

KOMMISSIONENS DELEGERADE FÖRORDNING (EU) 2020/1226**av den 12 november 2019****om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 med fastställande av tekniska tillsynsstandarder för att specificera den information som ska lämnas i enlighet med kraven för STS-anmälän****(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 (EU) 2017/2402 av den 12 december 2017 om ett allmänt ramverk för värdepapperisering och om inrättande av ett särskilt ramverk för enkel, transparent och standardiserad värdepapperisering samt om ändring av direktiven 2009/65/EG, 2009/138/EG och 2011/61/EU och förordningarna (EG) nr 1060/2009 och (EU) nr 648/2012 ⁽¹⁾, särskilt artikel 27.6, och

av följande skäl:

- (1) Enligt förordning (EU) 2017/2402 ska originatorer och medverkande institut lämna viss information till Europeiska värdepappers- och marknadsmyndigheten (Esma) om de anser att en värdepapperisering uppfyller kraven enligt STS-kriterierna (enkel, transparent och standardiserad värdepapperisering) i artiklarna 19–22 och artiklarna 23–26 i den förordningen. Den information som ska lämnas varierar beroende på vilka olika typer av värdepapperiseringar som anmäls.
- (2) För att göra det möjligt för behöriga myndigheter att utföra sina uppgifter och för investerare och potentiella investerare att utföra sin due diligence-kontroll, är det nödvändigt att det finns tillräckligt detaljerad information som är relevant för STS-anmälan för att avgöra om STS-kriterierna är uppfyllda. Särskilt bör en motivering som förklarar valet av en homogenitetsfaktor och uteslutandet av andra ingå i anmälan som grund för bedömningen av homogenitetskriteriet. För vissa STS-kriterier räcker det med endast en bekräftelse på överensstämmelse med kraven, medan andra kriterier kräver ytterligare information. Det är därför nödvändigt att skilja på de krav där det bara behövs en bekräftelse och de krav där det krävs en kortfattad eller en detaljerad beskrivning.
- (3) Värdepapperiseringar som inte kräver att det upprättas prospekt i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1129 ⁽²⁾ (privata värdepapperiseringar) gör det möjligt för parterna att ingå värdepapperiseringstransaktioner utan att offentliggöra känslig kommersiell information. För STS-anmälningar av sådana värdepapperiseringar är det därför lämpligt att begränsa den information som måste offentliggöras till icke-känslig kommersiell information.
- (4) För att göra tillgången till information avseende STS-kraven smidigare bör originatorer och medverkande institut tillåtas att hänvisa till det relevanta prospekt som upprättats för värdepapperiseringen i enlighet med förordning (EU) 2017/1129, annan relevant underliggande dokumentation enligt artikel 7.1 b i förordning (EU) 2017/2402 eller varje annat dokument med information som är relevant för STS-anmälan.
- (5) Denna förordning grundar sig på det förslag till tekniska tillsynsstandarder som Esma har överlämnat till kommissionen.
- (6) Esma har genomfört öppna offentliga samråd om det förslag till tekniska tillsynsstandarder som denna förordning grundas på, analyserat möjliga relaterade kostnader och fördelar samt begärt in ett yttrande från den intressentgrupp för värdepapper och marknader som inrättats i enlighet med artikel 37 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 1095/2010 ⁽³⁾.

⁽¹⁾ EUT L 347, 28.12.2017, s. 35.

⁽²⁾ Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1129 av den 14 juni 2017 om prospekt som ska offentliggöras när värdepapper erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel på en reglerad marknad, och om upphävande av direktiv 2003/71/EG (EUT L 168, 30.6.2017, s. 12).

⁽³⁾ 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. 4).

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Information som ska ingå i STS-anmälan

1. Den information som ska ingå i STS-anmälan enligt artikel 27 i förordning (EU) 2017/2402 ska vara följande:
 - a) För värdepapperiseringar som inte är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i bilaga I till denna förordning.
 - b) För värdepapperiseringar som är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i bilaga II till denna förordning.
 - c) För ABCP-program: den information som anges i bilaga III till denna förordning.
2. För värdepapperiseringar där inget prospekt måste upprättas i enlighet med förordning (EU) 2017/1129 ska den information som ska ingå i STS-anmälan enligt punkt 1 åtföljas av följande:
 - a) För värdepapperiseringar som inte är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i fälten STSS9 och STSS10 i bilaga I till denna förordning.
 - b) För värdepapperiseringar som är ABCP-värdepapperiseringar: den information som anges i fälten STSAT9 och STSAT10 i bilaga II till denna förordning.
 - c) För ABCP-program: den information som anges i fält STSAP9 i bilaga III till denna förordning.

Vid tillämpning av artikel 27.1 tredje stycket i förordning (EU) 2017/2402 ska offentliggörandet av STS-anmälan för dessa värdepapperiseringar begränsas till den information som avses i denna punkt.

Artikel 2

Ytterligare information

Om följande dokument innehåller information som är relevant för STS-anmälan får en hänvisning till relevanta delar av dessa dokument lämnas i kolumnen "Ytterligare information" i bilaga I, II eller III till denna förordning; om sådan information ges ska dokumentationen tydligt identifieras:

- a) Prospekt som upprättats i enlighet med förordning (EU) 2017/1129.
- b) All annan underliggande dokumentation enligt artikel 7.1 b i förordning (EU) 2017/2402.
- c) Alla andra dokument med information som är relevant för STS-anmälan.

Artikel 3

Ikraftträdande

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

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

Utfärdad i Bryssel den 12 november 2019.

På kommissionens vägnar
Jean Claude JUNKER
Ordförande

BILAGA I

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artiklarna 19–22 i förordning (EU) 2017/2402 avseende värdepapperisering som inte är ABCP

Allmän information

Fält-nummer	Artikel i förordning (EU) 2017/2402	FÄLTETS BETECKNING	INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾	YTTERLIGARE INFORMATION
STSS0	Artikel 27.1	Första kontaktpunkt	Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten, och namnet på den relevanta behöriga myndigheten	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 ⁽²⁾
STSS1	Ej tillämpligt	Instrumentets identifieringskod	Om tillgängligt, ISIN-kod(er) (internationellt standardnummer för värdepapper) Om det inte finns någon ISIN-kod, ange annat unikt värdepappersnummer som har tilldelats denna värdepapperisering.	Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.
STSS2	Ej tillämpligt	Identifieringskod för juridiska personer (LEI)	Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för originator(er), medverkande institut och, om tillgängligt, ursprunglig(a) långivare.	Punkt 4.2 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS3	Ej tillämpligt	Identifieringskod för anmälan	Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan.	Ej tillämpligt
STSS4	Ej tillämpligt	Unik identifieringskod	Den unika identifieringskod som tilldelats av det rapporterande företaget i enlighet med artikel 11.1 i delegerad förordning (EU) 2020/1224 ⁽³⁾ .	Ej tillämpligt
STSS5	Ej tillämpligt	Identifieringskod för prospektet	Om tillgänglig, den identifieringskod för prospektet som tillhandahålls av den relevanta behöriga myndigheten.	Ej tillämpligt
STSS6	Ej tillämpligt	Värdepapperiseringsregister	Om tillgängligt, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret.	Ej tillämpligt
STSS7	Ej tillämpligt	Värdepapperiseringsbeteckning	Värdepapperiseringens beteckning.	Avsnitt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS8	Artiklarna 18 och 27.3	Etableringsland	Om tillgängligt, etableringsland för originator(er), medverkande institut, specialföretag för värdepapperisering och ursprunglig(a) långivare.	Ej tillämpligt

