

DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2020/1226 DER KOMMISSION**vom 12. November 2019****zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Spezifizierung der gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung zu übermittelnden Informationen****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 27 Absatz 6,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Nach der Verordnung (EU) 2017/2402 müssen Originatoren und Sponsoren der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) bestimmte Informationen übermitteln, wenn eine Verbriefung aus ihrer Sicht die Anforderungen an eine einfache, transparente und standardisierte („STS-“)Verbriefung, die in den Artikeln 19 bis 22 und 23 bis 26 der genannten Verordnung festgelegt sind, erfüllt. Je nachdem, auf welche Art von Verbriefung sich die Meldung bezieht, sind unterschiedliche Informationen zur Verfügung zu stellen.
- (2) Damit die zuständigen Behörden ihre Aufgaben wahrnehmen und Anleger sowie potenzielle Anleger ihre Prüf- und Sorgfaltspflichten erfüllen können, werden ausreichend detaillierte Informationen, die für die STS-Meldung relevant sind, benötigt, um feststellen zu können, ob die STS-Kriterien erfüllt sind. Für eine fundierte Beurteilung des Homogenitätskriteriums sollte in der Meldung insbesondere auch erläutert werden, warum ein bestimmter Homogenitätsfaktor gewählt und andere Homogenitätsfaktoren ausgeschlossen wurden. Bei einigen STS-Kriterien reicht eine einfache Bestätigung der Erfüllung aus, während andere Kriterien weitere Informationen erfordern. Deshalb ist eine Unterscheidung zu treffen zwischen Anforderungen, bei denen eine einfache Bestätigung ausreicht, und Anforderungen, bei denen eine kurze oder eine ausführliche Erläuterung notwendig ist.
- (3) Verbriefungen, bei denen kein Prospekt gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates⁽²⁾ erstellt werden muss (private Verbriefungen), ermöglichen den Beteiligten den Abschluss von Verbriefungstransaktionen ohne Preisgabe sensibler Geschäftsinformationen. Daher ist es angemessen, die Informationen, die bei STS-Meldungen für solche Verbriefungen zu veröffentlichen sind, auf nicht sensible Geschäftsinformationen zu beschränken.
- (4) Um den Zugang zu den für die STS-Anforderungen relevanten Informationen zu erleichtern, sollte es den Originatoren und Sponsoren gestattet werden, auf den für diese Verbriefung gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 erstellten Prospekt, die sonstige zugehörige Dokumentation im Sinne von Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 oder sonstige Unterlagen, die für die STS-Meldung relevant sind, zu verweisen.
- (5) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der ESMA vorgelegt wurde.
- (6) Die ESMA hat zu den Entwürfen technischer Regulierungsstandards, auf die sich diese Verordnung stützt, öffentliche Konsultationen durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates⁽³⁾ eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

⁽¹⁾ ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

⁽²⁾ Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Juni 2017 über den Prospekt, der beim öffentlichen Angebot von Wertpapieren oder bei deren Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt zu veröffentlichen ist und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/71/EG (ABl. L 168 vom 30.6.2017, S. 12).

⁽³⁾ Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 4).

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Bei der STS-Meldung bereitzustellende Informationen

(1) Bei der STS-Meldung gemäß Artikel 27 der Verordnung (EU) 2017/2402 sind die folgenden Informationen bereitzustellen:

- a) Wenn es sich bei der Verbriefung um eine Nicht-ABCP-Verbriefung handelt, die in Anhang I der vorliegenden Verordnung genannten Informationen;
- b) wenn es sich bei der Verbriefung um eine ABCP-Verbriefung handelt, die in Anhang II der vorliegenden Verordnung genannten Informationen;
- c) bei einem ABCP-Programm die in Anhang III der vorliegenden Verordnung genannten Informationen.

(2) Bei Verbriefungen, für die kein Prospekt gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 erstellt werden muss, ist den bei der STS-Meldung gemäß Absatz 1 bereitzustellenden Informationen Folgendes beizufügen:

- a) Wenn es sich bei der Verbriefung um eine Nicht-ABCP-Verbriefung handelt, die in den Feldern STSS9 und STSS10 des Anhangs I der vorliegenden Verordnung genannten Informationen;
- b) wenn es sich bei der Verbriefung um eine ABCP-Verbriefung handelt, die in den Feldern STSAT9 und STSAT10 des Anhangs II der vorliegenden Verordnung genannten Informationen;
- c) bei einem ABCP-Programm die in Feld STSAP9 des Anhangs III der vorliegenden Verordnung genannten Informationen.

Für die Zwecke des Artikels 27 Absatz 1 Unterabsatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 ist die Veröffentlichung der STS-Meldung für diese Verbriefungen auf die in diesem Absatz genannten Informationen zu beschränken.

Artikel 2

Zusätzliche Informationen

Enthalten die folgenden Unterlagen Informationen, die für die STS-Meldung relevant sind, kann in der Spalte „Zusätzliche Informationen“ der Anhänge I, II oder III der vorliegenden Verordnung ein Verweis auf die relevanten Teile dieser Unterlagen angebracht werden, wobei klar angegeben wird, um welche Art von Dokumentation es sich handelt:

- a) einen gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 erstellten Prospekt;
- b) sonstige zugehörige Dokumentation im Sinne von Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402;
- c) sonstige Unterlagen mit Informationen, die für die STS-Meldung relevant sind.

Artikel 3

Inkrafttreten

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt unmittelbar in jedem Mitgliedstaat.

Brüssel, den 12. November 2019

Für die Kommission
Der Präsident
Jean-Claude JUNCKER

ANHANG I

Der ESMA bei Nicht-ABCP-Verbriefungen gemäß Artikel 19 bis 22 der Verordnung (EU) 2017/2402 zu übermittelnde Informationen

Allgemeine Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	Feldbezeichnung	GEFORDERTER MELDEINHALT ⁽¹⁾	WEITERE ANGABEN
STSS0	Artikel 27 Absatz 1	Erste Anlaufstelle	Rechtsträgerkennung (LEI) der Instanz, die als erste Anlaufstelle benannt wurde, und Name der jeweils zuständigen Behörde	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission ⁽²⁾ .
STSS1	Entfällt	Identifikationsnummer des Finanzinstruments	Falls verfügbar, internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN) bzw. -nummern. Wenn keine ISIN verfügbar ist, jede andere für diese Verbriefung vergebene eindeutige Wertpapier-Kennnummer.	Falls verfügbar, weitere Angaben nach Punkt 3.1 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS2	Entfällt	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI)	LEI des Originators und des Sponsors bzw. der Originatoren und der Sponsoren und, falls verfügbar, des ursprünglichen Kreditgebers/der ursprünglichen Kreditgeber.	Punkt 4.2 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS3	Entfällt	Kennziffer der Meldung	Bei Übermittlung einer Aktualisierung: einmalige Referenznummer, die die ESMA bei der ursprünglichen STS-Meldung vergeben hat.	Entfällt
STSS4	Entfällt	Eindeutige Kennung	Eindeutige Kennung, die von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission ⁽³⁾ zugewiesen wird.	Entfällt
STSS5	Entfällt	Kennziffer des Prospekts	Falls verfügbar, von der jeweils zuständigen Behörde vergebene Kennziffer des Prospekts.	Entfällt
STSS6	Entfällt	Verbriefungsregister	Falls verfügbar, Name des registrierten Verbriefungsregisters.	Entfällt
STSS7	Entfällt	Bezeichnung der Verbriefung	Bezeichnung der Verbriefung.	Punkt 4 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS8	Artikel 18 und Artikel 27 Absatz 3	Sitzland	Falls verfügbar, Land, in dem der/die Originator(en), Sponsor(en), Verbriefungszweckgesellschaft(en) und ursprüngliche(n) Kreditgeber seinen/ihren Sitz hat/haben.	Entfällt

