästa återställningsdatum för swap av lånenivå	Dynamisk	Datum	Nästa återställningsdatum för swap av lånenivå.
Swapuppgifter	Dynamisk	Text	Detaljerad information om swappen.

Detaljerad information om lånestatus som förfallit till betalning

Fastighetsstatus	Dynamisk	Lista	Fastighetsstatus.
Lånestatus	Dynamisk	Lista	Lånestatus (dvs. aktuell, utebliven betalning etc.). Om ett lån har flera statuskoder som har utlösts, åligger det serviceföretaget att efter eget godtycke bestämma vilken kod som ska rapporteras.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Verkställighet av startdatum	Dynamisk	Datum	Datum vid vilket utestängning eller administrativa förfaranden eller alternativa verkställighetsförfaranden inleddes mot eller godkändes av låntagaren.
Teststrategikod	Dynamisk	Lista	Teststrategikod.
Förväntad tidsåtgång för återvinning	Dynamisk	Numerisk	Förväntad tidsåtgång för återvinning (angivet i månader).
I insolvens	Dynamisk	Y/N	Insolvensstatus för lån (om i insolvens "J", annars "N").
Insolvensdatum	Dynamisk	Datum	Datum för insolvens.
Egendomens besittningsdatum	Dynamisk	Datum	Det datum vid vilket äganderätt till (eller en alternativ form av effektiv kontroll och förmåga att avyttra) fastigheten som ställts som säkerhet.
Nettobehållningen som mottagits vid likvidation	Dynamisk	Numerisk	Nettobehållningen som mottagits vid likvidation som används för att fastställa förlusten till emittenten enligt transaktionsdokumentationen. Nettobehållningen som mottagits från försäljningen kommer att fastställa huruvida det finns en förlust eller ett underskott på lånet.
Likvidationsomkostnader	Dynamisk	Numerisk	Omkostnader i samband med likvidation ska dras av från emittentens övriga tillgångar för att fastställa nettoförlusten enligt transaktionsdokumentationen. Beloppet för alla likvidationsomkostnader som ska betalas ut från nettoomsättningen för att fastställa om det blir någon förlust.
Realiserad förlust för värdepapperisering	Dynamisk	Numerisk	Utestående lånebalans (plus likvidationsomkostnader) minus nettoomsättningen från likvidation som mottagits. Beloppet för eventuell förlust till emittenten efter avdrag för likvidationsomkostnader från nettoomsättningen från försäljningen.
Antal månader i dröjsmål	Dynamisk	Numerisk	Antalet månader som förfallodagen för lånet överskridits i slutet av den aktuella perioden, enligt emittentens definition.
Obetalt belopp	Dynamisk	Numerisk	Totalt obetalt belopp före tillämpning av försäljningsintäkter och återvinningar.
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	Numerisk	Totala återvinningar inklusive alla försäljningsintäkter.
Särskild finansieringsstatus	Dynamisk	Y/N	Administreras lånet för närvarande på ett särskilt sätt vid betalningsdatum?
Datum för fallisemang	Dynamisk	Datum	Datum som lånebetalningen försumrades.
Likvidationsvaluta	Dynamisk	Lista	Beteckning av likvidationsvalutan.
Valuta för förluster	Dynamisk	Lista	Beteckning av förlustvalutan.
Valuta för fallisemang/dröjsmål	Dynamisk	Lista	Beteckning av valuta för fallisemang/dröjsmål.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Uppgifter om modifiering av lånet			
Godkännande från innehavare av skuldbrev	Dynamisk	Y/N	Behövs godkännande från innehavare av skuldbrev vid en omstrukturering?
Planerat möte med innehavare av skuldbrev	Dynamisk	Datum	Vilket datum är nästa möte med innehavaren av skuldbrevet planerat till?
Sista datum för försäljning av lån	Dynamisk	Datum	Det datum som lånet såldes till emittenten, om lånet var en del av den ursprungliga värdepapperiseringen, kommer detta sålunda att vara värdepapperiseringsdatumet.
Datum för senaste värdepapperisering för fastighet	Dynamisk	Datum	Det datum den senaste fastigheten eller fastigheterna bidrog till denna värdepapperisering. Om eventuella fastigheter har ersatts, ska datumet för den senaste ersättningen anges. Om fastigheterna var en del av den ursprungliga transaktionen, kommer detta att vara värdepapperiseringsdatumet.
Datum för övertagande	Dynamisk	Datum	Det datum som överlåtelsen/novationen eller övertagande verkställdes av den nya låntagaren.
Datum för uppskattning av nedsättning av belopp	Dynamisk	Datum	Det datum då uppskattningen av nedsättning av belopp beräknades och godkändes (inledande eller uppdaterad beräkning från och med gällande datum).
Datum för senaste ändring	Dynamisk	Datum	Senaste ikraftträdandedag som lånet ändrades.
Modifieringskod	Dynamisk	Lista	Typ av modifiering.
Modifierat betalningsbelopp	Dynamisk	Numerisk	Om lånet har omstrukturerats (troligen under en testprocess) och amorteringsschemat har ändrats, ska det nya beloppet, uttryckt som en procentsats av lånebalansen, anges.
Modifierade räntesats för lånet	Dynamisk	Numerisk	Om lånet har omstrukturerats (troligen under en testprocess) och räntesatsen/marginalen har ändrats, ska den nya räntesatsen anges.
Uppgifter om särskild administrationsstatus			
Serviceföretagets bevakningslista	Dynamisk	Datum	Fastställande av det datum då ett lån placerades på en bevakningslista. Om lånet togs bort från bevakningslistan under en tidigare period och nu kommer tillbaka, ska det nya ikraftträdandedatumet anges.
Datum för det särskilda serviceföretagets senaste överföring	Dynamisk	Datum	Det datum som ett lån överfördes till det särskilda serviceföretaget efter en administrerande överföringshändelse. <i>Anmärkning:</i> Om lånet har haft flera överföringar, ska detta vara det sista datumet för överföring till särskild administration.
Datum för senaste återgång till det primära serviceföretaget	Dynamisk	Datum	Det datum vid vilket ett lån blir ett korrigerat hypotekslån, vilket är den dag lånet återfördes från det särskilda serviceföretaget till master/det primära serviceföretaget.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Utebliven återvinning fastställd	Dynamisk	Y/N	Indikatorn (ja/nej) för huruvida serviceföretaget/det särskilda serviceföretaget har fastställt att det kommer att bli ett underskott i återvinningen av alla förskott som har gjorts och i den utestående lånebalansen och alla andra belopp som föreligger till betalning på lånet från intäkter vid försäljning eller likvidation av fastigheten eller lånet.
Datum för försummelse av lånet	Dynamisk	Datum	Det datum som försummelsen uppstod. Vid flera överträdelser, datumet för den tidigaste betalningsförsummelsen.
Datum då försummelsen reglerats	Dynamisk	Datum	Datum då överträdelserna reglerats. Vid flera överträdelser: datum då den sista överträdelserna reglerats.
Kod för kriterium enligt bevakningslista	Dynamisk	Lista	Kod enligt serviceföretagets bevakningslista. Om flera villkor är tillämpliga, ange den mest belastande koden.
Valuta för avgifter	Dynamisk	Lista	Beteckning av avgiftsvalutan.

Uppgifter om särskilt serviceföretag

Namn på särskilt serviceföretag	Dynamisk	Text	Namn på särskilt serviceföretag.
Vill du byta särskilt serviceföretag?	Dynamisk	Y/N	Har det skett en förändring i det särskilda serviceföretaget sedan den föregående rapporteringsperioden?
Långgivare av annan prioritet inblandad i verkställighet	Dynamisk	Y/N	Är en långgivare av en annan prioritet involverad i verkställigheten?

Detaljerad information om lånestatus som förfallit till betalning

Fallisemang eller utestängande	Dynamisk	Y/N	Är lånet för närvarande i fallisemang eller utestängning?
Orsak till fallisemang	Dynamisk		Orsak till fallisemang.
Brott mot avtalsbestämmelse/utlösande faktor	Dynamisk	Lista	Brott mot avtalsbestämmelse/utlösande faktor.

Information med avseende på direktivet för kapitalkrav

Specificera originatorns efterlevnad av ett av fyra retentionsalternativ	Dynamisk	Lista	Typ av retention.
Kvarhålls av originatorn	Dynamisk	Numerisk	Ekonomisk nettoränta som kvarhålls av originatorn i procentandelar (%) enligt artikel 405 i förordning (EU) nr 575/2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag.

FASTIGHET:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Uppgifter om fastigheten som står som säkerhet			
Fastighetskod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för fastigheten. Vid flera fastigheter (som ett flerbostadshus), bör detta vara en unik kod som identifierar dem kollektivt.
Långruppering med fastighet som ställts som säkerhet för flera lån	Dynamisk	Text/numerisk	Vänligen ange relevanta lånekoder för emissionscirkuläret. Om en fastighet står som säkerhet för flera lån inom transaktionen eller poolen, ska koderna avgränsas med kommattecken.
Fastighetsnamn	Statisk	Text/numerisk	Namnet på fastigheten som fungerar som säkerhet för lånet. Vid flera fastigheter (som ett flerbostadshus) bör detta vara det namn som identifierar dem kollektivt.
Fastighetsadress	Statisk	Text/numerisk	Adress till den fastighet som fungerar som säkerhet för lånet.
Fastighetens stad	Statisk	Text	Stad där fastigheten är belägen.
Fastighetens postnummer	Statisk	Text/numerisk	Den primära fastighetens postnummer. Åtminstone de första två till fyra tecknen måste uppges.
Fastighetsland	Statisk	Lista	Land där fastigheten är belägen.
Kod för fastighetstyp	Statisk	Lista	Fastighetstyp, eller den referens som definieras i värderingsrapporten eller emissionsdokumentationen.
Byggår	Statisk	Datum	Året som fastigheten byggdes enligt värderingsrapporten eller emissionsdokumentet.
Senaste renoveringsår	Dynamisk	Datum	Det år som den sista stora renoveringen/nybyggnationen slutfördes på fastigheten enligt värderingsrapporten eller emissionsdokumentet.
Antalet kvadratmeter vid värdepapperiseringsdatumet	Dynamisk	Numerisk	Den uthyrningsbara ytan i kvadratmeter i de fastigheter som fungerar som säkerhet för lånet enligt den senaste värderingsrapporten. Vid flera fastigheter ska ytan summeras.
Den godkända inre golvytan	Dynamisk	Y/N	Har en värderingsman verifierat den inre golvytan i fastigheten?
Antal enheter/sängar/rum	Statisk	Numerisk	För fastighetstypen Multifamily ska antalet enheter anges, för gästmottagning/hotell/hälso- och sjukvård: sängar, för husvagnsparkeringar: enheter, logi = rum, egna lagerenheter. Vid flera fastigheter ska värdena summeras, om alla är av samma fastighetstyp.
Fastighetsstatus	Dynamisk	Lista	Fastighetens senaste lånestatus.
Fastighetens äganderättsform	Statisk	Lista	Fastighetens relevanta äganderättsform. Ett hyresavtal endast för mark, i vilket låntagaren normalt sett äger en byggnad eller erfordras att bygga enligt specifikationerna i hyresavtalet.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Den uthyrda fastighetens förfallodatum	Statisk	Datum	Ange det datum då tomträttens ränta tidigast förfaller till betalning.
Betalbar tomträttsavgift	Dynamisk	Numerisk	Om fastigheten är en tomträtt, ska den aktuella årliga arrendeavgiften som ska betalas till uthyraren uppges.
Datum för den senaste värderingen	Dynamisk	Datum	Datum för den senaste fastighetsvärderingen.
Den senaste värderingen	Dynamisk	Numerisk	Den senaste värderingen av fastigheten.
Basis för den senaste värderingen	Dynamisk	Lista	Basis för den senaste värderingen.
Valuta för tomträttsavgäld	Dynamisk	Lista	Valuta för tomträttsavgäld ("Tomträttsavgäld som ska betalas").
Valuta för den senaste värderingen	Dynamisk	Lista	Valutan för den senaste värderingen ("Senaste värdering").