STSS9	Ej tillämpligt	Klassificering av värdepapperiseringen	Typ av värdepapperisering: — värdepapperisering som inte är ABCP — ABCP-värdepapperisering — ABCP-program	Ej tillämpligt
STSS10	Ej tillämpligt	Klassificering av underliggande exponeringar	Typ av underliggande exponeringar, inklusive 1) bostadslån som antingen har ett eller flera pantbrev på bostadsfastigheter som säkerhet eller som garanteras fullt ut av en sådan godtagbar utfärdare av kreditskydd som avses i artikel 201.1 i förordning (EU) nr 575/2013 och som uppfyller kraven för kreditkvalitetssteg 2 eller högre i enlighet med del tre avdelning II kapitel 2 i den förordningen, 2) kommersiella lån med ett eller flera pantbrev på kommersiella fastigheter som säkerhet, inbegripet kontor eller andra kommersiella lokaler, 3) kreditfaciliteter till privatpersoner för den personens, familjens eller hushålllets konsumtion, 4) kreditfaciliteter, inklusive lån och leasingavtal, som ges till alla typer av företag eller bolag, 5) billån och billeasing, 6) kreditkortsfordringar, 7) kundfordringar, 8) andra underliggande exponeringar som originatorn eller det medverkande institutet på grundval av interna metoder och parametrar anser utgöra en specifik tillgångstyp.	Ej tillämpligt
STSS11	Ej tillämpligt	Emissionsdatum	Om ett prospekt har upprättats i enlighet med förordning (EU) 2017/1129 (*), dagen för godkännande av prospektet. I alla övriga fall, avslutsdag för den senaste transaktionen.	Ej tillämpligt
STSS12	Ej tillämpligt	Datum för anmälan	Dag för anmälan till Esma	Ej tillämpligt
STSS13	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlåtats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten.	Ej tillämpligt

STSS14	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsland.	Ej tillämpligt
STSS15	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet..	Ej tillämpligt
STSS16	Artikel 27.5	STS-status	En motiverad anmälan från originatorn och det medverkande institutet om att värdepapperiseringen inte längre är att anse som STS.	Ej tillämpligt
STSS17	Artikel 27.3	Originatorn (eller den ursprungliga långgivaren) är inte ett kreditinstitut	Angivelse av "ja" eller "nej" gällande huruvida originatorn eller den ursprungliga långgivaren är ett kreditinstitut eller ett värdepappersföretag som är etablerat i unionen.	Ej tillämpligt
STSS18	Artikel 27.3	Bekräftelse avseende kriterierna för kreditgivning	Om svaret i fält STSS17 är "nej", bekräftelse på att originatorns eller den ursprungliga långgivarens kriterier, förfaranden och system för kreditgivning tillämpas i enlighet med artikel 9 i förordning (EU) 2017/2402.	Ej tillämpligt
STSS19	Artikel 27.3	Bekräftelse på att kreditgivningen inte är föremål för tillsyn.	Om svaret i fält STSS17 är "nej", bekräftelse på att kreditgivningen enligt artikel 27.3 a i förordning (EU) 2017/2402 är föremål för tillsyn.	Ej tillämpligt

(¹) Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

(²) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980 av den 14 mars 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1129 vad gäller formatet på, innehållet i och granskningen och godkännandet av de prospekt som ska offentliggöras när värdepapper erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel på en reglerad marknad, och om upphävande av kommissionens förordning (EG) nr 809/2004 (EUT L 166, 21.6.2019, s. 26).

(³) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2020/1224 av den 16 oktober 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 vad gäller tekniska tillsynsstandarder om information och detaljerade uppgifter om en värdepapperisering som ska tillgängliggöras av originatorn, det medverkande institutet och specialföretaget för värdepapperisering (EUT L 289, 3.9.2020, s. 1).

(⁴) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/1129 av den 14 juni 2017 om prospekt som ska offentliggöras när värdepapper erbjuds till allmänheten eller tas upp till handel på en reglerad marknad, och om upphävande av direktiv 2003/71/EG (EUT L 168, 30.6.2017, s. 12).

Specifik information

Fält-nummer	Artikel i förordning (EU) 2017/2402	FÄLTETS BETECKNING	Bekräftelse	Kortfattad beskrivning	Detaljerad beskrivning	INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾	YTTERLIGARE INFORMATION
STSS20	Artikel 20.1	Överföring av de underliggande exponeringarna genom äkta värdepapperisering (true sale) eller överlåtelse		✓		En kortfattad beskrivning av hur överföringen av de underliggande exponeringarna görs genom äkta värdepapperisering eller överföring med samma rättsverkan på ett sätt som är verkställbart mot säljaren eller någon annan tredje part.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS21	Artikel 20.2	Inga stränga clawbackbestämmelser		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida någon av de stränga clawbackbestämmelser som avses i artikel 20.2 a eller b i förordning (EU) 2017/2402 är del i värdepapperiseringen, och angivelse av huruvida bestämmelserna i artikel 20.3 i förordning (EU) 2017/2402 är tillämpliga.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS22	Artikel 20.3	Undantag för clawbackbestämmelser i nationell insolvenslagstiftning	✓			I anslutning till STSS21, om relevant, en bekräftelse av huruvida det inte finns några omständigheter som skulle kunna resultera i clawbackbestämmelser i enlighet med artikel 20.1 och 20.2 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS23	Artikel 20.4	Överföring om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren	✓			Om säljaren inte är den ursprungliga långgivaren, en förklaring som bekräftar att värdepapperiseringen uppfyller kraven i artikel 20.1–20.3 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS24	Artikel 20.5	Överföring som sker genom en överlåtelse och fullgörs i ett senare skede.		✓		Om överföringen av de underliggande exponeringarna sker genom en överlåtelse och fullgörs på ett senare stadium än vid avslutandet av värdepapperiseringen, en kortfattad beskrivning av hur och huruvida fullgörelsen sker åtminstone vid de förutbestämda utlösande händelser för vilka minimikrav anges i artikel 20.5 i förordning (EU) 2017/2402. Om alternativa överföringsmekanismer används, en bekräftelse på att originatorns insolvens inte skulle skada eller hindra specialföretaget för värdepapperisering från att verkställa sina rättigheter.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSS25	Artikel 20.6	Utfästelser och garantier		√		En kortfattad beskrivning av om och hur det finns utfästelser och garantier från säljarens sida om att värdepapperiseringens underliggande exponeringar inte är belastade eller på annat sätt är i ett tillstånd som skulle kunna inverka negativt på möjligheterna att verkställa den äkta värdepapperiseringen eller överlåtelsen eller överföringen med samma rättsverkan.	Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS26	Artikel 20.7	Godtagbarhets-kriterier som inte medger diskretionär aktiv portföljförvaltning av de underliggande exponeringarna.		√		En kortfattad beskrivning av hur — de underliggande exponeringar som överförs från eller överläts av säljaren till specialföretaget för värdepapperisering uppfyller på förhand fastställda, tydliga och dokumenterade godtagbarhetskriterier som inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa exponeringar, — urval och överföring av de underliggande exponeringarna i värdepapperiseringen grundas på tydliga processer som gör det lättare att identifiera vilka exponeringar som väljs ut för eller överförs till värdepapperiseringen, och att de inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa.	Avsnitt 2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.
STSS27	Artikel 20.8	Tillgångarnas homogenitet			√	En detaljerad beskrivning av homogeniteten i gruppen av underliggande exponeringar som ligger bakom värdepapperiseringen. För detta ändamål ska hänvisning göras till Europeiska bankmyndighetens tekniska tillsynsstandarder om homogenitet (kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/1851 (?), och en detaljerad förklaring ska ges för hur vart och ett av de villkor som anges i artikel 1 i den delegerade förordningen är uppfyllda.	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS28	Artikel 20.9	Underliggande exponeringars förpliktelser: ej återvärdepapperisering	√			En bekräftelse på att de underliggande exponeringarna inte omfattar några värdepapperiseringspositioner och att den anmälda värdepapperiseringen därför inte är en återvärdepapperisering.	Punkt 2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSS29	Artikel 20.10	Sunda kreditgivnings-principer		√	En detaljerad beskrivning — av huruvida de underliggande exponeringarna har sitt ursprung i långivarens normala verksamhet och om de tillämpade kreditgivningsprinciperna inte är mindre strikta än de som vid ursprungstidpunkten tillämpades på exponeringar som inte gjordes föremål för värdepapperisering, — av huruvida kreditgivningsprinciperna och alla väsentliga ändringar av tidigare kreditgivningsprinciper utan onödigt dröjsmål har redovisats eller kommer att redovisas fullt ut för potentiella investerare, — om hur, för värdepapperiseringar där de underliggande exponeringarna är bostadslån, gruppen av underliggande tillgångar uppfyller kravet i artikel 20.10 andra stycket i förordning (EU) 2017/2402, — av huruvida bedömningen av låntagarens kreditvärdighet uppfyller kraven i artikel 8 i direktiv 2008/48/EG ⁽³⁾ eller i artikel 18.1–18.4, 18.5 a och 18.6 i direktiv 2014/17/EU ⁽⁴⁾ eller, där så är tillämpligt, likvärdiga krav i tredjeländer.	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS30	Artikel 20.10	Originators/långivares sakkunskap		√	En detaljerad beskrivning av hur originatorn eller den ursprungliga långivaren har sakkunskaper när det gäller att initiera exponeringar som till sin art liknar de exponeringar som värdepapperiseras.	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS31	Artikel 20.11	Överförda underliggande exponeringar utan fallerande exponeringar		√	En detaljerad beskrivning av huruvida — de överförda underliggande exponeringarna vid tidpunkten för urvalet inte omfattar fallerade exponeringar (eller omstrukturerade exponeringar) enligt definitionen i artikel 20.11 i förordning (EU) 2017/2402, — de krav som avses i artikel 20.11 a i och ii i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda, — de krav som avses i artikel 20.11 b i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda,	Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