STSS9	Entfällt	Klassifizierung der Verbriefung	Art der Verbriefung: — Nicht ABCP-Verbriefung — ABCP-Verbriefung — ABCP-Programm	Entfällt
STSS10	Entfällt	Klassifizierung der zugrunde liegenden Risikopositionen	Art der zugrunde liegenden Risikopositionen, unter anderem: 1.) Darlehen für Wohnimmobilien, die entweder durch eine oder mehrere Grundpfandrechte auf Wohnimmobilien besichert oder in voller Höhe durch einen Sicherungsgeber garantiert sind, der im Sinne des Artikels 201 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anerkennungsfähig ist und gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 2 der vorgenannten Verordnung der Bonitätsstufe 2 oder darüber angehört; 2.) gewerbliche Darlehen, die durch ein oder mehrere Grundpfandrechte auf Gewerbeimmobilien, insbesondere auch Büro- oder sonstige Gewerbeimmobilien, besichert sind; 3.) Darlehensfazilitäten für natürliche Personen zu Zwecken des persönlichen, Familien- oder Haushaltskonsums; 4.) Darlehensfazilitäten, einschließlich Darlehen und Leasinggeschäfte, für alle Arten von Unternehmen oder Kapitalgesellschaften; 5.) Kfz-Darlehen/Leasing; 6.) Kreditkartenforderungen; 7.) Handelsforderungen; 8.) sonstige zugrunde liegende Risikopositionen, die aus Sicht des Originators oder Sponsors auf Basis interner Methoden und Parameter eine eigene Vermögenswertkategorie darstellen;	Entfällt
STSS11	Entfällt	Ausgabedatum	Wurde ein Prospekt nach Maßgabe der Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates (*) erstellt: Datum, an dem der Prospekt gebilligt wurde. In allen anderen Fällen: Datum, an dem die jüngste Transaktion abgeschlossen wurde.	Entfällt
STSS12	Entfällt	Melddatum	Datum der Meldung an die ESMA.	Entfällt
STSS13	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: eine Erklärung, dass die Erfüllung der STS-Kriterien durch dieses zugelassene Drittunternehmen bestätigt wurde.	Entfällt

STSS14	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name und Sitzland dieses Dritten.	Entfällt
STSS15	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name der zuständigen Behörde, die die Zulassung erteilt hat.	Entfällt
STSS16	Artikel 27 Absatz 5	STS-Status	Mit Gründen versehene Meldung des Originators und des Sponsors, dass die Verbriefung nicht mehr als STS-Verbriefung anzusehen ist.	Entfällt
STSS17	Artikel 27 Absatz 3	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) kein Kreditinstitut	„Ja“ oder „Nein“, je nachdem, ob es sich beim Originator bzw. ursprünglichen Kreditgeber um ein Kreditinstitut oder eine Wertpapierfirma mit Sitz in der Union handelt oder nicht.	Entfällt
STSS18	Artikel 27 Absatz 3	Bestätigung der Kreditvergabekriterien	Bei „Nein“ in Feld STSS17: Bestätigung, dass die Kreditvergabekriterien, -verfahren und -systeme des Originators bzw. ursprünglichen Kreditgebers gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2017/2402 umgesetzt werden.	Entfällt
STSS19	Artikel 27 Absatz 3	Bestätigung, dass die Kreditvergabe beaufsichtigt wird	Bei „Nein“ in Feld STSS17: Bestätigung, dass die Kreditvergabe im Sinne von Artikel 27 Absatz 3 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 beaufsichtigt wird.	Entfällt

(¹) Falls einschlägig, ist auch die betreffende Fundstelle in der Basisdokumentation anzugeben.

(²) Delegierte Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission vom 14. März 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates hinsichtlich der Aufmachung, des Inhalts, der Prüfung und der Billigung des Prospekts, der beim öffentlichen Angebot von Wertpapieren oder bei deren Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt zu veröffentlichen ist, und zur Aufhebung der Verordnung (EG) Nr. 809/2004 der Kommission (ABl. L 166 vom 21.6.2019, S. 26).

(³) Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (ABl. L 289 vom 289, S. 1).

(⁴) Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 14. Juni 2017 über den Prospekt, der beim öffentlichen Angebot von Wertpapieren oder bei deren Zulassung zum Handel an einem geregelten Markt zu veröffentlichen ist, und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/71/EG (ABl. L 168 vom 30.6.2017, S. 12).