Uppgifter om värdepapperiseringsdatum

Datum för fastighetens värdepapperisering	Statisk	Datum	Det datum som fastigheten lades till denna värdepapperisering. Om denna fastighet har ersatts, ska datumet för den ersättningen anges. Om fastigheten var en del av den ursprungliga transaktionen kommer detta att vara värdepapperiseringsdatumet.
Tilldelad andel av lånet vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Tilldelat lån (%) som kan hänföras till fastigheten vid värdepapperiseringsdatumet när det finns fler än en fastighet som står som säkerhet för lånet.
Datum för rörelserapport vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Datum	Slutdatum för rörelserapport för den information som används i emissionscirkuläret (t.ex. år till datum, årliga, kvartalsvisa eller avslutande 12 månader).
Driftskostnader vid värdepapperiseringsdatumet	Dynamisk	Numerisk	Intäkterna minus driftskostnaderna vid värdepapperiseringsdatumet
Värdering vid värdepapperiseringsdatumet	Statisk	Numerisk	Värdering av fastigheterna som ställts som säkerhet för lånet vid värdepapperiseringsdatumet enligt vad som beskrivs i emissionscirkuläret.
Namnet på värderingsman vid värdepapperisering	Statisk	Text	Namnet på värderingsföretaget som utförde fastighetsvärderingen vid värdepapperiseringen.
Värderingdag vid värdepapperiseringsdatumet	Dynamisk	Datum	Det datum som värderingen utarbetades för de värden som redovisas i emissionscirkuläret.
Vakant besittningsvärde vid värdepapperiseringsdatumet	Dynamisk	Numerisk	Vakant besittningsvärde vid värdepapperiseringsdatumet.
Kommersiellt område	Dynamisk	Numerisk	Fastighetens totala kommersiella uthyrningsbara yta i kvadratmeter som står som säkerhet för lånet enligt den senaste värderingsrapporten.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Bostadsområde	Dynamisk	Numerisk	Fastighetens totala uthyrningsbara bostadsyta i kvadratmeter som står som säkerhet för lånet enligt den senaste värderingsrapporten.
Valuta för finansaktier	Dynamisk	Lista	Beteckning av lånevalutan.

Senaste finansiella information (YTD) om fastighet

Aktuellt tilldelad låneandel	Dynamisk	Numerisk	Tilldelat lån (%) som kan hänföras till lånets betalningsdatum när det finns fler än en fastighet som står som säkerhet för lånet, varvid summan av alla procentangivelser ska uppgå till 100. Detta kan anges i låneavtalet.
Aktuellt tilldelat utgående lånebelopp	Dynamisk	Numerisk	Tillämpa aktuellt tilldelad % till den faktiska utestående balansen på lånet.
Senaste finansiella uppgifter från startdatumet	Dynamisk	Datum	Den första dagen för finansiella uppgifter som används för det senaste operativa bokslutet (t.ex. varje månad, kvartal, år till datum eller avslutande 12 månader).
Senaste finansiella uppgifter från slutdatumet	Dynamisk	Datum	Slutdatum för finansiella uppgifter som används för det senaste operativa bokslutet (t.ex. varje månad, kvartal, år till datum eller avslutande 12 månader).
Sista månaden av året som används för rapportering av resultaträkningen	Dynamisk	Text/numerisk	Ange månad då resultaträkningen för varje år (senaste, föregående och näst föregående) avslutas.
Senaste finansiella indikatorn	Dynamisk	Lista	Det här fältet används för att beskriva den period som den senaste resultaträkningen återspeglar.
Senaste intäkter	Dynamisk	Numerisk	De totala intäkterna för den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet (dvs. år till datum eller avslutande 12 månader) för alla fastigheterna. För flera fastigheter summera sedan intäkterna.
Senaste driftskostnaderna	Dynamisk	Numerisk	De totala driftskostnaderna för den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet (t.ex. varje månad, kvartal, år till datum eller avslutande 12 månader) för alla fastigheter.
Senaste periodens rörelseinkomster	Dynamisk	Numerisk	De totala intäkterna minus de totala driftskostnaderna för perioden som omfattas av det senaste operativa bokslutet.
Senaste kapitalutgifter	Dynamisk	Numerisk	De totala kapitalkostnaderna (i motsats till reparationer och underhåll för den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet, t.ex. varje månad, kvartal, år till datum eller avslutande 12 månader) för alla fastigheter.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Senaste nettokontantflödet	Dynamisk	Numerisk	De totala nettorörelseintäkterna minus kapitalkostnaderna för den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet.
Senaste skuldbeloppet	Dynamisk	Numerisk	Totala planerade betalningar av kapitalbelopp och ränta under den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet (t.ex. varje månad, kvartal, år till datum eller avslutande 12 månader).
Senaste DSCR (NOI)	Dynamisk	Numerisk	Beräkna skuldbetalningens räntetäckningsgrad (DSCR) baserat på nettorörelseintäkterna (NOI) för den period som omfattas av det senaste operativa bokslutet (t.ex. varje månad, kvartal, år till datum eller avslutande 12 månader).
Avtalsenliga årliga hyresintäkter	Dynamisk	Numerisk	De avtalsenliga årliga hyresintäkterna härrör från den senaste låntagarens hyresschema.

Uppgifter om fastighetens uthyrningsgrad

Uthyrningsgrad från datumet	Dynamisk	Datum	Datumet för den senast mottagna hyran enligt hyreskontot/hyresschemat (vad beträffar lokaler för mottagande av gäster [hotell] och hälso- och sjukvårdsanläggningar ska genomsnittlig beläggning användas för den period som de finansiella rapporterna redovisar).
Fysisk uthyrningsgrad vid värdepapperiseringsdatumet	Dynamisk	Numerisk	Vid värdepapperisering, den tillgängliga andelen uthyrningsbart utrymme som faktiskt är belagt (dvs. där hyresgäster verkligen är i besittning av utrymmet och det inte är vakant). Bör härledas från ett hyreskonto/-schema eller annat dokument som anger att belägningsgraden överensstämmer med informationen från det senaste räkenskapsåret.
Senaste fysiska beläggning	Dynamisk	Numerisk	Den senaste tillgängliga andelen uthyrningsbart utrymme som faktiskt är belagt (dvs. där hyresgäster verkligen är i besittning av utrymmet och det inte är vakant). Bör härledas från ett hyreskonto/-schema eller annat dokument som anger att belägningsgraden överensstämmer med informationen från det senaste räkenskapsåret.
Hyresgästen är i besittning av utrymmet enligt uppgifter om hyresgäster	Dynamisk	Y/N	Är informationen om hyresgästen tillgänglig på en hyresgästspecifik basis?
Vägda genomsnittliga hyresvillkor	Dynamisk	Numerisk	Vägda genomsnittliga hyresvillkor i år.
Vägda genomsnittliga hyresvillkor (i 1:a paus)	Dynamisk	Numerisk	Vägda genomsnittliga hyresvillkor (i år) efter alla alternativ om 1:a paus

De tre viktigaste uppgifterna om hyresgäster

% inkomst som upphör att gälla under 1–12 månader	Dynamisk	Numerisk	Procentandel av inkomsten som upphör att gälla under 1 till 12 månader.
% inkomst som upphör att gälla under 13–24 månader	Dynamisk	Numerisk	Procentandel av inkomsten som upphör att gälla under 13 till 24 månader.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
% inkomst som upphör att gälla under 25–36 månader	Dynamisk	Numerisk	Procentandel av inkomsten som upphör att gälla under 25 till 36 månader.
% inkomst som upphör att gälla under 37–48 månader	Dynamisk	Numerisk	Procentandel av inkomsten som upphör att gälla under 37 till 48 månader.
% inkomst som upphör att gälla vid över 49 månader	Dynamisk	Numerisk	Procentandel av inkomsten som upphör att gälla vid över 49 månader.
Största hyresgäst efter inkomst (netto)	Dynamisk	Text/numerisk	Namnet på den största nuvarande hyresgästen enligt nettohyra.
Datum för hyresavtalets förfallotid beträffande den största hyresgästen	Dynamisk	Datum	Utgångsdatum för hyresavtal för den största nuvarande hyresgästen (enligt nettohyra).
Hyra som ska betalas av den största hyresgästen	Dynamisk	Numerisk	Årlig hyra som ska betalas av den största nuvarande hyresgästen.
Den näst största hyresgästen efter inkomst (netto)	Dynamisk	Text/numerisk	Namnet på den näst största nuvarande hyresgästen (enligt nettohyra).
Utgångsdatum för hyresavtal för den näst största hyresgästen	Dynamisk	Datum	Utgångsdatum för hyresavtal för den näst största nuvarande hyresgästen (enligt årlig nettohyra).
Hyra som ska betalas av den näst största hyresgästen	Dynamisk	Numerisk	Årlig hyra som ska betalas av den näst största nuvarande hyresgästen.
Den tredje största hyresgästen efter inkomst (netto)	Dynamisk	Text/numerisk	Namnet på den tredje största nuvarande hyresgästen (enligt nettohyra).
Utgångsdatum för hyresavtal för den tredje största hyresgästen	Dynamisk	Datum	Utgångsdatum för hyresavtal för den tredje största nuvarande hyresgästen (enligt årlig nettohyra).
Hyra som ska betalas av den tredje största hyresgästen	Dynamisk	Numerisk	Årlig hyra som ska betalas av den tredje största nuvarande hyresgästen.
Hyresvaluta	Dynamisk	Lista	Beteckning av hyresvalutan.

Uppgifter om tvångsförsäljning

Datum för när tillgången förväntas vara löst eller tvångssåld	Dynamisk	Datum	Beräknat datum vid vilket det särskilda serviceföretaget förväntar sig ett upplösande. Vid flera fastigheter, ange det senaste datumet för de närliggande fastigheterna. Om i tvångsförsäljning = förväntat datum för tvångsförsäljning och om fastigheten är i besittning = förväntat försäljningsdatum.
Startdatum för besittningsförfaranden	Dynamisk	Datum	Det datum vid vilket förfarandena för tvångsförsäljning eller alternativa verkställighetsförfaranden inleddes mot eller godkändes av låntagaren.
Datum för överlämnandet till konkursförvaltare	Dynamisk	Datum	Det datum vid vilket äganderätt till (eller en alternativ form av effektiv kontroll och förmåga att avyttra) fastigheten som ställts som säkerhet erhöles.