						— de krav som avses i artikel 20.11 c i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda.	
STSS32	Artikel 20.12	Minst en betalning vid tidpunkten för överföringen	√			En bekräftelse avseende huruvida gäldenärerna vid tidpunkten för överföringen av exponeringarna har gjort minst en betalning. En bekräftelse avseende huruvida undantaget enligt artikel 20.12 i förordning (EU) 2017/2402 är tillämpligt.	Punkterna 3.3 och 3.4.6 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS33	Artikel 20.13	Återbetalning till innehavarna får inte ha strukturerats för att främst vara beroende av försäljningen av tillgångar			√	En detaljerad beskrivning av hur beroende återbetalning till innehavarna av värdepapperiseringspositionen är av försäljning av tillgångar som utgör säkerhet för de underliggande exponeringarna.	Punkt 3.4.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS34	Artikel 21.1	Uppfyllande av kravet på bibehållande av risk		√		En kortfattad beskrivning av huruvida originatorn, det medverkande institutet eller den ursprungliga långivaren för en icke-ABCP-värdepapperisering uppfyller kravet på bibehållande av risk som fastställs i artikel 6 i förordning (EU) 2017/2402. Uppgift om vilken enhet som bibehåller ett väsentligt ekonomiskt intresse netto och vilket alternativ som används för att bibehålla risken: 1) vertikal andel i enlighet med artikel 6.3 a i förordning (EU) 2017/2402 2) säljares andel i enlighet med artikel 6.3 b i förordning (EU) 2017/2402 3) slumpvis utvalda exponeringar som står kvar i balansräkningen i enlighet med artikel 6.3 c i förordning (EU) 2017/2402 4) tranche i första-förlustläge i enlighet med artikel 6.3 d i förordning (EU) 2017/2402 5) exponering i första-förlustläge för varje tillgång i enlighet med artikel 6.3 e i förordning (EU) 2017/2402 6) ej uppfyllda krav på bibehållande av risk enligt artikel 6.3 i förordning (EU) 2017/2402 7) andra alternativ som används	Punkt 3.1 i bilaga 9 och 3.4.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.

STSS35	Artikel 21.2	Riskreducering – ränte- och valutarisker		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida ränte- och valutariskerna minskas på lämpligt sätt och att åtgärder vidtas för att minska sådana risker och bekräftelse på att sådana åtgärder är tillgängliga för investerare.	Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS36	Artikel 21.2	Derivat som köps/säljs av specialföretag för värdepapperisering		✓		En kortfattad angivelse av att specialföretaget för värdepapperisering inte har ingått derivatkontrakt utom i de fall som avses i artikel 21.2 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS37	Artikel 21.2	Derivat baserade på allmänt accepterade normer		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida de säkringsinstrument som används tecknas och dokumenteras i enlighet med allmänt accepterade normer.	Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS38	Artikel 21.3	Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida och hur eventuella referensräntebetalningar för värdepapperiseringens tillgångar och skulder beräknas på grundval av normalt sett tillämpade marknadsräntor eller normalt sett tillämpade sektorsräntor som återspeglar finansieringskostnaderna.	Punkterna 2.2.2 och 2.2.13 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS39	Artikel 21.4	Inget kvarhållande av kontanter efter beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning		✓		En allmän angivelse om att vart och ett av kraven i artikel 21.4 i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllt.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS40	Artikel 21.4	a) Inga kontantbelopp ska kvarhållas	✓			Bekräftelse på att inga kontantbelopp skulle kvarhållas efter ett beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS41	Artikel 21.4	b) Inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet ska överföras till investerarna	✓			Bekräftelse på att inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet av de underliggande exponeringarna överförs till investerarna via sekventiell amortering av värdepapperiseringspositionerna, i enlighet med värdepapperiseringspositionernas prioritet.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSS42	Artikel 21.4	c) Återbetalningen får inte kastas om vad gäller prioritet	✓			Bekräftelse på att återbetalningen av värdepapperiseringspositionerna inte kommer att kastas om vad gäller prioritet.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS43	Artikel 21.4	d) Inga bestämmelser får föreskriva automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde	✓			Bekräftelse på att det inte finns några bestämmelser som föreskriver automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS44	Artikel 21.5	Värdepapperiseringar med en icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar	✓			Bekräftelse på att transaktioner som har en icke-sekventiell prioritetsordning för betalningar inbegriper utlösande faktorer kopplade till resultaten för de underliggande exponeringarna som resulterar i att prioritetsordningen för betalningar återgår till sekventiella betalningar enligt prioritetsordning. Bekräftelse på att sådana utlösande faktorer åtminstone inbegriper försämring av de underliggande exponeringarnas kreditkvalitet till en nivå under ett på förhand fastställt tröskelvärde.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS45	Artikel 21.6	Revolverande värdepapperisering med händelser som utlöser förtida amortering för avslutande av den rullande perioden på grundval av på förhand fastställda utlösande faktorer		✓		En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna i artikel 21.6 a i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen.	Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS46	Artikel 21.6 a	a) försämring av kreditkvaliteten med avseende på de underliggande exponeringarna		✓		En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna i artikel 21.6 a i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen.	Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS47	Artikel 21.6 b	b) förekomst av en insolvensrelaterad händelse med avseende på originatorn eller serviceföretaget		✓		En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna eller de utlösande faktorerna i artikel 21.6 b i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen.	Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSS48	Artikel 21.6 c	c) värdet av de underliggande exponeringar som innehas av specialföretaget för värdepapperisering sjunker under ett på förhand fastställt tröskelvärde		√		En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna eller de utlösande faktorerna i artikel 21.6 c i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen, med användning av korshänvisningar till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentationen där informationen finns.	Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS49	Artikel 21.6 d	d) det har inte kunnat genereras tillräckligt med nya underliggande exponeringar som uppfyller den förutfastställda kreditkvaliteten (utlösande händelse för avslutande av den rullande perioden)		√		En kortfattad beskrivning, i tillämpliga fall, av hur bestämmelserna i artikel 21.6 d i förordning (EU) 2017/2402 återspeglas i transaktionsdokumentationen.	Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS50	Artikel 21.7 a	a) Information om avtalsförpliktelser för serviceföretaget, trustförvaltare och annan tillhandahållare av sidotjänster.	√			Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen anger alla krav enligt artikel 21.7 a i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS51	Artikel 21.7 b	b) Bestämmelser om servicekontinuitet	√			Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen uttryckligen uppfyller alla krav i artikel 21.7 b i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS52	Artikel 21.7 c	Bestämmelser om kontinuitet hos derivatmotparter	√			Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen innehåller all den information som avses i artikel 21.7 c i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS53	Artikel 21.7 c	c) Bestämmelser om kontinuitet hos likviditetstillhandahållare och kontoförande bank	√			Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen innehåller all information enligt artikel 21.7 c i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSS54	Artikel 21.8	Erforderlig sakkunskap hos serviceföretaget, och riktlinjer och adekvata förfaranden och kontroller för riskhantering	✓			✓	Detaljerad beskrivning av hur kraven i artikel 21.8 uppfylls. I beskrivningen ska ingå hänvisningar till riktlinjer och förfaranden som är avsedda att säkerställa att kraven uppfylls.	Punkt 3.4.6 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS55	Artikel 21.9	Klara och entydiga definitioner vad gäller behandlingen av problematiska lån	✓				En bekräftelse på att den underliggande dokumentationen klart och entydigt anger definitioner, korrigerande åtgärder och andra åtgärder avseende de skuldsituationer som anges i artikel 21.9 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS56	Artikel 21.9	Prioritetsordningar för betalningar och utlösande händelser	✓				Bekräftelse på att värdepapperiserings dokumentation fastställer prioritetsordningarna för betalningar och utlösande händelser i enlighet med artikel 21.9 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS57	Artikel 21.10	Snabb lösning av konflikter mellan olika kategorier av investerare och trustförvaltarens skyldigheter	✓				Bekräftelse på att bestämmelserna i artikel 21.10 i förordning (EU) 2017/2402 om snabb konfliktlösning är uppfyllda.	Punkterna 3.4.7 och 3.4.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS58	Artikel 22.1	Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster	✓				Bekräftelse på att de uppgifter som krävs enligt artikel 22.1 i förordning (EU) 2017/2402 finns tillgängliga, med tydlig angivelse av var informationen finns.	Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSS59	Artikel 22.2	Extern kontroll av ett urval av de underliggande exponeringarna	✓				En bekräftelse på att ett urval av de underliggande exponeringarna har varit föremål för extern kontroll av en lämplig och oberoende part innan värdepappen emitteras.	Ej tillämpligt
STSS60	Artikel 22.3	Kassaflödesmodell för skulder tillgänglig för potentiella investerare	✓				Bekräftelse på att en kassaflödesmodell för skulder är tillgänglig för potentiella investerare före prissättningen med tydlig angivelse av var informationen finns. Efter prissättning, bekräftelse på att sådan information har gjorts tillgänglig för potentiella investerare på begäran.	Ej tillämpligt