Spezifische Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	FELDBEZEICHNUNG	Bestätigung	Kurze Erläuterung	Ausführliche Erläuterung	GEFORDERTER MELDEINHALT (1)	WEITERE ANGABEN
STSS20	Artikel 20 Absatz 1	Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen im Wege einer „True-Sale“-Verbriefung oder einer Abtretung		√		Kurze Erläuterung, wie die Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen durch eine „True-Sale“-Verbriefung oder durch eine Übertragung mit gleicher rechtlicher Wirkung in einer gegenüber dem Verkäufer oder gegenüber Dritten durchsetzbaren Weise erfolgt.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS21	Artikel 20 Absatz 2	Keine schwerwiegende Rückforderung		√		Kurze Erläuterung, ob bei der Verbriefung etwaige schwerwiegende Rückforderungsvereinbarungen im Sinne von Artikel 20 Absatz 2 Buchstabe a oder b der Verordnung (EU) 2017/2402 vorliegen, und Angabe, ob die Bestimmungen in Artikel 20 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 angewandt werden.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS22	Artikel 20 Absatz 3	Ausnahme-regelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht	√			In Verbindung mit STSS21 gegebenenfalls eine Bestätigung, dass keine Umstände vorliegen, die Rückforderungsvereinbarungen nach Artikel 20 Absätze 1 und 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Folge haben könnten.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS23	Artikel 20 Absatz 4	Übertragung, wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist	√			Wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist, eine Bestätigung, dass die Verbriefung mit Artikel 20 Absätze 1 bis 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 konform ist.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS24	Artikel 20 Absatz 5	Übertragung im Wege einer Abtretung, die zu einem späteren Zeitpunkt abgeschlossen wird		√		Wenn die Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen im Wege einer Abtretung erfolgt, die zu einem späteren Zeitpunkt als dem Abschluss der Transaktion abgeschlossen wird: kurze Erläuterung, wie und ob dieser Abschluss zumindest durch die in Artikel 20 Absatz 5 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten auslösenden Ereignisse bewirkt wird. Wenn andere Übertragungsmechanismen genutzt werden: Bestätigung, dass eine Insolvenz des Originators die Durchsetzung der Rechte der Verbriefungszweckgesellschaft nicht berühren oder verhindern würde.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSS25	Artikel 20 Absatz 6	Zusicherungen und Gewährleistungen		√		Kurze Erläuterung, wie und ob der Verkäufer Zusicherungen und Gewährleistungen erbringt, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen, die Gegenstand der Verbriefung sind, nicht anderweitig belastet oder in einem Zustand sind, der die Durchsetzbarkeit der „True-Sale“-Verbriefung oder Abtretung oder Übertragung mit gleicher rechtlicher Wirkung beeinträchtigen könnte.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS26	Artikel 20 Absatz 7	Anerkennungskriterien, die im Hinblick auf die zugrunde liegenden Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten		√		Kurze Erläuterung, wie — die vom Verkäufer auf die Verbriefungszweckgesellschaft übertragenen oder an sie abgetretenen Risikopositionen im Voraus festgelegte, eindeutige und dokumentierte Anerkennungskriterien erfüllen, die im Hinblick auf diese Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten; — die Auswahl und Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen der Verbriefung auf eindeutigen Verfahren beruhen, die die Erkennung der für die Verbriefung ausgewählten oder übertragenen Risikopositionen erleichtern und im Hinblick auf diese Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten.	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS27	Artikel 20 Absatz 8	Homogenität der Vermögenswerte			√	Ausführliche Erläuterung zur Homogenität des Pools zugrunde liegender Risikopositionen, mit dem die Verbriefung unterlegt ist. Hierbei ist auf den RTS der EBA zur Homogenität (Delegierte Verordnung (EU) 2019/1851 der Kommission ⁽²⁾) Bezug zu nehmen und ausführlich zu erläutern, wie jede einzelne Bedingung nach Artikel 1 der genannten delegierten Verordnung erfüllt wird.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS28	Artikel 20 Absatz 9	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen: Keine Wiederverbriefung		√		Bestätigung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen keine Verbriefungspositionen enthalten und es sich bei der gemeldeten Verbriefung somit nicht um eine Wiederverbriefung handelt.	Punkt 2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSS29	Artikel 20 Absatz 10	Solide Vergabe- standards		√	<p>Ausführliche-Erläuterung,</p> <ul style="list-style-type: none"> — ob die zugrunde liegenden Risikopositionen im ordentlichen Geschäftsgang des Kreditgebers originiert wurden und ob die angewandten Vergabestandards nicht weniger streng waren als die zum Zeitpunkt der Originierung verwendeten Standards für die Originierung nicht verbriefter Risikopositionen; — ob die Vergabestandards und wesentliche Änderungen gegenüber früheren Vergabestandards potenziellen Anlegern unverzüglich in vollem Umfang offengelegt wurden bzw. werden; — wie bei Verbriefungen, bei denen die zugrunde liegenden Risikopositionen Darlehen für Wohnimmobilien sind, der Pool der zugrunde liegenden Risikopositionen die Anforderung des Artikels 20 Absatz 10 Unterabsatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt; — ob die Prüfung der Kreditwürdigkeit des Kredit- bzw. Darlehensnehmers die Anforderungen des Artikels 8 der Richtlinie 2008/48/EG des Europäischen Parlaments und des Rates ^(?) oder die Anforderungen des Artikels 18 Absätze 1 bis 4, Absatz 5 Buchstabe a und Absatz 6 der Richtlinie 2014/17/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ^(*) oder gegebenenfalls entsprechende Anforderungen in Drittländern erfüllt. 	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS30	Artikel 20 Absatz 10	Erfahrung des Originators/Kre- ditgebers		√	<p>Ausführliche Erläuterung dazu, ob der Originator bzw. der ursprüngliche Kreditgeber über Erfahrung mit der Originierung von Risikopositionen, die den verbrieften Risikopositionen ähneln, verfügt.</p>	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS31	Artikel 20 Absatz 11	Übertragene zug- runde liegende Risikopositionen, die keine ausge- fallenen Risikopo- sitionen enthalten		√	<p>Ausführliche Erläuterung, ob</p> <ul style="list-style-type: none"> — die übertragenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum Zeitpunkt der Auswahl keine ausgefallenen (oder umstrukturierten) Risikopositionen im Sinne von Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 enthalten; — die in Artikel 20 Absatz 11 Buchstabe a Ziffern i und ii der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erfüllt sind; — die in Artikel 20 Absatz 11 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erfüllt sind; 	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