INFORMATION OM OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Allmänna uppgifter om obligationer			
Kod för transaktionspool	Statisk	Text/numerisk	Den unika kodsträngen för transaktionen eller poolen.
Distributionsdatum	Statisk	Datum	Datum för betalning av obligationernas delbelopp för ränta och kapitalbelopp.
Avstämningsdagen	Statisk	Datum	Det datum som skuldbrevets klass måste innehas för att kunna beaktas som innehavare av posten.
Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) ges till en tranch av strukturerade instrument med lån på kommersiella fastigheter som säkerhet som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, dvs. serie 1, klass A1 etc.
Cusip (regel 144A)	Statisk	Text/numerisk	ID-koden för säkerheter tilldelas varje skuldklass eller delbetalning enligt normer som fastställts av Cusipnumret (<i>Committee on Uniform Security Identification Procedures</i>) för krav enligt regel 144A eller andra koder för värdepapper som fastställs av en börs eller annan enhet.
ID-nummer för internationella värdepapper	Statisk	Text/numerisk	ID-koden för säkerheter tilldelas varje skuldklass eller delbetalning enligt normer som fastställts av Isin (internationellt standardnummer för värdepapper) eller andra koder för värdepapper som fastställs av en börs eller annan enhet.
Gemensam kod (regel 144A)	Statisk	Text/numerisk	Den niosiffriga ID-koden som gemensamt utfärdas för varje skuldklass eller tranch av Cedel och Euroclear.
ID-nummer för internationella värdepapper (förordning S)	Statisk	Text/numerisk	ID-koden för säkerheter tilldelas varje skuldklass eller delbetalning enligt normer som fastställts av Isin (internationellt standardnummer för värdepapper) för krav enligt förordning S eller andra koder för värdepapper som fastställs av en börs eller annan enhet.
Gemensam kod (förordning S)	Statisk	Text/numerisk	ID-koden för säkerheter tilldelas varje skuldklass eller delbetalning enligt normer som fastställts av Cusipnumret (<i>Committee on Uniform Security Identification Procedures</i>) för krav enligt förordning S eller andra koder för värdepapper som fastställs av en börs eller annan enhet.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	Datum	Emissionsdatum för obligationer.
Laglig inlösendag	Statisk	Datum	Det datum vid vilket denna särskilda skuldklass eller delbetalning måste återbetalas helt för att inte falla.
Valuta	Statisk	Lista	Typ av valuta i vilken skuldklassens eller delbetalningens monetära värde är uttryckt.
Ursprunglig kapitalbalans	Statisk	Numerisk	Den ursprungliga kapitalbalansen för det specifika skuldbrevets klass eller delbetalning vid emissionsdatumet.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Information om obligationernas kapitalbelopp			
Nominell flagga	Statisk	Y/N	"J" för nominell, "N" om det här skuldbrevets klass eller delbetalning endast är ränta, dvs. ett IO-utköp.
Inledande kapitalbelopp	Statisk	Numerisk	Utestående kapitalbalansen för skuldbrevets klass eller delbetalning i början av den aktuella perioden.
Planerat kapitalbelopp	Statisk	Numerisk	Planerat kapitalbelopp som betalas för skuldbrevets klass eller delbetalning under perioden.
Oplanerat kapitalbelopp	Dynamisk	Numerisk	Oplanerat kapitalbelopp som betalas för skuldbrevets klass eller delbetalning under perioden.
Distribution av totalt kapitalbelopp	Dynamisk	Numerisk	Det totala kapitalbeloppet (planerat eller oplanerat) som betalas för skuldbrevets klass eller delbetalning under perioden.
Amorteringstyp	Statisk	Lista	Den amorteringsmetod med vilken skuldbrevets klass eller delbetalning betalas med jämna mellanrum.
Periodtid för endast ränta	Statisk	Numerisk	Period för endast ränta, angivet i månader.
Kapitaliserad ränta	Dynamisk	Numerisk	All ränta som läggs till klassens saldo inklusive negativa amorteringar.
Kapitalunderskott	Dynamisk	Numerisk	Det totala kapitalunderskottet för rapporteringsperioden.
Sammanlagda kapitalunderskott	Dynamisk	Numerisk	Kapitalunderskott som fördelats kumulativt till dagens datum.
Utgående kapitalbalans	Dynamisk	Numerisk	Den utestående kapitalbalansen för skuldbrevets klass eller delbetalning i början av den aktuella perioden.
Skuldbrevets betalningsfaktor	Dynamisk	Numerisk	Kapitalbelopp som betalas på skuldbrevets klass eller delbetalning under rapporteringsperioden som en andel av det ursprungliga skuldbrevets eller delbetalningens (första) balans ($0 < x < 1$), upp till 12 decimaltecken.
Utestående skuldfaktor	Dynamisk	Numerisk	Kapitalbelopp som betalas på skuldbrevets klass eller delbetalning under den aktuella rapporteringsperioden som en andel av det ursprungliga skuldbrevets eller delbetalningens (första) balans ($0 < x < 1$), upp till 12 decimaltecken.
Datum för betalning av nästa revers	Dynamisk	Datum	Datum för betalning/fördelning av nästa periods skuldklass eller delbetalning.
Uppgifter om ränta på obligationer			
Typ av indexränta	Statisk	Lista	Ränteindexets basreferens som anges i emissionsprospektet är tillämpligt på det specifika skuldbrevets klass eller delbetalningen. Aktuellt räntesatsindex.
Aktuell indexränta	Dynamisk	Numerisk	Det aktuella värdet för indexräntan tillämpas på det specifika skuldbrevet eller delbetalningen under den aktuella periodiseringen, till minst 5 decimaler.
Periodisering	Statisk	Lista	Den periodisering med vilken skuldbrevet eller delbeloppet betalas med jämna mellanrum.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Aktuella periodiserade dagar	Dynamisk	Numerisk	Antalet periodiserade dagar gäller för beräkning av den aktuella periodens betalningsränta.
Upplupen ränta	Dynamisk	Numerisk	Beloppet för upplupen ränta.
Tillämplig övre gräns på tillgängliga medel	Statisk	Y/N	Gynnar skuldbrevets klass en övre gränsmekanism för tillgängliga fonder (AFC)?
Uppskattning av nedsättning av belopp	Dynamisk	Numerisk	Aktuell uppskattning av nedsättningen för denna klass.
Sammantagen uppskattning av nedsättningen	Dynamisk	Numerisk	Fördelning av den totala kumulativa uppskattningen av en nedsättning.
Fördelning av övrig ränta	Dynamisk	Numerisk	Andra specifika tillägg till räntan.
Aktuellt räntebortfall	Dynamisk	Numerisk	Räntebortfallet för denna rapporteringsperiod för denna klass.
Ackumulerat räntebortfall	Dynamisk	Numerisk	Ackumulerat räntebortfall fram till aktuellt datum.
Fördelning av total ränta	Dynamisk	Numerisk	Total ränta som betalats.
Ingående obetald räntebalans	Dynamisk	Numerisk	Utestående ränteunderskott i början av den aktuella perioden.
Kortfristiga obetalda räntor	Dynamisk	Numerisk	All uppskjuten ränta under den aktuella perioden som ska betalas vid nästa betalningsdatum.
Långfristiga obetalda räntor	Dynamisk	Numerisk	All uppskjuten ränta under den aktuella perioden som ska betalas på förfallodagen.
Övre gräns som utlöser händelse för tillgängliga medel	Dynamisk	Y/N	Har en övre gränshändelse för tillgängliga fonder (AFC) utlösts?
Nästa periods räntesats	Dynamisk	Numerisk	Nästa periodvärd för indexräntan.
Datum för nästa indexåterställning	Dynamisk	Datum	Återställ datum för nästa periods indexränta.

Uppgifter om likviditetsfaciliteter

Likviditetsfacilitet – ingående balans	Dynamisk	Numerisk	Den ingående balansen för likviditetsfaciliteten.
Justeringar av likviditetsfaciliteten	Dynamisk	Numerisk	Eventuella justeringar av likviditetsfaciliteten.
Kreditutnyttjande på likviditetsfaciliteten	Dynamisk	Numerisk	Beloppet för kreditutnyttjande från likviditetsfaciliteten.
Återbetalningar till likviditetsfaciliteten	Dynamisk	Numerisk	Återbetalda belopp till likviditetsfaciliteten.
Likviditetsfacilitet – utgående balans	Dynamisk	Numerisk	Det utgående saldot.
Valuta för likviditetsfaciliteten	Dynamisk	Lista	Valuta för likviditetsfaciliteten.

BILAGA III

Uppgifter om lånenivå – Rapporteringsmall för strukturerade instrument med lån till små och medelstora företag som säkerhet

TILLGÅNGAR:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Poolens brytdatum	Dynamisk	Datum	Aktuellt brytdatum för poolen eller portföljen.
Kod för pool	Statisk	Text/numerisk	Den unika kodsträngen/transaktionsnamnet för transaktionen eller poolen.
Lånekod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för varje lån.
Originator	Statisk	Text	Långivare som förskottade det ursprungliga lånet.
Serviceföretagets kod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod per serviceföretag för att flagga vilken enhet som administrerar lånet.
Serviceföretagets namn	Dynamisk	Text	Serviceföretagets namn.
Låntagarkod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod per fastighet för att göra det möjligt att identifiera låntagare med flera lån i poolen (t.ex. visas ytterligare förskott/sekundära lån som separata poster).

Information om gäldenären

Land	Statisk	Lista	Land för permanent etablering.
Postnummer	Statisk	Text	Åtminstone de första två två eller tre tecknen måste uppges. Ange inte det fullständiga postnumret.
Rättslig form av gäldenär/ företagstyp	Statisk	Lista	
Låntagare Basel III segment	Statisk	Lista	
Dotterbolag till originatorn?	Statisk	Y/N	Är låntagaren ett dotterbolag till originatorn?
Tillgångstyp	Statisk	Lista	
Förmånsrätt	Dynamisk	Lista	
Uppskattning av bankens interna förlust med tanke på fallisemang (LGD)	Dynamisk	Numerisk	Underskott med tanke på fallisemang i normala ekonomiska förhållanden.
Nace branschkod	Statisk	Text/numerisk	Låntagarens Nace-branschkod.