STSS61	Artikel 22.4	Offentliggörande av miljöprestandan hos underliggande exponeringar i form av bostadslån, billån eller billeasing		√		En kortfattad beskrivning av huruvida informationen om miljöprestanda för tillgångar som finansieras genom bostadslån, eller billån eller billeasing finns tillgänglig i enlighet med artikel 7.1 a i förordning (EU) 2017/2402, och uppgift om var informationen finns.	Ej tillämpligt
STSS62	Artikel 22.5	Originatorns och det medverkande institutets ansvar för efterlevnaden av artikel 7	√			Bekräftelse på att — originatorn och det medverkande institutet följer artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402, — den information som krävs enligt artikel 7.1 a på begäran har gjorts tillgänglig för potentiella investerare före prissättningen, — den information som krävs enligt artikel 7.1 b-d har gjorts tillgänglig före prissättningen, åtminstone i form av ett utkast eller i sin ursprungliga form.	Ej tillämpligt

(¹) Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

(²) Kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/1851 av den 28 maj 2019 om komplettering av Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2017/2402 vad gäller tekniska tillsynsstandarder för homogenitet i de underliggande exponeringarna i värdepapperisering (EUT L 280, 6.11.2019, s. 1)..

(³) Europaparlamentets och rådets direktiv 2008/48/EG av den 23 april 2008 om konsumentkreditavtal och om upphävande av rådets direktiv 87/102/EEG (EUT L 133, 22.5.2008, s. 66).

(⁴) Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/17/EU av den 4 februari 2014 om konsumentkreditavtal som avser bostadsfastighet och om ändring av direktiven 2008/48/EG och 2013/36/EU och förordning (EU) nr 1093/2010 (EUT L 60, 28.2.2014, s. 34).

BILAGA II

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artikel 24 i förordning (EU) 2017/2402 avseende ABCP-värdepapperisering

Allmän information

Fältnummer	Artikel i förordning (EU) 2017/2402	FÄLTETS BETECKNING	INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾	YTTERLIGARE INFORMATION
STSAT0	Artikel 27.1	Första kontaktpunkt	Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten, och namnet på den relevanta behöriga myndigheten	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT1	Ej tillämpligt	Instrumentets identifieringskod	Om tillgängligt, ISIN-kod(er) (internationellt standardnummer för värdepapper) Om det inte finns någon ISIN-kod, anges varje annat unikt nummer värdepapper som har tilldelats denna ABCP-värdepapperisering.	Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.
STSAT2	Ej tillämpligt	Identifieringskod för juridiska personer (LEI)	Om tillgänglig, LEI-kod för originator(er) och/eller medverkande institut.	Punkt 4.2 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT3	Ej tillämpligt	Identifieringskod för anmälan	Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan.	Ej tillämpligt
STSAT4	Ej tillämpligt	Unik identifieringskod	Den unika identifieringskod som tilldelats av det rapporterande företaget till denna ABCP-transaktion i enlighet med artikel 11.2 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.	Ej tillämpligt
STSAT5	Ej tillämpligt	Identifieringskod för prospektet	Om tillgänglig, den identifieringskod för prospektet som tillhandahålls av den relevanta behöriga myndigheten.	Ej tillämpligt
STSAT6	Ej tillämpligt	Värdepapperiseringsregister	Om tillgängligt, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret.	Ej tillämpligt
STSAT7	Ej tillämpligt	Värdepapperiseringsbeteckning	Om tillgängligt, värdepapperiseringens beteckning eller, om sådan inte finns, kodbeteckning och använt namn.	Avsnitt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT8	Artiklarna 18 och 27.3	Etableringsland	Om tillgängligt, etableringsland för originator(er), medverkande institut och specialföretag för värdepapperisering.	Ej tillämpligt
STSAT9	Ej tillämpligt	Klassificering av värdepapperiseringen	Typ av värdepapperisering: — värdepapperisering som inte är ABCP — ABCP-värdepapperisering — ABCP-program	Ej tillämpligt