						— die in Artikel 20 Absatz 11 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erfüllt sind.	
STSS32	Artikel 20 Absatz 12	Mindestens eine Zahlung zum Zeitpunkt der Übertragung	√			Bestätigung, ob die Schuldner zum Zeitpunkt der Übertragung der Risikopositionen mindestens eine Zahlung geleistet haben. Bestätigung, ob die in Artikel 20 Absatz 12 der Verordnung (EU) 2017/2402 vorgesehene Ausnahmeregelung angewandt wird.	Punkte 3.3 und 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS33	Artikel 20 Absatz 13	Rückzahlung an die Inhaber darf nicht so strukturiert sein, dass sie überwiegend von der Veräußerung von Vermögenswerten abhängt			√	Ausführliche Erläuterung des Grades der Abhängigkeit der Rückzahlungen an die Inhaber der Verbriefungsposition von der Veräußerung von Vermögenswerten, durch die die zugrunde liegenden Risikopositionen besichert sind.	Punkt 3.4.1 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS34	Artikel 21 Absatz 1	Erfüllung der Anforderung in Bezug auf den Risikoselbstbehalt			√	Kurze Erläuterung, wie der Originator, der Sponsor oder der ursprüngliche Kreditgeber bei einer Nicht-ABCP-Verbriefung die Anforderung in Bezug auf den Risikoselbstbehalt im Sinne von Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt. Angabe, welches Unternehmen den materiellen Nettoanteil behält und welche Option für den Risikoselbstbehalt genutzt wird: 1.) vertikaler Anteil nach Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402; 2.) Anteil des Verkäufers nach Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402; 3.) nach dem Zufallsprinzip ausgewählte in der Bilanz geführte Risikopositionen nach Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402; 4.) Erstverlust-Tranche nach Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402; 5.) Erstverlust-Position bei jedem Vermögenswert nach Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe e der Verordnung (EU) 2017/2402; 6.) Nichteinhaltung der Risikoselbstbehalt-Anforderungen nach Artikel 6 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402; 7.) andere verwendete Optionen.	Punkt 3.1 von Anhang 9 und Punkt 3.4.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSS35	Artikel 21 Absatz 2	Minderung von Zins- (IR-) und Währungs-(FX-)risiken		√		Kurze Erläuterung dazu, ob die Zins- und Währungsrisiken in angemessener Weise gemindert und Maßnahmen zur Minderung dieser Risiken getroffen werden, und Bestätigung, dass diese Maßnahmen für die Anleger verfügbar sind.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS36	Artikel 21 Absatz 2	Derivatekäufe/-verkäufe der Verbriefungszweckgesellschaft		√		Kurze Erklärung, dass die Verbriefungszweckgesellschaft — außer unter den in Artikel 21 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Umständen — keine Derivatekontrakte geschlossen hat.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS37	Artikel 21 Absatz 2	Derivate mit gemeinsamen Standards		√		Kurze Erläuterung, ob eingesetzte Sicherungsinstrumente auf der Grundlage anerkannter gemeinsamer Standards gezeichnet und dokumentiert werden.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS38	Artikel 21 Absatz 3	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen		√		Kurze Erläuterung, ob und wie alle an einen Referenzwert gebundenen Zinszahlungen für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der Verbriefung anhand marktüblicher Zinssätze oder anhand der üblichen sektoralen Sätze, die die Refinanzierungskosten widerspiegeln, berechnet werden.	Punkte 2.2.2 und 2.2.1.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS39	Artikel 21 Absatz 4	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über vorzeitige Fälligstellung		√		Allgemeine Erklärung, dass jede Anforderung des Artikels 21 Absatz 4 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt ist.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS40	Artikel 21 Absatz 4	a) Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen	√			Bestätigung, dass bei Zustellung eines Beitreibungsbescheids oder einer Mitteilung über die vorzeitige Fälligstellung keine Geldbeträge zurückbehalten würden.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS41	Artikel 21 Absatz 4	b) Weiterreichung von Tilgungseingängen an die Anleger	√			Bestätigung, dass die Tilgungseingänge aus den zugrunde liegenden Risikopositionen im Wege einer sequentiellen Amortisierung der Verbriefungspositionen je nach Seniorität der jeweiligen Risikoposition an die Anleger weitergereicht werden.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSS42	Artikel 21 Absatz 4	c) Rückzahlung nicht in umgekehrter Reihenfolge zur Seniorität	√			Bestätigung, dass die Rückzahlung der Verbriefungspositionen nicht in umgekehrter Reihenfolge zu ihrer Seniorität erfolgt.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS43	Artikel 21 Absatz 4	d) Keine Bestimmungen, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern	√			Bestätigung, dass keine Bestimmungen gelten, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS44	Artikel 21 Absatz 5	Verbriefungen mit nichtsequentieller Zahlungsrangfolge	√			Bestätigung, dass Transaktionen mit nichtsequentieller Zahlungsrangfolge auslösende Ereignisse umfassen, die sich auf die Wertentwicklung der zugrunde liegenden Risikopositionen beziehen, die dann zu einer Zahlungsrangfolge führen, bei der eine Rückkehr zu sequentiellen Zahlungen in der Reihenfolge ihrer Seniorität erfolgt. Bestätigung, dass zu solchen auslösenden Ereignissen zumindest die Verschlechterung der Kreditqualität der zugrunde liegenden Risikopositionen unter einen im Voraus festgelegten Schwellenwert zählt.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS45	Artikel 21 Absatz 6	Revolvierende Verbriefung mit Klauseln der vorzeitigen Rückzahlung oder auslösenden Ereignissen für die Beendigung der revolvierenden Periode		√		Gegebenenfalls kurze Erläuterung, wie sich die Bestimmungen des Artikels 21 Absatz 6 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 in den Transaktionsunterlagen widerspiegeln.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS46	Artikel 21 Absatz 6 Buchstabe a	a) Verschlechterung der Kreditqualität der zugrunde liegenden Risikopositionen		√		Gegebenenfalls kurze Erläuterung, wie sich die Bestimmungen des Artikels 21 Absatz 6 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 in den Transaktionsunterlagen widerspiegeln.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS47	Artikel 21 Absatz 6 Buchstabe b	b) Insolvenz des Originators oder des Forderungsverwalters		√		Gegebenenfalls kurze Erläuterung, wie sich die in Artikel 21 Absatz 6 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 vorgesehenen Bestimmungen oder auslösenden Ereignisse in den Transaktionsunterlagen widerspiegeln.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSS48	Artikel 21 Absatz 6 Buchstabe c	c) Absinken des Werts der zugrunde liegenden Risikopositionen, die von der Verbriefungszweckgesellschaft gehalten werden, unter einen im Voraus festgelegten Schwellenwert		√		Gegebenenfalls kurze Erläuterung, wie sich die in Artikel 21 Absatz 6 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 vorgesehenen Bestimmungen oder auslösenden Ereignisse in den Transaktionsunterlagen widerspiegeln, unter Angabe der betreffenden Fundstellen in den Transaktionsunterlagen.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS49	Artikel 21 Absatz 6 Buchstabe d	d) Nicht hinreichende Generierung neuer zugrunde liegender Risikopositionen, die über die im Voraus festgelegte Kreditqualität verfügen (auslösendes Ereignis für die Beendigung der revolvingen Periode)		√		Gegebenenfalls kurze Erläuterung, wie sich die Bestimmungen des Artikels 21 Absatz 6 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402 in den Transaktionsunterlagen widerspiegeln.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS50	Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe a	a) Information über die vertraglichen Verpflichtungen des Forderungsverwalters, des Treuhänders und anderer Anbieter von Nebendienstleistungen	√			Bestätigung, dass in den Transaktionsunterlagen alle Anforderungen nach Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 festgelegt sind.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS51	Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe b	b) Bestimmungen zur Kontinuität der Forderungsverwaltung	√			Bestätigung, dass die Verbriefungsunterlagen die Anforderungen des Artikels 21 Absatz 7 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 ausdrücklich erfüllen.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS52	Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe c	c) Bestimmungen zur Kontinuität der Derivatgegenparteien	√			Bestätigung, dass in den Transaktionsunterlagen alle Informationen nach Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 enthalten sind.	Punkt 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS53	Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe c	c) Bestimmungen zur Kontinuität der Liquiditätsgeber und der kontoführenden Bank	√			Bestätigung, dass in den Transaktionsunterlagen alle Informationen nach Artikel 21 Absatz 7 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 enthalten sind.	Punkt 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSS54	Artikel 21 Absatz 8	Erforderliche Erfahrung des Forderungsverwalters sowie angemessene Strategien, Verfahren und Kontrollen des Risikomanagements			√	Ausführliche Erläuterung dazu, wie die Anforderungen des Artikels 21 Absatz 8 erfüllt werden, einschließlich Verweise auf etwaige Strategien und Verfahren, mit denen die Einhaltung dieser Anforderungen sichergestellt werden soll.	Punkt 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS55	Artikel 21 Absatz 9	Klare und kohärente Definitionen für den Umgang mit Problemkrediten	√			Bestätigung, dass in den Transaktionsunterlagen auf klare und kohärente Weise Definitionen, Abhilfe- und sonstige Maßnahmen für die in Artikel 21 Absatz 9 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Fälle dargelegt sind.	Punkt 2.2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS56	Artikel 21 Absatz 9	Zahlungsrangfolgen und auslösende Ereignisse	√			Bestätigung, dass die Verbriefungsunterlagen gemäß Artikel 21 Absatz 9 der Verordnung (EU) 2017/2402 eindeutige Festlegungen zu den Zahlungsrangfolgen und den auslösenden Ereignissen enthalten.	Punkt 3.4.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS57	Artikel 21 Absatz 10	Zeitnahe Lösung von Konflikten zwischen den verschiedenen Kategorien von Anlegern und Zuständigkeiten des Treuhänders	√			Bestätigung, dass die Bestimmungen des Artikels 21 Absatz 10 der Verordnung (EU) 2017/2402 zur zeitnahen Konfliktlösung eingehalten werden.	Punkte 3.4.7 und 3.4.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS58	Artikel 22 Absatz 1	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste	√			Bestätigung, dass die gemäß Artikel 22 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 verfügbar zu machenden Daten zur Verfügung stehen, mit klarem Hinweis, wo diese Informationen verfügbar sind.	Punkt 2.2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS59	Artikel 22 Absatz 2	Externe Überprüfung einer Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen	√			Bestätigung, dass eine Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen vor der Emission der Wertpapiere einer externen Überprüfung durch eine geeignete und unabhängige Stelle unterzogen wurde.	Entfällt
STSS60	Artikel 22 Absatz 3	Liability-Cashflow-Modell für potenzielle Anleger	√			Bestätigung, dass potenziellen Anlegern vor der Bepreisung der Verbriefung ein Liability-Cashflow-Modell zur Verfügung steht, und klarer Hinweis, wo diese Informationen verfügbar sind. Bestätigung, dass potenziellen Anlegern diese Informationen nach der Bepreisung auf Verlangen zur Verfügung gestellt wurden.	Entfällt