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Leasingfunktioner			
Lånets ursprungsdatum	Statisk	Datum	Datum för förskott på ursprungligt lån.
Sista förfallodag	Statisk	Datum	Sista förfallodag av lånet.
Beteckning av lånevalutan	Statisk	Lista	Lånebeteckning.
Säkrat lån	Dynamisk	Y/N	Har det specifika lånet säkrats för valutarisk?
Ursprunglig lånebalans	Statisk	Numerisk	Ursprunglig total lånebalans
Aktuellt saldo	Dynamisk	Numerisk	Antalet utestående lån vid poolens brytdatum. Detta bör inbegripa alla belopp som klassas som kapitalbelopp i transaktionen. Om avgifter, till exempel, har lagts till lånebalansen och är en del av kapitalbeloppet i transaktionen bör dessa läggas till. Uteslutande av eventuell dröjsmålsränta eller straffbelopp.
Värdepapperiserade lånebelopp	Statisk	Numerisk	Balans för värdepapperiserade lån vid brytdatumet
Betalningsfrekvens för kapitalbelopp	Statisk	Lista	Frekvensen för återbetalningar av kapitalbelopp som föreligger, dvs. antalet månader mellan betalningarna.
Räntebetalningsfrekvens.	Statisk	Lista	Frekvensen av räntebetalningar som föreligger, dvs. antalet månader mellan betalningarna.
Amorteringstyp	Dynamisk	Lista	Amorteringstyp.
Typ av lån	Statisk	Lista	
Stort belopp	Dynamisk	Numerisk	Stort betalningsbelopp
Betalningstyp	Dynamisk	Lista	

Räntesats

Aktuell räntesats	Dynamisk	Numerisk	Aktuell räntesats (%).
Övre gräns för räntesats	Dynamisk	Numerisk	Övre gräns för räntesats (%).
Lägsta räntesats	Statisk	Numerisk	Lägsta räntesats (%).
Typ av räntesats	Dynamisk	Lista	Typ av räntesats.
Aktuellt räntesatsindex	Dynamisk	Lista	Aktuellt räntesatsindex (den referensräntesats gentemot vilken hypotekslånets räntesats bestäms).

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Aktuell räntesatsmarginal	Dynamisk	Numerisk	Aktuell räntesatsmarginal (för lån med bunden ränta är detta detsamma som den aktuella räntesatsen, medan för lån med rörlig ränta är detta marginalen över eller under, vid negativ indata) indexräntan.
Återställning av ränteperiod	Statisk	Lista	

Resultatinformation

Räntebeloppet i dröjsmål	Dynamisk	Numerisk	Aktuell balans för obetald ränta
Antal dagar i dröjsmålsränta	Dynamisk	Numerisk	Antalet dagar som detta lån är i dröjsmål (vid poolens brytdatum) enligt emittentens definition.
Obetalda kapitalbelopp	Dynamisk	Numerisk	Aktuellt eftersläpande kapitalsaldo. Resterande skuld definieras som: Det totala antalet föreskrivna betalningar för kapitalbelopp till dagens datum MINUS det totala antalet mottagna betalningar för kapitalbelopp till dagens datum MINUS alla kapitaliserade belopp.
Antal dagar i dröjsmål på kapitalbelopp	Dynamisk	Numerisk	Antalet dagar som detta lån är i dröjsmål (vid poolens brytdatum) enligt emittentens definition.
Fallisemang eller utebliven betalning på lånet enligt transaktionens definition	Dynamisk	Y/N	Huruvida det har uppstått ett fallisemang eller utebliven betalning på lånet enligt definitionen.
Fallisemang eller utebliven betalning på lånet enligt definitionen i Basel III	Dynamisk	Y/N	Om det har uppstått ett fallisemang eller utebliven betalning på lånet enligt definitionen i Basel III.
Orsak till fallisemang (definitionen i Basel III)	Dynamisk	Lista	Orsak till fallisemang enligt definitionen i Basel III.
Datum för fallisemang	Dynamisk	Datum	Det datum som lånet försummas enligt transaktionens definition av försummelse av betalning.
Obetalt belopp	Dynamisk	Numerisk	Totalt obetalt belopp (enligt transaktionens definition av försummelse) före tillämpning av försäljningsintäkter och återvinningar.
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	Numerisk	Totala återvinningar inklusive alla försäljningsintäkter. Endast relevant för lån som har övergått till fallisemang/förklarats förfallet.
Tilldelade underskott	Dynamisk	Numerisk	De tilldelade förlusterna till dagens datum.
Datum när förlusten fördelades	Dynamisk	Datum	Datum när förlusten fördelades.

AMORTERINGSPROFIL:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Utestående balans för period 1	Dynamisk	Numerisk	Amorteringsprofil med 0 % förskottsbetalningar

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Datum för utestående balans för period 1	Dynamisk	Datum	Datum som associeras med balansen i period 1
Utestående balans för period [2–120]	Dynamisk	Numerisk	Amorteringsprofil med 0 % förskottsbetalningar
Datum för utestående balans för period [2–120]	Dynamisk	Datum	Datum som associeras med balansen i period [2–120]

SÄKERHET:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Säkerhet			
Säkerhets-ID	Statisk	Text	Unik säkerhetskod för den ursprungliga enheten.
Lånekod	Statisk	Text/numerisk	Unik lånekod som avser säkerheten. Dessa ska överensstämma med koderna i fältet "Lånekod".
Säkerhetstyp	Statisk	Lista	Finns det en fast eller rörlig avgift för tillgångarna?
Säkerhetstyp	Statisk	Lista	Säkerhetstyp.
Ursprungligt värderingsbelopp	Statisk	Numerisk	Fastighetsvärde vid tidpunkten för det senaste låneförskottet före en värdepapperisering.
Ursprungligt värderingsdatum	Statisk	Datum	Datum för den senaste fastighetsvärderingen vid tidpunkten för det senaste låneförskottet före en värdepapperisering.
Aktuellt värderingsdatum	Dynamisk	Datum	Detta bör vara datumet för den mest aktuella värderingen.
Ursprunglig värderingstyp	Statisk	Lista	Värderingstyp vid originering.
Prioritet	Dynamisk	Text	
Fastighetens postnummer	Statisk	Text	Åtminstone de första två eller tre tecknen måste uppges.
Ursprungs kanal/anordnande bank eller avdelning	Statisk	Lista	
Valuta för säkerheter	Statisk	Lista	Detta bör vara den valuta som hänför sig till värderingsbeloppet i "Säkerheternas värde".
Antalet objekt som står som säkerhet och säkrar lånet	Dynamisk	Numerisk	Antalet objekt som står som säkerhet och säkrar lånet. Antalet bör återspegla antalet rapporter om säkerheter som lämnat in för lånet i den aktuella filen.

INFORMATION OM OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Fält för säkerhet eller uppgifter om obligationernas nivå			
Rapportdatum	Dynamisk	Datum	Det datum då transaktionsrapporten utfärdades.
Utfärdare:	Statisk	Text	Namnet på emittenten och emissionsserien, om tillämpligt.
Dragningar under likviditetsfacilitet	Dynamisk	Y/N	Om transaktionen har en likviditetsfacilitet ska det bekräftas huruvida det har gjorts en dragning från likviditetsfaciliteten under perioden fram till datumet för den sista räntebetalningen.

Fält för uppgifter om säkerhetsnivå

Utlösning av mätningar/ nyckeltal	Dynamisk	Y/N	Har en utlösande händelse inträffat? Status för olika typer av kriminellt beteende, utspädning, försummelser, förlust och liknande säkerhetsmätningar och nyckeltal i förhållande till deras förtida amortering eller andra utlösande händelsenivåer, vid aktuellt fastställt datum.
Genomsnittskurs för konstant förskottsbetalning	Dynamisk	Numerisk	Rapporten ska innehålla den genomsnittliga (Avg) konstanta förskottsbetalningskursens (CPR) takt för de underliggande lånen. Den genomsnittliga (Avg) konstanta förskottsbetalningskursens (CPR) takt är beloppet uttryckt som en förskottsbetalning för kapitalbeloppet som överstiger de planerade återbetalningarna. Den genomsnittliga (Avg) konstanta förskottsbetalningskursens (CPR) takt beräknas genom att först dela det aktuella lånets kapitalbalans (dvs. det faktiska saldot) med lånets planerade kapitalbalans förutsatt att inga förskottsbetalningar har gjorts (dvs. att endast planerade återbetalningar har gjorts). Denna kvot höjs sedan till en nivå där exponenten är kvantiteten tolv delat med antalet månader sedan emissionen. Subtrahera detta resultat från ett och multiplicera det sedan med hundra (100) för att bestämma den genomsnittliga konstanta förskottsbetalningskursens takt.

Fält för transaktionsrapportens kontaktinformation

Referenskontakt	Statisk	Text	Namnet på avdelningen eller informationskällornas referensperson(er).
Kontaktinformation	Statisk	Text	Telefonnummer och e-postadress.

OBLIGATIONSINFORMATION INDELAD PER TRANCH:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Fält för tranchnivå			
Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) som ges till en tranch av obligationer som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, dvs. serie 1, klass A1 etc.
ID-nummer för internationella värdepapper	Statisk	Text/numerisk	ID-koden för säkerheter som tilldelas varje klass av SMF enligt normer som fastställts av Isin (internationellt standardnummer för värdepapper) eller andra unika koder för värdepapper som fastställs av en börs eller annan enhet.

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Datum för betalning av ränta	Dynamisk	Datum	Det periodiska datum då den sista utbetalningen av ränta till innehavare av en specifik del av obligationer planeras ske.
Datum för betalning på kapitalbeloppet	Dynamisk	Datum	Det sista periodiska datum då en betalningen av kapitalbelopp till innehavare av en specifik tranch av obligationer planeras ske.
Valuta för obligationer	Statisk	Text	Beteckning för obligationer.
Referensränta	Statisk	Lista	Ränteindexet för basreferens enligt vad som avses i det emissionsdokumentet (t.ex. tre månaders Euribor) gäller för en specifik tranch av obligationer.
Laglig inlösendag	Statisk	Datum	Det datum innan vilket en särskild tranch av obligationer måste återbetalas för att inte fallera.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	Datum	Det datum då obligationerna emitterades.

BILAGA IV

Uppgifter om lånenivå – Rapporteringsmall för strukturerade instrument med billån som säkerhet

TILLGÅNGAR:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Transaktionsspecifik information			
Poolens brytdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Brytdatum för poolen eller portföljen. Detta är det datum till vilket uppgifterna om den underliggande tillgången i rapporten hänvisar.
Kod för pool	Statisk	Text/numerisk	Kod för pool eller portfölj/transaktionsnamn.
Serviceföretagets namn	Dynamisk	Text/numerisk	Unik kod per serviceföretag för att flagga vilken enhet som administrerar lånet eller hyresavtalet.
Reservserviceföretagets namn	Dynamisk	Text	Namn på reservserviceföretaget.