STSAT10	Ej tillämpligt	Klassificering av underliggande exponeringar	Typ av underliggande exponeringar, inklusive 1. bostadslån som antingen har ett eller flera pantbrev på bostadsfastigheter som säkerhet eller som garanteras fullt ut av en sådan godtagbar utfärdare av kreditskydd som avses i artikel 201.1 i förordning (EU) nr 575/2013 och som uppfyller kraven för kreditkvalitetssteg 2 eller högre i enlighet med del tre avdelning II kapitel 2 i den förordningen, 2. kommersiella lån med ett eller flera pantbrev på kommersiella fastigheter som säkerhet, inbegripet kontor eller andra kommersiella lokaler, 3. kreditfaciliteter till privatpersoner för den personens, familjens eller hushålllets konsumtion, 4. kreditfaciliteter, inklusive lån och leasingavtal, som ges till alla typer av företag eller bolag, 5. billån och billeasing, 6. kreditkortsfordringar, 7. kundfordringar, 8. andra underliggande exponeringar som originatorn eller det medverkande institutet på grundval av interna metoder och parametrar anser utgöra en specifik tillgångstyp.	Ej tillämpligt
STSAT11	Ej tillämpligt	Emissionsdatum	Om ett prospekt har upprättats i enlighet med förordning (EU) 2017/1129, dagen för godkännande av prospektet. Om inte, emissionsdag för ABCP-värdepapperiseringen.	Ej tillämpligt
STSAT12	Ej tillämpligt	Datum för anmälan	Dag för anmälan till Esma	Ej tillämpligt
STSAT13	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten.	Ej tillämpligt
STSAT14	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsland.	Ej tillämpligt

STSAT15	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i värdepapperiseringsförordningen, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet..	Ej tillämpligt
STSAT16	Artikel 27.5	STS-status	Om originatorn och/eller det medverkande institutet har anmält att ABCP-värdepapperiseringen inte längre är att anse som STS och skälen till detta.	Ej tillämpligt
STSAT17	Artikel 27.3	Originatorn (eller den ursprungliga långgivaren) är inte ett kreditinstitut	Angivelse av "ja" eller "nej" gällande huruvida originatorn eller den ursprungliga långgivaren är ett kreditinstitut eller ett värdepappersföretag som är etablerat i unionen.	Ej tillämpligt
STSAT18	Artikel 27.3	Bekräftelse avseende kriterierna för kreditgivning	Om svaret i fält STSS17 är "nej", bekräftelse på att originatorns eller den ursprungliga långgivarens kriterier, förfaranden och system för kreditgivning tillämpas i enlighet med artikel 9 i förordning (EU) 2017/2402.	Ej tillämpligt
STSAT19	Artikel 27.3	Bekräftelse på att kreditgivningen inte är föremål för tillsyn.	Om svaret i fält STSS17 är "nej", bekräftelse på att kreditgivningen enligt artikel 27.3 a i förordning (EU) 2017/2402 är föremål för tillsyn.	Ej tillämpligt

(¹) Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

Specifik information

Fältnummer	Artikel i förordning (EU) 2017/2402	FÄLTETS BETECKNING	Bekräftelse	Kortfattad beskrivning	Detaljerad beskrivning	INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (¹)	YTTERLIGARE INFORMATION
STSAT20	Artikel 24.1	Underliggande exponeringar som förvärvats genom äkta värdepapperisering (true sale)		✓		En kortfattad beskrivning av hur överföringen av de underliggande exponeringarna görs genom äkta värdepapperisering eller överföring med samma rättsverkan på ett sätt som är verkställbart mot säljaren eller någon annan tredje part.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT21	Artikel 24.2	Inga stränga clawback-bestämmelser		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida någon av de stränga clawbackbestämmelser som avses i artikel 24.2 a eller b i förordning (EU) 2017/2402 är del i värdepapperiseringen, och huruvida bestämmelserna i artikel 24.3 i förordning (EU) 2017/2402 är tillämpliga.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSAT22	Artikel 24.3	Undantag för clawback-bestämmelser i nationell insolvenslagstiftning	√			I anslutning till STSS21, om relevant, en bekräftelse på att det inte finns några omständigheter som skulle kunna resultera i clawbackbestämmelser i enlighet med artikel 24.1 och 24.2 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT23	Artikel 24.4	Överföring om säljaren inte är den ursprungliga långivaren	√			Om säljaren inte är den ursprungliga långivaren, en förklaring som bekräftar att värdepapperiseringen uppfyller kraven i artikel 24.1–24.3 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT24	Artikel 24.5	Överföring som sker genom en överlåtelse och fullgörs i ett senare skede.		√		Om överföringen av de underliggande exponeringarna sker genom en överlåtelse och fullgörs på ett senare stadium än vid avslutandet av värdepapperiseringen, en kortfattad beskrivning av hur och huruvida fullgörelsen sker åtminstone vid de förutbestämda utlösande händelser för vilka minimikrav anges i artikel 24.5 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT25	Artikel 24.6	Utfästelser och garantier		√		En kortfattad beskrivning av om det finns utfästelser och garantier från säljarens sida om att värdepapperiseringens tillgångar inte är belastade eller på annat sätt är i ett tillstånd som skulle kunna inverka negativt på möjligheterna att verkställa den äkta värdepapperiseringen eller överlåtelsen eller överföringen med samma rättsverkan.	Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT26	Artikel 24.7	Godtagbarhetskriterier som inte medger diskretionär aktiv portföljförvaltning av de underliggande exponeringarna.		√		En kortfattad beskrivning av om — de underliggande exponeringar som överförs från eller överläts av säljaren till specialföretaget för värdepapperisering uppfyller på förhand fastställda, tydliga och dokumenterade godtagbarhetskriterier som inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa exponeringar, — urval och överföring av de underliggande exponeringarna i värdepapperiseringen grundas på tydliga processer som gör det lättare att identifiera vilka exponeringar som väljs ut för eller överförs till värdepapperiseringen, och att de inte medger en diskretionär aktiv portföljförvaltning av dessa.	Avsnitt 2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.

STSAT27	Arti- kel 24.8	Ej återvärde-pap- perisering	√			Bekräftelse på att de underliggande exponeringarna inte omfattar några värdepapperiseringspositioner och att den anmälda värdepapperiseringen därför inte är en återvärdepapperisering.	Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT28	Arti- kel 24.9	Överförda under- liggande expo- neringar utan fal- lerade exponer- ingar			√	En detaljerad beskrivning av hur de överförda underliggande exponeringarna vid tidpunkten för urvalet inte omfattar fallerade exponeringar eller omstrukturerade exponeringar enligt vad som anges i artikel 24.9 i förordning (EU) 2017/2402, beroende på vad som är tillämpligt. Om relevant, en tydlig angivelse av huruvida värdepapperiseringen berörs av nedsatt kreditvärdighet vid tidpunkten för värdepapperiseringen enligt vad som anges i artikel 24.9 a i i förordning (EU) 2017/2402. Bekräftelse på att — de krav som avses i artikel 24.9 b i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda vid ursprungstidpunkten, — de krav som avses i artikel 24.9 c i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda vid urvalstidpunkten.	Punkt 2.2.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT29	Arti- kel 24.10	Minst en betal- ning vid tidpunk- ten för överför- ingen	√			Bekräftelse avseende huruvida gäldenärerna vid tidpunkten för överföringen av exponeringarna har gjort minst en betalning. Om ingen betalning har gjorts, en förklaring till detta tillsammans med en angivelse av om skälet är ett av de undantag som tillåts enligt artikel 20.12 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkterna 3.3 och 3.4.6 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT30	Arti- kel 24.11	Återbetalning till innehavarna får inte ha strukture- rats för att främst vara beroende av försäljningen av tillgångar			√	En detaljerad beskrivning av hur beroende återbetalning till innehavarna av värdepapperiseringspositionen är av försäljning av tillgångar som utgör säkerhet för de underliggande exponeringarna. Om relevant, en detaljerad beskrivning av huruvida återbetalning till investerarna inte anses vara beroende av försäljningen av tillgångar i enlighet med artikel 24.11 andra stycket i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.4.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