STSS61	Artikel 22 Absatz 4	Veröffentlichung der Umweltbilanz von zugrunde liegenden Risikopositionen, bei denen es sich um Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder -Leasinggeschäfte handelt		√		Kurze Erläuterung, ob Informationen über die Umweltbilanz der durch Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder -Leasinggeschäfte finanzierten Vermögenswerte gemäß Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Verfügung stehen, und Angabe der Fundstelle.	Entfällt
STSS62	Artikel 22 Absatz 5	Verantwortlichkeit von Originator und Sponsor für die Einhaltung des Artikels 7		√		Bestätigung, dass <ul style="list-style-type: none"> — der Originator und der Sponsor die Bestimmungen des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 einhalten; — die nach Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe a erforderlichen Informationen potenziellen Anlegern vor der Bepreisung auf Verlangen zur Verfügung gestellt wurden; — die nach Artikel 7 Absatz 1 Buchstaben b bis d erforderlichen Informationen vor der Bepreisung zumindest im Entwurf oder in vorläufiger Form zur Verfügung gestellt wurden. 	Entfällt

(¹) Falls einschlägig, ist auch die betreffende Fundstelle in der Basisdokumentation anzugeben.

(²) Delegierte Verordnung (EU) 2019/1851 der Kommission vom 28. Mai 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Homogenität der einer Verbriefung zugrunde liegenden Risikopositionen (ABl. L 280 vom 6.11.2019, S. 1).

(³) Richtlinie 2008/48/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 23. April 2008 über Verbraucherkreditverträge und zur Aufhebung der Richtlinie 87/102/EWG des Rates (ABl. L 133 vom 22.5.2008, S. 66).

(⁴) Richtlinie 2014/17/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Februar 2014 über Wohnimmobilienkreditverträge für Verbraucher und zur Änderung der Richtlinien 2008/48/EG und 2013/36/EU und der Verordnung (EU) Nr. 1093/2010 Text von Bedeutung für den EWR (ABl. L 60 vom 28.2.2014, S. 34).

ANHANG II

Der ESMA bei ABCP-Verbriefungen gemäß Artikel 24 der Verordnung (EU) 2017/2402 zu übermittelnde Informationen

Allgemeine Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	FELDBEZEICHNUNG	GEFORDERTER MELDEINHALT ⁽¹⁾	WEITERE ANGABEN
STSAT0	Artikel 27 Absatz 1	Erste Anlaufstelle	Rechtsträgerkennung (LEI) der Instanz, die als erste Anlaufstelle benannt wurde, und Name der jeweils zuständigen Behörde.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980.
STSAT1	Entfällt	Identifikationsnummer des Finanzinstruments	Falls verfügbar, internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN) bzw. -nummern. Wenn keine ISIN verfügbar ist, jede andere für die ABCP-Verbriefung vergebene eindeutige Wertpapier-Kennnummer.	Falls verfügbar, weitere Angaben nach Punkt 3.1 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT2	Entfällt	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI)	Falls verfügbar, LEI des Originators/der Originatoren und/oder des Sponsors/der Sponsoren.	Punkt 4.2 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT3	Entfällt	Kennziffer der Meldung	Bei Übermittlung einer Aktualisierung: einmalige Referenznummer, die die ESMA bei der ursprünglichen STS-Meldung vergeben hat.	Entfällt
STSAT4	Entfällt	Eindeutige Kennung	Eindeutige Kennung, die dieser ABCP-Transaktion gemäß Artikel 11 Absatz 2 der Delegierten Verordnung 2020/1224 von der meldenden Stelle zugewiesen wird.	Entfällt
STSAT5	Entfällt	Kennziffer des Prospekts	Falls verfügbar, von der jeweils zuständigen Behörde vergebene Kennziffer des Prospekts.	Entfällt
STSAT6	Entfällt	Verbriefungsregister	Falls verfügbar, Name des registrierten Verbriefungsregisters.	Entfällt
STSAT7	Entfällt	Bezeichnung der Verbriefung	Falls verfügbar, Bezeichnung der Verbriefung oder andernfalls Code-Bezeichnung und Gebrauchsbezeichnung.	Abschnitt 4 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT8	Artikel 18 und Artikel 27 Absatz 3	Sitzland	Falls verfügbar, Land, in dem der/die Originator(en), Sponsor(en) und Verbriefungszweckgesellschaft(en) seinen/ihren Sitz hat/haben.	Entfällt
STSAT9	Entfällt	Klassifizierung der Verbriefung	Art der Verbriefung: — Nicht-ABCP — ABCP — ABCP-Programm	Entfällt