Information om lån eller hyresnivå

Lån eller hyreskod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för lånet eller hyresavtalet. ID-koden bör inte ändras genom transaktionens förlopp.
Originator	Statisk	Text	Långgivaren som förskottade det ursprungliga lånet eller hyresavtalet.
Låntagarkod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för låntagaren eller långgivaren.
Grupp företags-ID	Dynamisk	Text	Unikt grupp företags-ID som identifierar låntagarens slutgiltiga moderbolag.
Beteckning av låne- eller hyresvalutan	Statisk	Lista	Beteckning av låne- eller hyresvalutan.
Låntagarens sysselsättningsstatus	Statisk	Lista	Sysselsättningsstatus för den primära sökanden.
Primära inkomster	Statisk	9(11).99	Den primära låntagarens ingångna årliga bruttoinkomst.
Valuta för primära inkomster	Statisk	Lista	Beteckning av inkomstvalutan
Amorteringstyp	Dynamisk	Lista	Amorteringstyp.
Inkomstverifiering för primära inkomster	Statisk	Lista	Inkomstverifiering för primära inkomster.
Geografisk region	Statisk	Lista	Regionen där låntagaren befinner sig vid tecknandet.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Ursprungsdatum	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Datomet för det första förskottet på lånet eller början av hyresperioden.
Lånets eller hyresavtalets förväntade förfallodag	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Förväntat datum för lånets förfallodag eller upphörande av hyresavtalet.
Ursprungliga låne- eller hyresvillkor	Statisk	Numerisk	Ursprungliga avtalsvillkor (antal månader).
Datum för tillägg till poolen	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då lånet eller hyresavtalet överfördes till SPV.
Ursprunglig kapitalbalans	Statisk	9(11).99	Låntagarens kapitalbalans för lånet eller den diskonterade balansen för hyreskontot (inklusive kapitaliserade avgifter) vid originering.
Aktuellt utestående kapitalsaldo	Dynamisk	9(11).99	Låntagarens utestående balans för lånet eller den diskonterade balansen för hyreskontot vid poolens brytdatum. Detta ska inbegripa alla belopp där fordonet står som säkerhet. Om avgifter, till exempel, har lagts till balansen och är en del av kapitalbeloppet i transaktionen bör dessa läggas till.
Planerad betalningsdag	Dynamisk	9(11).99	Påföljande planerade avtalsenliga betalning som föreligger (betalningen föreligger om inga andra betalningssätt gäller).
Planerad betalningsfrekvens	Dynamisk	Lista	Planerad betalningsfrekvens.
Insatsbelopp	Statisk	9(11).99	Deponerings-/insatsbelopp på lånets eller hyresavtalets originering (detta bör inbegripa värdet för inbytta fordon osv.).
Ursprunglig belåning	Statisk	9(3).99	Fordonets belåningsgrad vid originering, som får avrundas till närmaste fem procent.
Produkttyp	Statisk	Lista	Produkttyp.
Alternativ till uppköpspris	Statisk	9(11).99	Beloppet som låntagaren har att betala i slutet av hyresavtalet eller lånet för att bli ägare till fordonet.
Återställningsintervall för räntesats	Statisk	9(2).99	Antalet månader mellan varje datum för återställning av räntesatsen på lånet eller hyresavtalet.
Aktuell ränta eller diskonteringsränta	Dynamisk	9(4).9(5)	Den totala aktuella räntan eller diskonteringsräntan (%) gäller för lån eller hyresavtal (det får avrundas till närmaste halva procent).
Aktuell räntesatsbas	Dynamisk	Lista	Aktuell räntesatsbas.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Aktuell räntesatsmarginal	Dynamisk	9(4).9(5)	Den aktuella räntemarginalen (%) på lånet eller hyresavtalet (det får avrundas till närmaste halva procent). För lån med bunden ränta är detta detsamma som aktuell ränta eller diskonteringsränta. För lån med rörlig ränta marginalen över (eller under, i sådant fall anges det som negativ indata) indexräntan.
Diskonteringsränta	Statisk	9(4).9(5)	Diskonteringsräntan tillämpades på fordran när den såldes till SPV (det får avrundas till närmaste halva procent).
Biltillverkaren	Statisk	Text	Varumärket för fordonstillverkaren.
Bilmodell	Statisk	Text/numerisk	Namnet på bilmodellen.
Ny eller begagnad bil	Statisk	Lista	Fordonets skick vid tidpunkten för lånets eller hyresavtalets originering.
Fordonets ursprungliga restvärde	Statisk	9(11).99	Fordonets uppskattade restvärde vid tidpunkten för lånets eller hyresavtalets originering. Svar får avrundas.
Värdepapperiserat restvärde	Statisk	9(11).99	Restvärdesbelopp som endast har värdepapperiserats. Svar får avrundas.
Uppdaterat restvärde för fordon	Dynamisk	9(11).99	Fordonets senaste uppskattade restvärde vid avtalets upphörande. Svar får avrundas.
Datum för uppdaterad restvärdering av fordon	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum då den senaste uppdaterade uppskattningen av fordonets restvärde beräknades. Om ingen uppdatering har utförts, ange datumet för den ursprungliga värderingen.
Kundtyp	Statisk	Lista	Rättslig form av kund.
Betalningsmetod	Dynamisk	Lista	Normal betalningsmetod (kan baseras på den sist mottagna betalningen).
Datum som det har tagits bort från poolen	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då lånet eller hyresavtalet togs bort från poolen, t.ex. vid återköp, utgång av hyresperiod, förskotts-betalning eller slut på återvinningsprocessen.
Övre gräns för räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Om det finns en övre gräns för den räntesats som kan debiteras på detta konto, ange denna övre gräns här – inkludera inte symbolen %.
Lägsta räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Om det finns en lägre gräns för den räntesats som kan debiteras på detta konto, ange denna lägre gräns här – inkludera inte symbolen %.
Kvarstående saldo	Dynamisk	9(11).99	Aktuellt skuldsaldo.
Antal månader i dröjsmål	Dynamisk	9(5).99	Antal dagar som lånet eller hyresavtalet är i dröjsmål från och med poolens brytdatum.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Datum för fallisemang	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för fallisemang.
Obetalt bruttobelopp	Dynamisk	9(11).99	Obetalt bruttobelopp på detta konto.
Försäljningspriset	Dynamisk	9(11).99	
Förlust på försäljning	Dynamisk	9(11).99	Obetalt bruttobelopp minus försäljningsintäkterna (exklusive avgifter för förskottsbetalning om underställt återvinningar av kapitalbelopp).
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	9(11).99	Kumulativa återvinningar på detta konto, minus kostnader.
Inlösningsdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum vid vilket kontot löstes in eller det datum när återvinningsförfarandet slutfördes för fallerat lån.
Restvärde av förluster	Dynamisk	9(11).99	Restvärde av förlust som uppstår vid inbyte av fordonet.
Kontostatus	Dynamisk	Lista	Aktuell status för kontot.

INFORMATION OM OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
----------	------------------	---------	-----------------------------------

Information obligationsnivå

Rapportdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Datum då transaktionsrapporten utfärdades, dvs. datumet för inlämning av den ifyllda mallen med uppgifter om lånenivå till dataregistret.
Utfärdare:	Statisk	Text	Namnet på emittenten och emissionsserien, om tillämpligt.
Alla reservkonton på målsaldo Balans	Dynamisk	Y/N	Är alla reservkonton (kontantreserv, blandad reserv, kvittningsreserv etc.) på de erfordrade nivåerna?
Dragningar under likviditetsfacilitet	Dynamisk	Y/N	Har likviditetsfaciliteten använts för att täcka underskott i perioden fram till datumet för den sista räntebetalningen?
Utlösning av mätningar/nyckeltal	Dynamisk	Y/N	Har en utlösande händelse inträffat?
Konstant på årsbasis Förskottsbetalningskurs	Dynamisk	9(3).99	Den på årsbasis beräknade konstanta förskottsbetalningstakten av underliggande fordringar baserad på den senaste periodiska konstanta förskottsbetalningstakten. Den periodiska konstanta förskottsbetalningstakten är lika med det totala oplanerade kapitalbeloppet som mottagits under den senaste perioden delat med början av periodens kapitalsaldo.
Totala fordringar som sålts till SPV	Dynamisk	9(11).99	Summan av kapitalbeloppet av fordringar som sålts till SPV (dvs. på balansdagen och under perioden för påfyllning, om tillämpligt) fram till dagens datum.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Kumulativa bruttobelopp i dröjsmål – poolen	Dynamisk	9(11).99	Summan av alla bruttobelopp i dröjsmål sedan avslutande, i valutabelopp.
Kumulativa återvinningar – poolen	Dynamisk	9(11).99	Summan av alla återvinningar efter avslut, med avdrag för kostnader, i valutabelopp.
Den rullande periodens slutdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då den rullande perioden förväntas avslutas, eller faktiskt avslutades.

Transaktionsrapportens kontaktinformation

Referenskontakt	Statisk	Text/numerisk	Namnet på avdelningen eller informationskällornas referensperson(er).
Kontaktinformation	Statisk	Text/numerisk	Telefonnummer och e-postadress.

OBLIGATIONSINFORMATION EFTER TRANCH:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
----------	------------------	---------	-----------------------------------

Information om tranchnivå

Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) som ges till en tranch av obligationer som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, dvs. serie 1, klass A1a etc.
Internationella värdepapper ID-nummer	Statisk	Text/numerisk	Den internationella säkerhetskoden eller -koderna, eller vid avsaknad av Isin, i sådant fall alla andra unika koder för värdepapper, såsom en Cusipkod, som har tilldelats denna tranch genom en börs eller annan enhet. Om mer än en kod förekommer, avgränsa med komma.
Datum för betalning av ränta	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket ränteutbetalningar har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Datum för betalning på kapitalbeloppet	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket utbetalningar på kapitalbeloppet har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Valuta för obligationer	Statisk	Lista	Benämningen på denna tranch.
Referensränta	Statisk	Lista	Ränteindexet för basreferens enligt vad som avses i emissionsdokumentet (t.ex. tre månaders Euribor) gäller för denna specifika tranch.
Laglig inlösendag	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum före vilket denna särskilda tranch måste återbetalas helt för att inte falla.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum då obligationerna emitterades.
Räntebetalningsfrekvens.	Statisk	Lista	Frekvensen med vilken ränta förfaller till betalning på denna tranch.

BILAGA V

Uppgifter om lånenivå – Rapporteringsmall för strukturerade instrument med lån till konsumenter som säkerhet

TILLGÅNGAR:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Transaktionsspecifik information			
Poolens brytdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Brytdatum för poolen eller portföljen. Detta är det datum till vilket uppgifterna om den underliggande tillgången i rapporten hänvisar.
Kod för pool	Statisk	Text/numerisk	Kod för pool eller portfölj/transaktionsnamn.
Serviceföretagets namn	Dynamisk	Text/numerisk	Unik kod per serviceföretag för att flagga vilken enhet som finansierar lånet.
Reservserviceföretagets namn	Dynamisk	Text	Namn på reservserviceföretaget.
Information om lånenivå			
Lånekod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för ett särskilt lån i poolen.
Originator	Statisk	Text	Långivare som förskottrade det ursprungliga lånet.
Låntagarkod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för en låntagare. Denna måste vara krypterad (dvs. inte det faktiska id-numret) för att garantera anonymitet för låntagaren.
Beteckning av lånevalutan	Statisk	Lista	Beteckning av lånevalutan.
Total kreditgräns	Dynamisk	9(11).99	För lån med flexibla funktioner för utställande på nytt/revolvering – det högsta lånebeloppet som potentiellt sett kan vara utestående.
Roterande slutdatum – lån	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	För lån med flexibla funktioner för utställande på nytt/revolvering – det datum när de flexibla funktionerna beräknas att upphöra, dvs. när den rullande perioden kommer att upphöra.
Låntagarens sysselsättningsstatus	Statisk	Lista	Sysselsättningsstatus för den primära sökanden.
Primära inkomster	Statisk	9(11).99	Den primära låntagarens ingångna årliga bruttoinkomst (utom hyror). Ska avrundas till närmaste 1 000 enheter.
Valuta för primära inkomster	Statisk	Lista	Beteckning av inkomstvalutan.
Inkomstverifiering för primära inkomster	Statisk	Lista	Inkomstverifiering för primära inkomster.
Geografisk region	Statisk	Lista	Regionen där låntagaren är bosatt.
Ursprungsdatum	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för förskott på ursprungligt lån.