STSAT31	Artikel 24.12	Riskreducering – ränte- och valutarisker		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida och hur ränte- och valutarisker minskas på lämpligt sätt och bekräftelse på att åtgärderna offentliggörs. En kortfattad beskrivning av huruvida de säkringsinstrument som används tecknas och dokumenteras i enlighet med allmänt accepterade normer.	Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT32	Artikel 24.12	Derivat som köps/säljs av specialföretag för värdepapperisering		✓		Med undantag för syftet att säkra ränte- eller valutarisk, en kortfattad beskrivning av huruvida specialföretaget för värdepapperisering inte har ingått derivatkontrakt.	Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT33	Artikel 24.12	Derivat i underliggande exponeringar		✓		En kortfattad beskrivning av förekomsten av derivat i gruppen av underliggande exponeringar.	Punkterna 3.4.2 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT34	Artikel 24.12	Derivat baserade på allmänt accepterade normer		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida derivat som är tillåtna enligt artikel 24.12 tecknas och dokumenteras i enlighet med allmänt accepterade normer i den internationella finansvärlden.	Punkterna 3.4.7 och 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT35	Artikel 24.13	Klara och entydiga definitioner vad gäller behandlingen av problematiska lån	✓			En bekräftelse på att den underliggande dokumentationen klart och entydigt anger definitioner, korrigerande åtgärder och andra åtgärder avseende de skuldsituationer som anges i artikel 24.13 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT36	Artikel 24.13	Prioritetsordningar för betalningar och utlösande händelser	✓			Bekräftelse på att transaktionsdokumentationen fastställer prioritetsordningarna för betalningar och utlösande händelser i enlighet med artikel 24.13 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkterna 3.4.7 och 3.4.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT37	Artikel 24.14	Uppgifter om historik vad gäller fallissemang och förluster	✓			Bekräftelse på att de uppgifter som krävs enligt artikel 24.14 i förordning (EU) 2017/2402 finns tillgängliga, med tydlig angivelse av var informationen finns tillgänglig för potentiella investerare före prissättningen. I de fall där det medverkande institutet inte har tillgång till sådana uppgifter, en bekräftelse på att säljaren har gett tillgång till uppgifter enligt vad som anges i artikel 24.14 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

						Bekräftelse på att uppgifterna finns tillgängliga och tydligt angivelse av var informationen finns tillgänglig och att uppgifterna täcker en period på minst fem år, med undantag för uppgifter om kundfordringar och andra kortfristiga fordringar, för vilka historiken ska omfatta minst tre år.	
STSAT38	Artikel 24.15	Tillgångarnas homogenitet			√	En detaljerad beskrivning av hur värdepapperiseringen baseras på en grupp av underliggande exponeringar som är homogena med beaktande av kännetecknen för olika tillgångstypers kassaflöden, inbegripet kännetecknen med avseende på avtal, kreditrisk och förskottsbetalning.	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT39	Artikel 24.15	Underliggande exponeringars förpliktelser	√			Bekräftelse på att gruppen av underliggande exponeringar har en återstående vägd genomsnittlig livslängd på högst ett år och att ingen av de underliggande exponeringarna har en återstående löptid på mer än tre år. Bekräftelse av huruvida undantaget för grupper av billån, billeasing eller transaktioner avseende leasing av utrustning tillämpas, i enlighet med artikel 24.15 tredje stycket i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT40	Artikel 24.15	Underliggande exponeringars förpliktelser	√			Om relevant, bekräftelse på att de underliggande exponeringarna — inte omfattar lån som har bostadslån eller lån på kommersiella fastigheter som säkerhet eller bostadslån som garanteras fullt ut enligt artikel 129.1 första stycket i förordning (EU) nr 575/2013 (?), — innehåller avtalsmässigt bindande och verkställbara förpliktelser med full regressrätt mot gäldenären med fastställda betalningsflöden som hänför sig till hyra, kapitalbelopp och räntebetalningar eller till någon annan rätt till inkomst från tillgångar som berättigar till sådana betalningar,	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

						— inte omfattar överlåtbara värdepapper enligt definitionen i artikel 4.1.44 i direktiv 2014/65/EU ⁽³⁾ , med undantag av företagsobligationer som inte är noterade på en handelsplats.	
STSAT41	Artikel 24.16	Referensräntebetalningar baserade på normalt sett tillämpade räntor		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida och hur eventuella referensräntebetalningar för ABCP-värdepapperiserings tillgångar och skulder beräknas på grundval av normalt sett tillämpade marknadsräntor eller normalt sett tillämpade sektorsräntor som återspeglar finansieringskostnaderna.	Punkterna 2.2.2 och 2.2.13 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.
STSAT42	Artikel 24.17	Inget kvarhållande av kontanter efter beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning		✓		En kortfattad beskrivning av huruvida vart och ett av kraven i artikel 24.17 i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllt, inbegripet en kortfattad förklaring av situationer då kontantbelopp kan kvarhållas.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT43	Artikel 24.17	a) Inget kvarhållande av kontanter efter verkställighet eller påskyndad betalning	✓			Bekräftelse på att inga kontantbelopp skulle kvarhållas efter ett beslut om verkställighet eller meddelande om påskyndad betalning.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT44	Artikel 24.17	b) Inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet ska överföras till investerarna	✓			Bekräftelse på att inkomster som kan hänföras till kapitalbeloppet av de underliggande exponeringarna överförs till investerarna via sekventiell amortering av värdepapperiseringspositionerna, i enlighet med värdepapperiseringspositionernas prioritet.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT45	Artikel 24.17	c) Inga bestämmelser får föreskriva automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde	✓			Bekräftelse på att det inte finns några bestämmelser som föreskriver automatisk likvidation av de underliggande exponeringarna till marknadsvärde.	Punkt 3.4.5 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT46	Artikel 24.18	Sunda kreditgivningsprinciper			✓	Bekräftelse av huruvida de underliggande exponeringarna har sitt ursprung i säljarens normala verksamhet, med angivelse av huruvida kreditgivningsprinciperna inte är mindre strikta än de som tillämpades på exponeringar som inte gjordes föremål för värdepapperisering,	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

						En detaljerad beskrivning av huruvida alla väsentliga ändringar av tidigare kreditgivningsprinciper utan onödigt dröjsmål har redovisats för det medverkande institutet och andra parter som är direkt exponerade mot ABCP-värdepapperiseringen.	
STSAT47	Artikel 24.18	Säljarens sakkunskap			√	En detaljerad beskrivning av huruvida säljaren har nödvändiga sakkunskaper när det gäller att initiera exponeringar av liknande typ som de som värdepapperiseras.	Punkt 2.2.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT48	Artikel 24.19	Revolverande ABCP-värdepapperisering/utlösande faktor för kreditkvalitet			√	En detaljerad beskrivning av hur bestämmelserna eller de utlösande faktorerna i artikel 24.19 i förordning (EU) 2017/2402 återfinns i värdepapperiseringsdokumentationen.	Punkterna 2.3 och 2.4 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT49	Artikel 24.20	Uppgifter som åligger värdepapperiseringsparter	√			Bekräftelse på att värdepapperiseringsdokumentationen innehåller avtalsförpliktelser, uppgifter och skyldigheter för det medverkande institutet, serviceföretaget och, i förekommande fall, trustförvaltaren och annan tillhandahållare av sidotjänster.	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT50	Artikel 24.20	Bestämmelser om servicekontinuitet	√			Bekräftelse på att värdepapperiseringsdokumentationen innehåller de processer och skyldigheter som krävs för att säkerställa att förvaltningen av exponeringarna inte upphör om serviceföretaget fallerar eller blir insolvent.	Punkt 3.7 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT51	Artikel 24.20	Bestämmelser om kontinuitet hos derivatmotpart och kontoförande bank	√			Bekräftelse på att värdepapperiseringsdokumentationen innehåller bestämmelser som säkerställer att derivatmotparter och kontoförande bank byts ut vid fallissemang, insolvens och i tillämpliga fall vissa andra angivna händelser.	Punkt 3.8 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAT52	Artikel 24.20	Det medverkande institutets kvalitet	√			Bekräftelse på att värdepapperiseringsdokumentationen innehåller bestämmelser om hur det medverkande institutet uppfyller kraven i artikel 25.3 i förordning (EU) 2017/2402.	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980

(¹) Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

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

(³) Europaparlamentets och rådets direktiv 2014/65/EU av den 15 maj 2014 om marknader för finansiella instrument och om ändring av direktiv 2002/92/EG och av direktiv 2011/61/EU (EUT L 173, 12.6.2014, s. 349).