STSAT10	Entfällt	Klassifizierung der zugrunde liegenden Risikopositionen	<p>Art der zugrunde liegenden Risikopositionen, unter anderem:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. Darlehen für Wohnimmobilien, die entweder durch eine oder mehrere Grundpfandrechte auf Wohnimmobilien besichert oder in voller Höhe durch einen Sicherungsgeber garantiert sind, der im Sinne des Artikels 201 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 anerken­nungsfähig ist und gemäß Teil 3 Titel II Kapitel 2 der vorgenannten Verordnung der Bonitätsstufe 2 oder darüber angehört; 2. gewerbliche Darlehen, die durch ein oder mehrere Grundpfandrechte auf Gewerbeimmobilien, insbesondere auch Büro- oder sonstige Gewerbeimmobilien, besichert sind; 3. Darlehensfazilitäten für natürliche Personen zu Zwecken des persönlichen, Familien- oder Haushaltskonsums; 4. Darlehensfazilitäten, einschließlich Darlehen und Leasinggeschäfte, für alle Arten von Unternehmen oder Kapitalgesellschaften; 5. Kfz-Darlehen/Leasing; 6. Kreditkartenforderungen; 7. Handelsforderungen; 8. sonstige zugrunde liegende Risikopositionen, die aus Sicht des Originators oder Sponsors auf Basis interner Methoden und Parameter eine eigene Vermögenswertkategorie darstellen. 	Entfällt
STSAT11	Entfällt	Ausgabedatum	Wurde ein Prospekt nach Maßgabe der Verordnung (EU) 2017/1129 erstellt: Datum, an dem der Prospekt gebilligt wurde. Andernfalls Emissionsdatum der ABCP-Verbriefung.	Entfällt
STSAT12	Entfällt	Melddatum	Datum der Meldung an die ESMA.	Entfällt
STSAT13	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: eine Erklärung, dass die Erfüllung der STS-Kriterien durch dieses zugelassene Drittunternehmen bestätigt wurde.	Entfällt
STSAT14	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name und Sitzland dieses Dritten.	Entfällt

STSAT15	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verbriefungsverordnung erbracht: Name der zuständigen Behörde, die die Zulassung erteilt hat.	Entfällt
STSAT16	Artikel 27 Absatz 5	STS-Status	Ob der Originator und/oder Sponsor gemeldet hat, dass die ABCP-Verbriefung nicht mehr als STS-Verbriefung anzusehen ist, und Gründe für diese Meldung.	Entfällt
STSAT17	Artikel 27 Absatz 3	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) kein Kreditinstitut	„Ja“ oder „Nein“, je nachdem, ob es sich beim Originator bzw. ursprünglichen Kreditgeber um ein Kreditinstitut oder eine Wertpapierfirma mit Sitz in der Union handelt oder nicht.	Entfällt
STSAT18	Artikel 27 Absatz 3	Bestätigung der Kreditvergabekriterien	Bei „Nein“ in Feld STSS17: Bestätigung, dass die Kreditvergabekriterien, -verfahren und -systeme des Originators bzw. ursprünglichen Kreditgebers gemäß Artikel 9 der Verordnung (EU) 2017/2402 umgesetzt werden.	Entfällt
STSAT19	Artikel 27 Absatz 3	Bestätigung, dass die Kreditvergabe beaufsichtigt wird	Bei „Nein“ in Feld STSS17: Bestätigung, dass die Kreditvergabe im Sinne von Artikel 27 Absatz 3 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 beaufsichtigt wird.	Entfällt

(¹) Falls einschlägig, ist auch die betreffende Fundstelle in der Basisdokumentation anzugeben.

Spezifische Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	FELDBEZEICHNUNG	Bestätigung	Kurze Erläuterung	Ausführliche Erläuterung	GEFORDERTER MELDEINHALT (¹)	WEITERE ANGABEN
STSAT20	Artikel 24 Absatz 1	Zugrunde liegende Risikopositionen im Wege einer „True-Sale“-Verbriefung erworben		√		Kurze Erläuterung, wie die Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen durch eine „True-Sale“-Verbriefung oder durch eine Übertragung mit gleicher rechtlicher Wirkung in einer gegenüber dem Verkäufer oder gegenüber Dritten durchsetzbaren Weise erfolgt.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT21	Artikel 24 Absatz 2	Keine schwerwiegende Rückforderung		√		Kurze Erläuterung, ob bei der Verbriefung etwaige schwerwiegende Rückforderungsvereinbarungen im Sinne von Artikel 24 Absatz 2 Buchstabe a oder b der Verordnung (EU) 2017/2402 vorliegen, und ob die Bestimmungen in Artikel 24 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 angewandt werden.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSAT22	Artikel 24 Absatz 3	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht	√			In Verbindung mit STSS21 gegebenenfalls Bestätigung, dass keine Umstände vorliegen, die Rückforderungsvereinbarungen nach Artikel 24 Absätze 1 und 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Folge haben könnten.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT23	Artikel 24 Absatz 4	Übertragung, wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist	√			Wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist, eine Bestätigung, dass die Verbriefung mit Artikel 24 Absätze 1 bis 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 konform ist.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT24	Artikel 24 Absatz 5	Übertragung im Wege einer Abtretung, die zu einem späteren Zeitpunkt abgeschlossen wird		√		Wenn die Übertragung der zugrundeliegenden Risikopositionen im Wege einer Abtretung erfolgt, die zu einem späteren Zeitpunkt als dem Abschluss der Transaktion abgeschlossen wird: kurze Erläuterung, wie und ob dieser Abschluss zumindest durch die in Artikel 24 Absatz 5 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten auslösenden Ereignisse bewirkt wird.	Punkt 3.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT25	Artikel 24 Absatz 6	Zusicherungen und Gewährleistungen		√		Kurze Erläuterung, ob der Verkäufer Zusicherungen und Gewährleistungen erbringt, dass die Vermögenswerte, die Gegenstand der Verbriefung sind, nicht anderweitig belastet oder in einem Zustand sind, der die Durchsetzbarkeit der „True-Sale“-Verbriefung oder Abtretung oder Übertragung mit gleicher rechtlicher Wirkung beeinträchtigen könnte.	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT26	Artikel 24 Absatz 7	Anerkennungskriterien, die im Hinblick auf die zugrunde liegenden Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten		√		Kurze Erläuterung, ob <ul style="list-style-type: none"> — die vom Verkäufer auf die Verbriefungszweckgesellschaft übertragenen oder an sie abgetretenen Risikopositionen im Voraus festgelegte, eindeutige und dokumentierte Anerkennungskriterien erfüllen, die im Hinblick auf diese Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten; — die Auswahl und Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen der Verbriefung auf eindeutigen Verfahren beruhen, die die Erkennung der für die Verbriefung ausgewählten oder übertragenen Risikopositionen erleichtern und im Hinblick auf diese Risikopositionen keine aktive Portfolioverwaltung auf diskretionärer Basis gestatten. 	Abschnitt 2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSAT27	Artikel 24 Absatz 8	Keine Wiederverbriefung	√			Bestätigung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen keine Verbriefungspositionen enthalten und es sich bei der gemeldeten Verbriefung somit nicht um eine Wiederverbriefung handelt.	Punkt 2.2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT28	Artikel 24 Absatz 9	Übertragene zugrunde liegende Risikopositionen, die keine ausgefallenen Risikopositionen enthalten			√	Ausführliche Erläuterung, wie die übertragenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum Zeitpunkt der Auswahl keine ausgefallenen oder umstrukturierten Risikopositionen im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 der Verordnung (EU) 2017/2402 enthalten, soweit anwendbar. Gegebenenfalls eine eindeutige Erklärung dazu, ob die Verbriefung zum Verbriefungszeitpunkt eine beeinträchtigte Bonität im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a Ziffer i der Verordnung (EU) 2017/2402 beinhaltet. Bestätigung, dass — zum Zeitpunkt der Originierung die in Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erfüllt sind; — zum Zeitpunkt der Auswahl die in Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erfüllt sind;	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT29	Artikel 24 Absatz 10	Mindestens eine Zahlung zum Zeitpunkt der Übertragung	√			Bestätigung, ob die Schuldner zum Zeitpunkt der Übertragung der Risikopositionen mindestens eine Zahlung geleistet haben. Wenn keine Zahlung geleistet wurde: Angabe des Grundes und ob es sich dabei um eine der in Artikel 20 Absatz 12 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten zulässigen Ausnahmen handelt.	Punkte 3.3 und 3.4.6 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT30	Artikel 24 Absatz 11	Rückzahlung an die Inhaber darf nicht so strukturiert sein, dass sie überwiegend von der Veräußerung von Vermögenswerten abhängt			√	Ausführliche Erläuterung des Grades der Abhängigkeit der Rückzahlungen an die Inhaber der Verbriefungsposition von der Veräußerung von Vermögenswerten, durch die die zugrunde liegenden Risikopositionen besichert sind. Gegebenenfalls ausführliche Erläuterung dazu, ob die Rückzahlungen an die Anleger im Sinne von Artikel 24 Absatz 11 Unterabsatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 als von der Veräußerung der Vermögenswerte unabhängig betrachtet werden.	Punkt 3.4.1 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