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Lånets förväntade löptid	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Förväntat datum för lånets förfallotid.
Ursprungliga lånevillkor	Statisk	Numerisk	Ursprungliga avtalsvillkor (antal månader).
Datum för tillägg till poolen	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då lånet överfördes till SPV.
Ursprunglig kapitalbalans	Statisk	9(11).99	Det ursprungliga lånets kapitalbalans (inklusive kapitaliserade avgifter) vid originering.
Aktuellt utestående kapitalsaldo	Dynamisk	9(11).99	Lånets utestående balans för kapitalbeloppet från poolens brytdatum. Uteslut eventuell dröjsmålsränta eller påföljdsbelopp.
Planerad betalningsdag	Dynamisk	9(11).99	Påföljande planerade avtalsenliga betalning som föreligger (betalningen föreligger om inga andra betalningssätt gäller).
Planerad betalningsfrekvens	Dynamisk	Lista	Betalningsfrekvens.
Återbetalningsmetod	Dynamisk	Lista	Typ av återbetalning på kapitalbelopp.
Återställningsintervall för räntesats	Statisk	9(2).99	Antalet månader mellan varje räntesats återställningsdatum.
Aktuell räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Den totala aktuella räntesatsen (%) som gäller för lånet. Inkludera inte symbolen %.
Aktuell räntesatsbas	Dynamisk	Lista	Aktuell räntesatsbas.
Aktuell räntesatsmarginal	Dynamisk	9(4).9(5)	Lånets aktuella räntesatsmarginal (%). För lån med bunden ränta är detta detsamma som nuvarande räntesats.
Antal låntagare	Dynamisk	Numerisk	Antal låntagare på lånet.
Andelen tillåtna förskottsbetalningar	Dynamisk	9(3).99	Den högsta procentandelen av den utestående skulden som tillåts årligen som en förskottsbetalning utan att behöva betala en straffavgift. Inkludera inte symbolen %.
Avgifter för tidig återbetalning	Dynamisk	9(3).99	Procentandel av den utestående skulden som ska betalas som en avgift om förskottsbetalningens gräns har överskridits. Inkludera inte symbolen %.
Kundtyp	Statisk	Lista	Kundtyp vid originering.
Betalningsmetod	Dynamisk	Lista	Normal betalningsmetod (kan baseras på den sist mottagna betalningen).
Datum som det har tagits bort från poolen	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då lånet togs bort från poolen, t.ex. vid återköp, inlösen, förskottsbetalning eller slut på återvinningsprocessen.
Anställd	Statisk	Y/N	Är låntagaren en anställd hos originatorn?

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Övre gräns för räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Om det finns en övre gräns för den räntesats som kan debiteras på detta konto, ange denna övre gräns här.
Lägsta räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Om det finns en lägre gräns för den räntesats som kan debiteras på detta konto, ange denna lägre gräns här.

Resultatinformation

Kvarstående saldo	Dynamisk	9(11).99	Aktuellt saldo för den resterande skulden, vilken definieras som summan av de lägsta avtalsenliga betalningarna som förfallit men är obetalda av låntagaren.
Antal månader i dröjsmål	Dynamisk	9(5).99	Antal dagar som lånet är i dröjsmål från och med poolens brytdatum.
Datum för fallisemang	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för fallisemang.
Obetalt bruttobelopp	Dynamisk	9(11).99	Obetalt bruttobelopp på detta konto.
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	9(11).99	Kumulativa återvinningar på detta konto, minus kostnader.
Inlösningsdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum vid vilket kontot löstes in eller det datum när återvinningsprocessen slutfördes för de obetalda lånen.
Kontostatus	Dynamisk	Lista	Aktuell status för kontot.
Kapitaliserad balans av resterande skuld	Dynamisk	9(11).99	Summan av den kapitaliserade utestående skulden till dagens datum.
Datum för den senaste kapitaliseringen av den utestående skulden	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det senaste datumet som de resterande skulderna kapitaliserades på detta konto.

INFORMATION OM OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
----------	----------------------	---------	-----------------------------------

Information om säkerhet eller obligationer

Rapportdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum som transaktionsrapporten utfärdades, dvs. datumet för inlämning av den ifyllda mallen med uppgifter om lånenivå till dataregistret.
Emittent	Statisk	Text	Namnet på emittenten och emissionsserien, om tillämpligt.
Alla reservkonton på målsaldo	Dynamisk	Y/N	Är alla reservkonton (kontantreserv, blandad reserv, kvittningsreserv etc.) på de erfordrade nivåerna?
Dragningar under likviditetsfacilitet	Dynamisk	Y/N	Har likviditetsfaciliteten använts för att täcka underskott i perioden fram till datumet för den sista räntebetalningen?

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Utlösning av mätningar/ nyckeltal	Dynamisk	Y/N	Har en utlösande händelse inträffat?
Konstant förskottsbetalningstakt på årlig basis	Dynamisk	9(3).99	Den på årsbasis beräknade konstanta förskottsbetalningstakten av underliggande fordringar baserat på den senaste periodiska konstanta förskottsbetalningstakten. Den periodiska konstanta förskottsbetalningstakten är lika med det totala oplanerade kapitalbeloppet som mottagits under den senaste perioden delat med början av periodens kapitalsaldo. Detta upprättas sedan på årsbasis enligt följande: $1 - ((1 - \text{Periodic CPR})^{\text{antal perioder på ett år}})$ Inkludera inte symbolen %.
Totala fordringar som sålts till SPV	Dynamisk	9(11).99	Summan av kapitalbeloppet av fordringar som sålts till SPV (dvs. på balansdagen och under perioden för påfyllning, om tillämpligt) fram till dagens datum.
Kumulativa bruttobelopp i dröjsmål – poolen	Dynamisk	9(11).99	Summan av alla bruttobelopp i dröjsmål sedan avslutande, i valutabelopp.
Kumulativa återvinningar – poolen	Dynamisk	9(11).99	Summan av alla återvinningar i poolen efter avslut, med avdrag för kostnader, i valutabelopp.
Den rullande periodens slutdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då transaktionens rullandeperiod förväntas avslutas, eller faktiskt avslutades.

Transaktionsrapportens kontaktinformation

Referenskontakt	Statisk	Text/numerisk	Namnet på avdelningen eller informationskällornas referensperson(er).
Kontaktinformation	Statisk	Text/numerisk	Telefonnummer och e-postadress.

OBLIGATIONSINFORMATION EFTER TRANCH:

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Information om tranchnivå			
Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) ges till en tranch av obligationer som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, dvs. serie 1, klass A1a etc.
ID-nummer för internationella värdepapper	Statisk	Text/numerisk	Den internationella säkerhetskoden eller -koderna, eller vid avsaknad av Isin, i sådant fall alla andra unika koder för värdepapper, såsom en Cusipkod, som har tilldelats denna tranch genom en börs eller annan enhet. Om mer än en kod förekommer, avgränsa med komma.
Datum för betalning av ränta	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första datum som infaller, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket ränteutbetalningar har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.

Fältnamn	Statisk/ dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Datum för betalning på kapitalbeloppet	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket utbetalningar på kapitalbeloppet har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Valuta för obligationer	Statisk	Lista	Valuta som tranchen är denominerad i.
Referensränta	Statisk	Lista	Ränteindexets basreferens som anges i prospektet för denna specifika tranch.
Laglig inlösendag	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum vid vilket denna särskilda tranch måste återbetalas helt för att inte fallera.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum då obligationerna emitterades.
Räntebetalningsfrekvens	Statisk	Lista	Frekvensen med vilken ränta förfaller till betalning på denna tranch.

BILAGA VI

Uppgifter om lånenivå – Rapporteringsmall för strukturerade finansiella instrument med kreditkortslån som säkerhet

TILLGÅNGAR:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
----------	------------------	---------	-----------------------------------

Transaktionsspecifik information

Poolens brytdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Brytdatum för poolen eller portföljen. Detta är det datum till vilket uppgifterna om den underliggande tillgången i rapporten hänvisar.
Kod för pool	Statisk	Text/numerisk	Poolens eller portföljens kod t.ex. mastere-mittent plc eller SPV 2012-1 plc
Serviceföretagets namn	Statisk	Text/numerisk	Namn på den enhet som sköter kontot.
Reservserviceföretagets namn	Dynamisk	Text/numerisk	Namn på reservserviceföretaget
Säljaren	Statisk	Text/numerisk	Namnet på säljaren.
Typ av transaktion	Statisk	Lista	Fristående, huvudfond – kapitalistisk, huvudfond – socialistiska eller andra.

Information om lånenivå

Konto-ID	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för ett visst konto i poolen. Koden måste krypteras för att kunna garantera dataskydd.
Originator	Statisk	Text/numerisk	Långivare som satte upp kontot. Om okänd, ange säljare.
Låntagarkod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod för en viss låntagare. Den måste krypteras för att kunna garantera dataskydd. Koden kan vara densamma som konto-ID.
Fordringens valutabeteckning	Statisk	Lista	Valuta i vilken en fordran är noterad.
Datum för tillägg till poolen	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum när kontot upptogs i poolen.
Låntagarens sysselsättningsstatus	Statisk	Lista	Sysselsättningsstatus för den primära sökanden.
Valuta för primära inkomster	Statisk	Lista	Beteckning för primär inkomstvaluta.
Inkomstverifiering för primära inkomster	Statisk	Lista	Inkomstverifiering för primära inkomster.
Geografisk region	Dynamisk	Lista	Region där låntagaren är bosatt.
Anställd	Statisk	Y/N	Är låntagaren en anställd hos originatorn eller hos säljaren?
Kontots öppningsdatum	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum då kontot öppnades.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Aktuellt totalt saldo	Dynamisk	9(11).99	Vad är det totala nuvarande beloppet som låntagaren är skyldig (inklusive alla avgifter och ränta) på kontot?
Total kreditgräns	Dynamisk	9(11).99	Vilken är låntagarens kreditgräns på kontot?
Planerad betalningsfrekvens	Dynamisk	Lista	Vilken är den lägsta frekvensen enligt vilken låntagaren är skyldig att göra inbetalningar om de har ett utestående belopp.
Nästa minsta avtalsenliga betalning	Dynamisk	9(11).99	Nästa minsta planerade betalning som ska betalas av låntagaren.
Nuvarande blandade avkastning	Dynamisk	9(3).99	Den totala vägda genomsnittsavkastningen inklusive alla avgifter som tillämpas på det senaste faktureringsdatumet (dvs. detta faktureras, det är inte en kontantavkastning) (%).
Aktuell räntesatsbas	Dynamisk	Lista	Aktuell räntesatsbas.
Kontostatus	Dynamisk	Lista	Aktuell status för kontot.
Kvarstående saldo	Dynamisk	9(11).99	Aktuellt saldo för den resterande skulden, vilken definieras som summan av de lägsta avtalsenliga betalningarna som förfallit men är obetalda av låntagaren.
Kapitaliserad balans av resterande skuld	Dynamisk	9(11).99	Summan av den kapitaliserade utestående skulden till dagens datum.
Datum för den senaste kapitaliseringen av den utestående skulden	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Senaste datum som resterande skulder kapitaliserades på detta kort.
Antal dagar i dröjsmål	Dynamisk	Numerisk	Antal dagar som kontot är i dröjsmål från och med poolens brytdatum.
Betalningsmetod	Dynamisk	Lista	Normal betalningsmetod (kan baseras på den sist mottagna betalningen).
Datum för avskrivning	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för fallisemang.
Ursprunglig avskrivning av belopp	Dynamisk	9(11).99	Det totala saldot på kontot vid det datum då kontot avskrevs.
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	9(11).99	Kumulativa återvinningar – endast relevant för konton som har avskrivits. För konton som inte har avskrivits, ange 0.