BILAGA III

Information som ska lämnas till Esma i enlighet med artikel 25 och 26 i förordning (EU) 2017/2402 avseende ABCP-program

Allmän information

Fältnummer	Artikel i förordning (EU) 2017/2402	FÄLTETS BETECKNING	INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS ⁽¹⁾	YTTERLIGARE INFORMATION
STSAP0	Artikel 27.1	Första kontaktpunkt	Identifieringskod för juridiska personer (LEI) för den enhet som ska vara den första kontaktpunkten, och namnet på den relevanta behöriga myndigheten	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAP1	Ej tillämpligt	Instrumentets identifieringskod	Om relevant, ISIN-koder (internationellt standardnummer för värdepapper) som tilldelats ABCP-programmen.	Om tillgängligt under punkt 3.1 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980.
STSAP2	Ej tillämpligt	Identifieringskod för juridiska personer (LEI)	Om tillgänglig, LEI-kod för medverkande institut och/eller ABCP-program.	Punkt 4.2 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAP3	Ej tillämpligt	Identifieringskod för anmälan	Vid rapportering av en uppdatering, det unika referensnummer som Esma har tilldelat den tidigare STS-anmälan.	Ej tillämpligt
STSAP4	Ej tillämpligt	Unik identifieringskod	Den unika identifieringskod som tilldelats av det rapporterande företaget till detta ABCP-program i enlighet med artikel 11.1 i delegerad förordning (EU) 2020/1224.	Ej tillämpligt
STSAP5	Ej tillämpligt	Identifieringskod för prospektet	Om tillgänglig, den identifieringskod för prospektet som tillhandahålls av den relevanta behöriga myndigheten.	Ej tillämpligt
STSAP6	Ej tillämpligt	Värdepapperiseringsregister	Om tillgängligt, namnet på det registrerade värdepapperiseringsregistret.	Ej tillämpligt
STSAP7	Ej tillämpligt	Värdepapperiserings beteckning	ABCP-programmets beteckning	Avsnitt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAP8	Artiklarna 18 och 27.3	Etableringsland	Det medverkande institutets etableringsland	Punkt 4.3 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAP9	Ej tillämpligt	Klassificering av värdepapperiseringen	Typ av värdepapperisering (icke-ABCP, ABCP, ABCP-program)	Ej tillämpligt

STSAP10	Ej tillämpligt	Emissionsdag	Datum för den första emissionen av ABCP-programmet	Punkt 4 i bilaga 9 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAP11	Ej tillämpligt	Datum för anmälan	Dag för STS-anmälan till Esma	Ej tillämpligt
STSAP12	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, en förklaring om att uppfyllandet av STS-kriterierna har intygats av den tredje parten.	Ej tillämpligt
STSAP13	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, den tredje partens namn och etableringsort.	Ej tillämpligt
STSAP14	Artikel 27.2	Tredje part med tillstånd	Om en tredje part med tillstånd har anlitats för att utföra STS-kontroll i enlighet med artikel 27.2 i förordning (EU) 2017/2402, namn på den behöriga myndighet som gav tillståndet..	Ej tillämpligt
STSAP15	Artikel 27.5	STS-status	Anmälan från det medverkande institutet att ABCP-programmet inte längre är att anse som STS och skälen till denna ändring.	Ej tillämpligt

(¹) Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.

Fältnummer	Artikel i förordning (EU) 2017/2402	FÄLTETS BETECKNING	Bekräftelse	Kortfattad beskrivning	Detaljerad beskrivning	INNEHÅLL SOM SKA RAPPORTERAS (¹)	YTTERLIGARE INFORMATION
STSAP16	Artikel 25.1	Medverkande institut ska vara ett kreditinstitut under tillsyn	√			Bekräftelse på att det medverkande institutet för programmet är ett kreditinstitut som står under tillsyn, och en länk till en handling som styrker denna status.	Ej tillämpligt
STSAP17	Artikel 25.2	Stöd från det medverkande institutet genom tillhandahållande av likviditetsfaciliteter	√			Bekräftelse på att det medverkande institutet för ABCP-programmet tillhandahåller en likviditetsfacilitet och att det stöder alla värdepapperiseringspositioner i ABCP-programmet, inbegripet en beskrivning av likviditetsfaciliteten och länk till en handling som styrker detta tillhandahållande.	Ej tillämpligt

STSAP18	Artikel 25.3	Uppvisande för kreditinstitutets behöriga myndighet	√			Bekräftelse på att kreditinstitutets roll som medverkande institut inte äventyrar dess solvens och likviditet, och en länk, om tillgänglig, till den handling som styrker att det har visat upp sin ställning för sin behöriga myndighet.	Ej tillämpligt
STSAP19	Artikel 25.4	Det medverkande institutets efterlevnad av kraven på due diligence	√			Bekräftelse på att det medverkande institutet efterlever de krav på due diligence som anges i artikel 5.1 och 5.3 i förordning (EU) 2017/2402, beroende på vad som är tillämpligt. Bekräftelse på att det medverkande institutet har kontrollerat att säljaren har nödvändig förmåga att förvalta lånebetalning och förfaranden för indrivning som uppfyller kraven i artikel 265.2 i p i förordning (EU) nr 575/2013 eller likvärdiga krav i tredjeländer.	Ej tillämpligt
STSAP20	Artikel 25.5	Säljaren – på transaktionsnivå – eller det medverkande institutet – på ABCP-programnivå – ska uppfylla kravet på bibehållande av risk i artikel 6.		√		En kortfattad beskrivning av hur säljaren – på transaktionsnivå – och det medverkande institutet – på ABCP-programnivå – uppfyller kravet på bibehållande av risk i artikel 6 i förordning (EU) 2017/2402 med uppgift om vilket alternativ som används för att behålla risken, inklusive 1) vertikal andel i enlighet med artikel 6.3 a i förordning (EU) 2017/2402, 2) säljares andel i enlighet med artikel 6.3 b i förordning (EU) 2017/2402, 3) slumpvis utvalda exponeringar som står kvar i balansräkningen i enlighet med artikel 6.3 c i förordning (EU) 2017/2402, 4) tranche i första-förlustläge i enlighet med artikel 6.3 d i förordning (EU) 2017/2402, 5) exponering i första-förlustläge för varje tillgång i enlighet med artikel 6.3 e i förordning (EU) 2017/2402, 6) ej uppfyllda krav på bibehållande av risk enligt förordning (EU) 2017/2402, 7) andra.	Punkt 3.4.3 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
STSAP21	Artikel 25.6	Efterlevnad på ABCP-programnivå av artikel 7 (transparenskrav)	√			Bekräftelse på att — det medverkande institutet följer artikel 7 i förordning (EU) 2017/2402, — det medverkande institutet följer artikel 7 på ABCP-programnivå,	Ej tillämpligt