STSAT31	Artikel 24 Absatz 12	Minderung von Zins- (IR-) und Währungs-(FX-)risiken		√		Kurze Erläuterung, ob und wie die Zins- und Währungsrisiken in angemessener Weise gemindert, und Bestätigung, dass die diesbezüglichen Maßnahmen offengelegt werden. Kurze Erläuterung, ob eingesetzte Sicherungsinstrumente auf der Grundlage anerkannter gemeinsamer Standards gezeichnet und dokumentiert werden.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT32	Artikel 24 Absatz 12	Derivatekäufe/-verkäufe der Verbriefungszweckgesellschaft		√		Kurze Erläuterung, ob die Verbriefungszweckgesellschaft keine Derivatekontrakte geschlossen hat, es sei denn, diese dienen zur Absicherung des Zins- und Währungsrisikos.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT33	Artikel 24 Absatz 12	Derivate in den zugrunde liegenden Risikopositionen		√		Kurze Erläuterung zur Präsenz von Derivaten im Pool zugrunde liegender Risikopositionen.	Punkte 3.4.2 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT34	Artikel 24 Absatz 12	Derivate mit gemeinsamen Standards		√		Kurze Erläuterung, ob nach Artikel 24 Absatz 12 zulässige Derivate auf der Grundlage gemeinsamer internationaler Finanzstandards gezeichnet und dokumentiert werden.	Punkte 3.4.7 und 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT35	Artikel 24 Absatz 13	Klare und kohärente Definitionen für den Umgang mit Problemkrediten	√			Bestätigung, dass in den Transaktionsunterlagen auf klare und kohärente Weise Definitionen, Abhilfe- und sonstige Maßnahmen für die in Artikel 24 Absatz 13 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Fälle dargelegt sind.	Punkt 2.2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT36	Artikel 24 Absatz 13	Zahlungsrangfolgen und auslösende Ereignisse	√			Bestätigung, dass die Transaktionsunterlagen gemäß Artikel 24 Absatz 13 der Verordnung (EU) 2017/2402 eindeutige Festlegungen zu den Zahlungsrangfolgen und den auslösenden Ereignissen enthalten.	Punkte 3.4.7 und 3.4.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT37	Artikel 24 Absatz 14	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste	√			Bestätigung, dass die gemäß Artikel 24 Absatz 14 der Verordnung (EU) 2017/2402 verfügbar zu machenden Daten zur Verfügung stehen, und klarer Hinweis, wo die Informationen für potenzielle Anleger vor der Bepreisung verfügbar sind. Wenn der Sponsor keinen Zugang zu diesen Daten hat: Bestätigung, dass der Verkäufer die Daten gemäß Artikel 24 Absatz 14 der Verordnung (EU) 2017/2402 zugänglich gemacht hat.	Punkt 2.2.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

						Bestätigung, dass die Daten zur Verfügung stehen, und klarer Hinweis auf die Fundstelle sowie darauf, dass der von diesen Daten abgedeckte Zeitraum mindestens fünf Jahre umfasst, mit Ausnahme von Daten in Bezug auf Handelsforderungen und andere kurzfristige Forderungen, für die der historische Zeitraum mindestens drei Jahre umfassen muss.	
STSAT38	Artikel 24 Absatz 15	Homogenität der Vermögenswerte			√	Ausführliche Erläuterung, wie die Verbriefung durch einen Pool zugrunde liegender Risikopositionen unterlegt ist, die homogen sind, wobei die Merkmale in Bezug auf die Zahlungsströme der verschiedenen Vermögenswertkategorien, darunter ihre vertraglichen, Kreditrisiko- und Vorauszahlungsmerkmale zu berücksichtigen sind.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT39	Artikel 24 Absatz 15	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen	√			Bestätigung, dass die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit des Pools zugrunde liegender Risikopositionen höchstens ein Jahr beträgt und keine der zugrunde liegenden Risikopositionen eine Restlaufzeit von mehr als drei Jahren hat. Bestätigung, ob die in Artikel 24 Absatz 15 Unterabsatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 vorgesehene Ausnahme für Pools von Darlehen für Kfz-Käufe, Kfz-Leasinggeschäfte und Transaktionen betreffend das Leasing von Ausrüstungsgegenständen angewandt wird.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT40	Artikel 24 Absatz 15	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen	√			Gegebenenfalls Bestätigung, dass die zugrunde liegenden Risikopositionen — keine durch Hypotheken auf Wohn- oder Gewerbeimmobilien besicherten Darlehen und keine in vollem Umfang garantierten Darlehen für Wohnimmobilien im Sinne des Artikels 129 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe e der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (?) enthalten; — vertraglich verbindliche und durchsetzbare Verpflichtungen mit vollem Rückgriffsrecht auf Schuldner umfassen, die mit festgelegten Zahlungsströmen in Bezug auf Miet-, Tilgungs- oder Zinszahlungen oder mit einem anderen Recht auf Erhalt von Erträgen aus Vermögenswerten, die diese Zahlungen garantieren, ausgestattet sind;	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