INFORMATION OM POOL OCH OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Uppgifter om säkerhetsnivå (ska fyllas i för alla strukturer)			
Bruttoavskrivningar under perioden	Dynamisk	9(11).99	Nominellt värde av bruttoavskrivningarna för kapitalbeloppet (dvs. före återvinningar) för perioden. Avskrivning görs enligt transaktionsdefinition, eller alternativt enligt långivarens normala praxis.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Återvinningar under perioden	Dynamisk	9(11).99	Bruttoåtervinningar som mottagits under perioden.
Förfallen skuld 30–59 dagar %	Dynamisk	9(3).99	Baserat på fordringarnas totala saldo, inte antalet konton (%).
Förfallen skuld 60–89 dagar %	Dynamisk	9(3).99	Baserat på fordringarnas totala saldo, inte antalet konton (%).
Förfallen skuld 90–119 dagar %	Dynamisk	9(3).99	Baserat på fordringarnas totala saldo, inte antalet konton (%).
Förfallen skuld 120–149 dagar %	Dynamisk	9(3).99	Baserat på fordringarnas totala saldo, inte antalet konton (%).
Förfallen skuld 150–179 dagar %	Dynamisk	9(3).99	Baserat på fordringarnas totala saldo, inte antalet konton (%).
Förfallen skuld vid över 180 dagar %	Dynamisk	9(3).99	Baserat på fordringarnas totala saldo, inte antalet konton (%).
Utspädningar	Dynamisk	9(11).99	Reduceringar totalt sett av huvudfordringar under perioden, dvs. inbegripet S75 och återkrav på grund av bedrägeri.
Inkassering av intäkter under perioden	Dynamisk	9(11).99	Inkasseringar som behandlas som intäkter under perioden.
Inkasseringar på kapitalbeloppet under perioden	Dynamisk	9(11).99	Inkasseringar som behandlas som kapitalbelopp under perioden.
En utlösande händelse	Dynamisk	Y/N	Har en utlösande händelse inträffat, som är utestående? T.ex. en utbetalningshändelse, en utlösande händelse baserad på originatorns bedömning, status eller värdet av förfallen skuld, avkastning, utspädningar, fallisemang etc.
SPV storlek – värde	Dynamisk	9(11).99	Nominellt värde av alla fordringar (huvudbelopp och avgifter) där fonden eller SPV har förmånsintresse vid brytdatumet.
SPV storlek – antal konton	Dynamisk	9(11).99	Antalet konton där fonden eller SPV har förmånsintresse vid brytdatumet.
SPV storlek – värde – endast kapitalbelopp	Dynamisk	9(11).99	Nominellt värde av alla fordringar (endast kapitalbelopp) där fonden eller SPV har förmånsintresse vid brytdatumet.
Skuldsaldo	Dynamisk	9(11).99	Nominellt värde av alla skuldbrev med bakomliggande tillgångar, där säkerhet ställts genom fordringarna i fonden eller SPV.
Överlåtarens ränta %	Dynamisk	9(3).99	Den faktiska överlåtarens ränta i fonden, uttryckt i procent.
Överskottsmarginalbelopp	Dynamisk	9(11).99	Det belopp som återstår efter skuldräntan och påfyllning av eventuellt reservkonto.
Rapportdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum då transaktionsrapporten utfärdades.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Information om serienivå (endast för huvudfonder)			
Serienamn	Statisk	Text/numerisk	Namnet på serien, om en del av en masterfond.
Investerarnas ränta för den här serien vid periodens slut %	Dynamisk	9(3).9(5)	Den faktiska investerarens ränta från denna serie i fonden, uttryckt i procent.
Inkomster som avsatts för denna serie	Dynamisk	9(11).99	Intäktsbelopp som avsatts för denna serie från fonden.
Överskottsmarginalbelopp	Dynamisk	9(11).99	Återstående belopp, efter att periodens inkasseringar har tillämpats fullt ut för att täcka emittentens åtaganden enligt inkomstflöden i transaktionsdokumentationen.

Transaktionsrapportens kontaktinformation

Referenskontakt	Statisk	Text/numerisk	Namnet på avdelningen eller informationskällornas referensperson(er).
Kontaktinformation	Statisk	Text/numerisk	Telefonnummer och e-postadress.

OBLIGATIONSINFORMATION INDELAD PER TRANCH:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Information om tranchnivå (endast för denna serie)			
Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) ges till en tranch av obligationer som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, t.ex. serie 2012, klass A1a etc.
ID-nummer för internationella värdepapper	Statisk	Text/numerisk	Den internationella säkerhetskoden eller -koderna, eller vid avsaknad av Isin, i sådant fall alla andra unika koder för värdepapper, såsom en Cusipkod, som har tilldelats denna tranch genom en börs eller annan enhet. Om mer än en kod förekommer, avgränsa med komma.
Datum för betalning av ränta	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket ränteutbetalningar har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Datum för betalning på kapitalbeloppet	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket utbetalningar på kapitalbeloppet har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Valuta för obligationer	Statisk	Lista	Benämningen på denna tranch.
Referensränta	Statisk	Lista	Ränteindexets basreferens som anges i prospektet eller slutvillkoren för denna specifika tranch.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Laglig inlösendag	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum vid vilket denna särskilda tranch måste återbetalas helt för att inte fallera.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Datum som denna obligation emitterades.
Räntebetalningsfrekvens	Statisk	Lista	Frekvensen med vilken ränta förfaller till betalning för denna specifika tranch.
Serienamn	Statisk	Text/numerisk	Namnet på serien, om en del av en masterfond. Om fristående, använd poolens kod.

BILAGA VII

Uppgifter om lånenivå – Rapporteringsmall för strukturerade finansiella instrument med leasingavtal till enskilda personer eller företag som säkerhet

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Transaktionsspecifik information			
Poolens brytdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Brytdatum för poolen eller portföljen. Detta är det datum till vilket uppgifterna om den underliggande tillgången i rapporten hänvisar.
Kod för pool	Statisk	Text/numerisk	Kod för pool eller portfölj/transaktionsnamn.
Serviceföretagets namn	Dynamisk	Text/numerisk	Serviceföretagets namn.
Reservserviceföretagets namn	Dynamisk	Text	Namn på reservserviceföretaget.
Information om leasingnivå			
Leasingkod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod (ID) för varje leasingavtal som ska krypteras för att garantera anonymitet. Leasing-ID bör inte ändras genom transaktionens löptid.
Originator	Statisk	Text	Långivare som förskottrade den ursprungliga leasingen. Där den ursprungliga upphovsmannen inte är känd, till exempel vid fusioner, ska namnet på säljaren anges.
Leasingtagarens kod	Statisk	Text/numerisk	Unik kod (ID) för leasingtagaren som bör vara krypterad (den bör inte visa det riktiga namnet) för att garantera anonymitet – för att kunna identifiera leasingtagare med flera leasingavtal i poolen.
Grupp företags-ID	Dynamisk	Text/numerisk	Unikt grupp företags-ID
Beteckning av leasingvalutan	Statisk	Lista	Beteckning av leasingvalutan.
Land	Statisk	Lista	Land där leasingtagaren är permanent etablerad.
Geografisk region	Statisk	Lista	Regionen där gäldenären befinner sig vid tecknandet.
Leasingtagarens rättsliga form/företagstyp	Statisk	Lista	Leasingtagarens rättsliga form.
Låntagare Basel III Segment	Statisk	Lista	Företag (1).
Dotterbolag till originatorn?	Statisk	Y/N	Är låntagaren ett dotterbolag till originatorn?
Syndikerat?	Statisk	Y/N	Är hyresavtalet syndikerat?

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Bankens interna kreditvärdering	Dynamisk	99(3).99	Bankens interna sannolikhet för fallisemang under 1 år.
Gäldenärens senaste interna värderingsgranskning	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för gäldenärens senaste interna granskning som det refereras till i "Bankens interna kreditvärdering".
Uppskattning av bankens interna förlust med tanke på fallisemang (LGD)	Dynamisk	9(3).99	Underskott med tanke på fallisemang i normala ekonomiska förhållanden. Inkludera inte symbolen %.
Nace branschkod	Statisk	Text/numerisk	Låntagarens Nace-branschkod.
Subventionerad	Dynamisk	Y/N	Är hyresavtalet subventionerat (såvitt du vet)?
Datum som det har tagits bort från poolen	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum då leasingen togs bort från poolen, t.ex. vid återköp, utgång av leasingperiod, förskottsbetalning eller slut på återvinningsprocessen.

Leasingfunktioner

Leasingavtalets ursprungsdatum	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för leasingavtalets originering.
Datum då leasingavtalet löper ut	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Leasingavtalets förväntade utgångsdatum.
Datum för tillägg till poolen	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då leasingavtalet överfördes till SPV. För alla leasingavtal i poolen vid tidpunkten för poolens brytdatum.
Leasingperiod	Statisk	99(4).99	Ursprungliga avtalsvillkor (antal månader).
Ursprunglig kapitalbalans	Statisk	9(11).99	Ursprunglig (eller diskonterad) kapitalbalans för leasingkontot (inklusive kapitaliserade avgifter) vid originering.
Aktuellt utestående kapitalsaldo	Dynamisk	9(11).99	Kapitalbalans (eller diskonterad balans) för leasingavtalet som är utestående vid poolens brytdatum, inklusive eventuella belopp som har lagts till leasingavtalets balans och är en del av kapitalbeloppet i transaktionen.
Värdepapperiserat restvärde	Statisk	9(11).99	Restvärdesbelopp som endast har värdepapperiserats.
Återbetalningsmetod	Statisk	Lista	Typ av återbetalning på kapitalbelopp.
Betalningsfrekvens för kapitalbelopp	Statisk	Lista	Frekvensen av betalningar för kapitalbelopp som föreligger, dvs. antalet månader mellan betalningarna.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Räntebetalningsfrekvens	Statisk	Lista	Frekvensen av räntebetalningar som föreligger, dvs. antalet månader mellan betalningarna.
Föreskriven betalning	Dynamisk	9(11).99	Påföljande periodiska avtalsenliga betalning som föreligger (betalningen föreligger om inga andra betalningssätt gäller).
Alternativ till uppköpspris	Statisk	9(11).99	Det belopp som leasingtagaren har att betala i slutet av leasingperioden för att ta över ägande av tillgången, annat än betalningen som avses i fältet "Värdepapperiserade restvärde".
Insatsbelopp	Statisk	9(11).99	Deponerings-/insatsbelopp på hyresavtalets originering (detta bör inbegripa värdet för inbytt utrustning osv.).
Amorteringstyp	Dynamisk	Lista	Amorteringstyp.
Betalningsmetod	Dynamisk	Lista	Normal betalningsmetod (kan baseras på den sist mottagna betalningen).
Produkttyp	Statisk	Lista	Klassificeringen av leasingavtalet, enligt leasinggivarens definitioner.
Uppdaterat restvärde för tillgångar	Dynamisk	9(11).99	Senaste prognos för tillgångens restvärde vid slutet av leasingperioden. Svar får avrundas.
Datum för uppdaterad restvärdering av tillgång	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum då den senaste uppdaterade uppskattningen av tillgångens restvärde beräknades.