						— det medverkande institutet har, på begäran och före prissättning, gjort följande tillgängligt för potentiella investerare: de samlade uppgifter som krävs i enlighet med artikel 7.1 a första stycket i förordning (EU) 2017/2402 och de uppgifter som krävs i enlighet med artikel 7.1 första stycket b–e, åtminstone i form av ett utkast eller i sin ursprungliga form.	
STSAP22	Artikel 25.7	Utnyttjade av likviditetsfaciliteten, där finansieringsåtagandena för likviditetsfaciliteten inte förnyas av sponsorn	✓			En kortfattad beskrivning från det medverkande institutet av huruvida likviditetsfaciliteten kommer att utnyttjas och värdepapper som förfaller återbetalas om det medverkande institutet inte förnyar finansieringsåtagandet för likviditetsfaciliteten innan det löper ut.	Ej tillämpligt
STSAP23	Artikel 26.1	Efterlevnad av kraven i artikel 24.1–24.8 och 24.12–24.20 för ABCP-värdepapperiseringar inom ramen för ett ABCP-program	✓			Bekräftelse av huruvida alla ABCP-värdepapperiseringar inom programmet uppfyller följande krav: — Artikel 24.1–24.8 i förordning (EU) 2017/2402. — Artikel 24.12–24.20 i förordning (EU) 2017/2402.	Ej tillämpligt
STSAP24	Artikel 26.1 andra och tredje styckena	Högst 5 % av det sammanlagda beloppet för ABCP-värdepapperiseringarnas underliggande exponeringar får tillfälligt vara oförenligt med vissa krav			✓	En detaljerad beskrivning av vilket, om så är fallet, av kraven i artikel 24.9, 24.10 eller 24.11 i förordning (EU) 2017/2402 som tillfälligt inte efterlevs, vilken procentandel av det sammanlagda beloppet av de underliggande exponeringarna för ABCP-värdepapperiseringarna det rör sig om och varför programmet tillfälligt inte efterlever kraven. En bekräftelse på att ett urval av de underliggande exponeringarna har varit föremål för regelbunden extern efterlevnadskontroll av en lämplig och oberoende part.	Ej tillämpligt
STSAP25	Artikel 26.2	Den återstående vägda genomsnittliga livslängden (WAL) för de underliggande exponeringarna för ett ABCP-program ska vara högst två år	✓			Bekräftelse på att den återstående vägda genomsnittliga livslängden för de underliggande exponeringarna för ett ABCP-program är högst två år.	Ej tillämpligt

STSAP26	Artikel 26.3	Fullt stöd till ABCP-program (stöd av medverkande institut)	✓		En kortfattad beskrivning av huruvida ABCP-programmet fullt ut stöds av ett medverkande institut i enlighet med artikel 25.2 i förordning (EU) 2017/2402.	Ej tillämpligt
STSAP27	Artikel 26.4	Ingen återvärdepapperisering och ingen kreditförstärkning som inför ett andra skikt med trancher på ABCP-programnivå	✓		Bekräftelse på att ABCP-programmet inte innehåller någon återvärdepapperisering och att kreditförstärkningen inte inför något andra skikt med trancher på programnivå.	Ej tillämpligt
STSAP28	Artikel 26.5	Inga köpoptioner	✓		En bekräftelse på att ABCP-programmet inte omfattar köpoptioner eller klausuler som påverkar värdepapprens sista förfallodag om det står säljaren, det medverkande institutet eller specialföretaget för värdepapperisering fritt att utnyttja sådana.	Ej tillämpligt
STSAP29	Artikel 26.6	Ränte- och valutarisker på ABCP-programnivå lämpligt minskade och dokumenterade		✓	En detaljerad beskrivning av huruvida och hur de ränte- och valutarisker som finns på ABCP-programnivå minskas på lämpligt sätt och av vilka åtgärder som vidtagits för att minska dessa risker, inklusive om specialföretaget för värdepapperisering ingår derivatkontrakt i andra syften än vad som anges i artikel 26.6 i förordning (EU) 2017/2402, och en beskrivning av hur dessa derivat tecknas och dokumenteras, särskilt huruvida det sker i enlighet med allmänt accepterade normer i den internationella finansvärlden.	Ej tillämpligt
STSAP30	Artikel 26.7 a	Krav på ABCP-programmets dokumentation (trustförvaltarens ansvar gentemot investerarna)	✓		Bekräftelse på att de skyldigheter som trustförvaltaren och andra enheter med förvaltaruppdrag, i förekommande fall, har gentemot investeraren anges i ABCP-programmets dokumentation.	Ej tillämpligt
STSAP31	Artikel 26.7 b	Krav på ABCP-programmets dokumentation (det medverkande institutets avtalsförpliktelser)	✓		Bekräftelse på att avtalsförpliktelser, uppgifter och skyldigheter för det medverkande institutet, trustförvaltaren och andra tillhandahållare av sidotjänster, i förekommande fall, anges i ABCP-programmets dokumentation.	Ej tillämpligt

STSAP32	Artikel 26.7 c	Krav på ABCP-programmets dokumentation (processer och skyldigheter vid serviceföretagets fallissemang)	√		Bekräftelse på att ABCP-programmets dokumentation innehåller processer och skyldigheter om serviceföretaget fallerar eller blir insolvent, för att säkerställa servicekontinuitet.	Ej tillämpligt
STSAP33	Artikel 26.7 d	Krav på ABCP-programmets dokumentation (bestämmelser om utbyte av derivatmotparter och kontoförande bank)	√		Bekräftelse på att kraven enligt artikel 26.7 d i förordning (EU) 2017/2402 är uppfyllda vad gäller bestämmelserna om att derivatmotparter och kontoförande bank på ABCP-programnivå byts ut vid fallissemang, insolvens och vissa andra angivna händelser om likviditetsfaciliteten inte täcker dessa händelser.	Ej tillämpligt
STSAP34	Artikel 26.7 e	Krav på ABCP-programmets dokumentation (förfaranden för att säkerställa säkring av finansieringsåtagandet)	√		Bekräftelse på att ABCP-programmets dokumentation innehåller förfaranden som säkerställer att avhjälpande åtgärder vidtas om vissa angivna händelser inträffar eller om det medverkande institutet fallerar eller blir insolvent, för att på lämpligt sätt antingen säkra finansieringsåtagandet eller ersätta tillhandahållaren av likviditetsfaciliteten. Angivelse av de relevanta sidorna i prospektet eller annan underliggande dokumentation som innehåller information avseende kraven i artikel 26.7 e i förordning (EU) 2017/2402.	Ej tillämpligt
STSAP35	Artikel 26.7 f	Krav på ABCP-programmets dokumentation (likviditetsfacilitet och värdepapper som förfaller ska återbetalas om det medverkande institutet inte förnyar finansieringsåtagandet för likviditetsfaciliteten innan det löper ut)	√		Bekräftelse på att ABCP-programmets dokumentation innehåller bestämmelser som säkerställer att likviditetsfaciliteten ska utnyttjas och värdepapper som förfaller ska återbetalas om det medverkande institutet inte förnyar finansieringsåtagandet för likviditetsfaciliteten innan det löper ut. Angivelse av de relevanta sidorna i prospektet eller annan underliggande dokumentation som innehåller information avseende kraven i artikel 26.7 f i förordning (EU) 2017/2402.	Ej tillämpligt

STSAP36	Artikel 26.8	Serviceföretagets sakkunskap			✓	Detaljerad beskrivning av hur kraven i artikel 26.8 i förordning (EU) 2017/2402 uppfylls, inbegripet hänvisningar till riktlinjer och förfaranden som ska säkerställa att kraven uppfylls. Angivelse av de relevanta sidorna i prospektet eller annan underliggande dokumentation som innehåller tillämpliga beskrivningar för uppfyllandet av kraven i artikel 26.8 i förordning (EU) 2017/2402 (om tillämpligt) (serviceföretagets sakkunskap, riktlinjer, förfaranden och riskhantering).	Punkt 3.2 i bilaga 19 till kommissionens delegerade förordning (EU) 2019/980
---------	--------------	------------------------------	--	--	---	--	--

(¹) Om relevant, hänvisning till relevanta avsnitt i den underliggande dokumentation där informationen finns.