Räntesats

Återställningsintervall för räntesats	Statisk	9(2).99	Antalet månader mellan varje räntesats återställningsdatum.
Aktuell ränta eller diskonteringsränta	Dynamisk	9(4).9(5)	Total aktuell räntesats (%) eller diskonteringsränta som gäller för leasingavtalet.
Aktuell räntesatsbas	Dynamisk	Lista	Aktuell räntesatsbas.
Aktuell räntesatsmarginal	Dynamisk	9(4).9(5)	Leasingavtalets aktuella räntesatsmarginal
Diskonteringsränta	Statisk	9(4).9(5)	Diskonteringsräntan tillämpades på fordran när den såldes till SPV.
Övre gräns för räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Om det finns en övre gräns för den räntesats som kan debiteras på detta konto, ange denna övre gräns här.
Lägsta räntesats	Dynamisk	9(4).9(8)	Om det finns en lägsta gräns för den räntesats som kan debiteras på detta konto, ange denna lägre gräns här.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Resultatinformation			
Saldo för skuld som förfallit	Dynamisk	9(11).99	Saldo för skuld som förfallit. Skuld som förfallit definieras som det totala antalet föreskrivna betalningar till dagens datum MINUS det totala antalet mottagna betalningar till dagens datum MINUS alla kapitaliserade belopp. Detta bör inte inbegripa eventuella avgifter som tillämpas på kontot.
Antal månader i dröjsmål	Dynamisk	9(5).99	Antalet månader som detta leasingavtal är i efterhand (vid poolens brytdatum) enligt emittentens definition.
Fallisemang eller utestängning på leasingavtalet	Dynamisk	Y/N	Om det har uppstått ett fallisemang eller en uteslutning på leasingavtalet enligt transaktionsdefinitionen eller, alternativt, enligt leasinggivarens normala definition.
Fallisemang eller utestängning på leasingavtalet enligt definitionen Basel III	Dynamisk	Y/N	Om det har uppstått ett fallisemang eller en uteslutning på leasingavtalet enligt definitionen Basel III.
Orsak till fallisemang (definitionen Basel III)	Dynamisk	Lista	Orsak till fallisemang med hjälp av definitionen Basel III.
Datum för fallisemang	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för leasingavtalets fallisemang enligt transaktionens standarddefinitionen eller, alternativt, enligt leasinggivarens normala definition.
Obetalt belopp	Dynamisk	9(11).99	Det totala obetalda beloppet (enligt transaktionens definition eller, alternativt, enligt hyresvärdens normala definition) innan försäljningsintäkter och återvinningar tillämpas.
Kumulativa återvinningar	Dynamisk	9(11).99	Kumulativa återvinningar på detta konto, minus kostnader.
Tilldelade underskott	Dynamisk	9(11).99	De tilldelade förlusterna till dagens datum.
Inlösningsdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum vid vilket kontot löstes in eller det datum när återställningen slutfördes för fallerade leasingavtal.
Datum när förlusten fördelades	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum när förlusten fördelades.
Kontostatus	Dynamisk	Lista	Aktuell status för kontot.
Resterande skuld för 1 månad sedan	Dynamisk	9(11).99	Skuldsaldo (definierat enligt <i>skuldsaldo</i>) för den föregående månaden.
Resterande skuld för 2 månader sedan	Dynamisk	9(11).99	Skuldsaldo (definierat enligt <i>skuldsaldo</i>) för två månader sedan.

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Rättstvist	Dynamisk	Y/N	Flagga för att indikera pågående rättstvist (om kontot har återvunnits och tvisten inte längre är föremål för aktiv process bör detta återställas till N).
Försäljningspriset	Dynamisk	9(11).99	Pris som uppnås vid försäljning av tillgångar vid tvångsförsäljning, i samma valuta som hyresavtalet.
Förlust på försäljning	Dynamisk	9(11).99	Totalt nettounderskott exklusive avgifter, upplupna räntor etc. efter tillämpning av försäljningsinkomster (exklusive avgift för förtida betalning om underställt återvinningar på kapitalbeloppet).
Förlust på restvärdet	Dynamisk	9(11).99	Förlust som uppstår vid inbyte av tillgången på grund av dess restvärde vid inbytet.

Säkerhet

Tillgångens land	Statisk	Lista	Land där tillgången är belägen.
Tillverkaren av tillgången	Statisk	Text	Namnet på tillverkaren.
Tillgångens namn/modell	Statisk	Text	Namnet på tillgången/modellen.
Nytt eller begagnat fordon	Statisk	Lista	Tillgångens skick vid tidpunkten för leasingavtalets originering.
Tillgångens ursprungliga restvärde	Statisk	9(11).99	Det uppskattade restvärdet för tillgången vid tidpunkten för leasingavtalets originering.
Tillgångstyp	Statisk	Lista	Tillgångstyp.
Ursprungligt värderingsbelopp	Statisk	9(11).99	Tillgångens skick vid tidpunkten för leasingavtalets originering.
Ursprunglig värderingstyp	Statisk	Lista	Typ av värdering vid tidpunkten för leasingavtalets originering.
Ursprungligt värderingsdatum	Statisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för tillgångens värdering vid originering.
Uppdaterat värderingsbelopp	Dynamisk	9(11).99	Senaste tillgångens värdering.
Uppdaterad värderingstyp	Dynamisk	Lista	Typ av värdering vid det senaste värderingsdatumet.
Uppdaterat värderingsdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Datum för den senaste tillgångens värdering. Om ingen omvärdering har skett sedan origineringen, ange det ursprungliga värderingsdatumet.

INFORMATION OM OBLIGATIONER:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datotyp	Fält för definition och kriterier
Information om säkerhet eller obligationer			
Rapportdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum som transaktionsrapporten utfärdades, dvs. datumet för inlämning av den ifyllda mallen med uppgifter om lånenivå till dataregistret.
Emittent	Statisk	Text	Namnet på emittenten och emissionsserien, om tillämpligt.
Alla reservkonton på målsaldo	Dynamisk	Y/N	Är alla reservkonton (kontantreserv, blandad reserv, kvittningsreserv etc.) på de erforderade nivåerna?
Dragningar under likviditetsfacilitet	Dynamisk	Y/N	Har likviditetsfaciliteten använts för att täcka underskott i perioden fram till datumet för den sista räntebetalningen?
Utlösning av mätningar/nyckeltal	Dynamisk	Y/N	Har en utlösande händelse inträffat?
Konstant förskottsbetalningstakt på årlig basis	Dynamisk	9(3).99	Den på årsbasis beräknade konstanta förskottsbetalningstakten av underliggande fordringar baserad på den senaste periodiska konstanta förskottsbetalningstakten. Den periodiska konstanta förskottsbetalningstakten är lika med det totala oplanerade kapitalbeloppet som mottagits under den senaste perioden delat med kapitalsaldot vid periodens början.
Totala fordringar som sålts till SPV	Dynamisk	9(11).99	Summan av kapitalbeloppet av fordringar som sålts till SPV (dvs. på balansdagen och under perioden för påfyllning, om tillämpligt) fram till dagens datum.
Kumulativa bruttobelopp i dröjsmål – poolen	Dynamisk	9(11).99	Summan av alla bruttobelopp i dröjsmål sedan avslutande, i valutabelopp.
Kumulativa återvinningar – poolen	Dynamisk	9(11).99	Summan av alla återvinningar sedan avslutande, i valutabelopp.
Den rullande periodens slutdatum	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM	Det datum då den rullande perioden förväntas avslutas, eller faktiskt avslutades.
Transaktionsrapportens kontaktinformation			
Referenskontakt	Statisk	Text/numerisk	Namnet på avdelningen eller informationskällornas referensperson(er).
Kontaktinformation	Statisk	Text/numerisk	Telefonnummer och e-postadress.

OBLIGATIONSINFORMATION EFTER TRANCH:

Fältnamn	Statisk/dynamisk	Datatyp	Fält för definition och kriterier
Information om trachnivå			
Obligationsklassens namn	Statisk	Text/numerisk	Beteckningen (vanligtvis en bokstav och/eller ett nummer) som ges till en tranch av obligationer som uppvisar samma rättigheter, prioriteringar och egenskaper som definieras i prospektet, dvs. serie 1, klass A1a etc.
ID-nummer för internationella värdepapper	Statisk	Text/numerisk	Den internationella säkerhetskoden eller -koderna, eller vid avsaknad av Isin, i sådant fall alla andra unika koder för värdepapper såsom en Cusipkod, som har tilldelats till denna tranch genom en börs eller annan enhet.
Datum för betalning av ränta	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket ränteutbetalningar har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Datum för betalning på kapitalbeloppet	Dynamisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Första förekommande datum, efter att poolens brytdatum har rapporterats, vid vilket utbetalningar på kapitalbeloppet har planerats att fördelas till innehavarna av obligationer i denna tranch.
Valuta för obligationer	Statisk	Lista	Benämningen på denna tranch.
Referensränta	Statisk	Lista	Ränteindexet för basreferens enligt vad som avses i emissionsdokumentet gäller för denna specifika tranch av obligationer.
Laglig inlösendag	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum före vilket denna särskilda tranch måste återbetalas helt för att inte falla.
Emissionsdatum för obligationer	Statisk	ÅÅÅÅ-MM-DD	Det datum då obligationerna emitterades.
Räntebetalningsfrekvens.	Statisk	Lista	Frekvensen med vilken ränta förfaller till betalning på denna tranch.

BILAGA VIII

Rapportering till investerare

Rapporterna till investerarna ska innehålla information om

- a) tillgångsresultat,
 - b) en detaljerad fördelning av kassaflöde,
 - c) en lista över alla utlösande faktorer för transaktionen och deras status,
 - d) en lista över alla motparter som är involverade i en transaktion, deras roll och deras kreditbetyg,
 - e) detaljer angående kontanter som tillskjuts transaktionen av originatorn/sponsorn eller eventuellt annat stöd som ges till transaktionen, inklusive dragningar under eller utnyttjande av eventuella likviditeter eller kreditstöd och stöd som tillhandahålls av en tredje part,
 - f) belopp stående som kredit för investeringsgarantier och andra bankkonton,
 - g) detaljerad information angående eventuella swappar (t.ex. priser, betalningar och teoretiska belopp) och andra riskgarderingar i transaktionen, inklusive alla tillhörande poster angående säkerheter,
 - h) definitioner av nyckelbegrepp (som förfallen skuld, fallisemang och förskottsbetalningar),
 - i) LEI, Isin och andra ID-koder som avser säkerheter eller enheter tillhörande emittenten och de strukturerade instrumenten,
 - j) kontaktppgifter för den enhet som avfattar investerarrapporten.
-