						— keine übertragbaren Wertpapiere im Sinne des Artikels 4 Absatz 1 Nummer 44 der Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates ⁽³⁾ enthalten, mit Ausnahme von Unternehmensanleihen, die nicht an einem Handelsplatz notiert sind.	
STSAT41	Artikel 24 Absatz 16	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen		√		Kurze Erläuterung, ob und wie alle an einen Referenzwert gebundenen Zinszahlungen für die Vermögenswerte und Verbindlichkeiten der ABCP-Verbriefung anhand marktüblicher Zinssätze oder anhand der üblichen sektoralen Sätze, die die Refinanzierungskosten widerspiegeln, berechnet werden.	Punkte 2.2.2 und 2.2.13 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT42	Artikel 24 Absatz 17	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über vorzeitige Fälligestellung		√		Kurze Erläuterung dazu, ob jede Anforderung des Artikels 24 Absatz 17 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt ist, mit kurzer Erläuterung zu Fällen, in denen Geldbeträge zurückbehalten werden könnten.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT43	Artikel 24 Absatz 17	a) Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über vorzeitige Fälligestellung	√			Bestätigung, dass bei einem Beitreibungsbescheid oder einer Mitteilung über die vorzeitige Fälligestellung keine Geldbeträge zurückbehalten würden.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT44	Artikel 24 Absatz 17	b) Weiterreichung von Tilgungseingängen an die Anleger	√			Bestätigung, dass die Tilgungseingänge aus den zugrunde liegenden Risikopositionen im Wege einer sequentiellen Amortisierung der Verbriefungspositionen je nach Seniorität der jeweiligen Risikoposition an die Anleger weitergereicht werden.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT45	Artikel 24 Absatz 17	c) Keine Bestimmungen, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern	√			Bestätigung, dass keine Bestimmungen gelten, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern.	Punkt 3.4.5 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT46	Artikel 24 Absatz 18	Solide Vergabestandards			√	Ausführliche Erläuterung dazu, ob die zugrunde liegenden Risikopositionen im ordentlichen Geschäftsgang des Verkäufers originiert wurden und ob die angewandten Vergabestandards nicht weniger streng sind als die für nicht verbrieft Risikopositionen verwendeten Standards.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

						Eine detaillierte Erklärung darüber, ob dem Sponsor und anderen direkt der ABCP-Verbriefung exponierten Parteien wesentliche Änderungen gegenüber früheren Emissionsstandards offengelegt wurden.	
STSAT47	Artikel 24 Absatz 18	Erfahrung des Verkäufers			√	Ausführliche Erläuterung dazu, ob der Verkäufer über die erforderliche Erfahrung mit der Originierung von Risikopositionen, die den verbrieften Risikopositionen ähneln, verfügt.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT48	Artikel 24 Absatz 19	Revolvierende ABCP-Verbriefungen/Auslösen des Ereignis Kreditqualität			√	Ausführliche Erläuterung, wie die in Artikel 24 Absatz 19 der Verordnung (EU) 2017/2402 vorgesehenen Bestimmungen oder auslösenden Ereignisse in den Transaktionsunterlagen enthalten sind.	Punkte 2.3 und 2.4 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT49	Artikel 24 Absatz 20	Aufgaben der an der Verbriefung Beteiligten	√			Bestätigung, dass die Verbriefungsunterlagen die vertraglichen Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten des Sponsors, des Forderungsverwalters sowie gegebenenfalls des Treuhänders und anderer Anbieter von Nebendienstleistungen enthalten.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT50	Artikel 24 Absatz 20	Bestimmungen zur Kontinuität der Forderungsverwaltung	√			Bestätigung, dass die Verbriefungsunterlagen die Verfahren und Zuständigkeiten enthalten, die erforderlich sind, um sicherzustellen, dass ein Ausfall oder eine Insolvenz des Forderungsverwalters nicht zu einer Beendigung der Forderungsverwaltung führt.	Punkt 3.7 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT51	Artikel 24 Absatz 20	Bestimmungen zur Kontinuität der Derivatgegenpartei und der kontoführenden Bank	√			Bestätigung, dass die Verbriefungsunterlagen Bestimmungen enthalten, die den Ersatz von Derivatgegenparteien und der kontoführenden Bank bei deren Ausfall, Insolvenz und gegebenenfalls bestimmten anderen Ereignissen vorsehen.	Punkt 3.8 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAT52	Artikel 24 Absatz 20	Solidität des Sponsors	√			Bestätigung, dass in den Verbriefungsunterlagen Bestimmungen dazu enthalten sind, wie der Sponsor die Anforderungen nach Artikel 25 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission

(¹) Falls einschlägig, ist auch die betreffende Fundstelle in der Basisdokumentation anzugeben.

(²) Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 176 vom 27.6.2013, S. 1).

(³) Richtlinie 2014/65/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 15. Mai 2014 über Märkte für Finanzinstrumente sowie zur Änderung der Richtlinien 2002/92/EG und 2011/61/EU (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S. 349).

ANHANG III

Der ESMA bei ABCP-Programmen gemäß Artikel 25 und 26 der Verordnung (EU) 2017/2402 zu übermittelnde Informationen

Allgemeine Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	FELDBEZEICHNUNG	GEFORDERTER MELDEINHALT ⁽¹⁾	WEITERE ANGABEN
STSAP0	Artikel 27 Absatz 1	Erste Anlaufstelle	Rechtsträgerkennung (LEI) der Instanz, die als erste Anlaufstelle benannt wurde, und Name der jeweils zuständigen Behörde.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP1	Entfällt	Identifikationsnummer des Finanzinstruments	Gegebenenfalls internationale Wertpapier-Identifikationsnummern (ISIN) der ABCP-Programme.	Falls verfügbar, weitere Angaben nach Punkt 3.1 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP2	Entfällt	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI)	Falls verfügbar, LEI des Sponsors/der Sponsoren und/oder des ABCP-Programms/der ABCP-Programme.	Punkt 4.2 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP3	Entfällt	Kennziffer der Meldung	Bei Übermittlung einer Aktualisierung: einmalige Referenznummer, die die ESMA bei der ursprünglichen STS-Meldung vergeben hat.	Entfällt
STSAP4	Entfällt	Eindeutige Kennung	Eindeutige Kennung, die diesem ABCP-Programm gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 von der meldenden Stelle zugewiesen wird.	Entfällt
STSAP5	Entfällt	Kennziffer des Prospekts	Falls verfügbar, von der jeweils zuständigen Behörde vergebene Kennziffer des Prospekts.	Entfällt
STSAP6	Entfällt	Verbriefungsregister	Falls verfügbar, Name des registrierten Verbriefungsregisters.	Entfällt
STSAP7	Entfällt	Bezeichnung der Verbriefung	Bezeichnung des ABCP-Programms	Abschnitt 4 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP8	Artikel 18 und Artikel 27 Absatz 3	Sitzland	Sitzland des Sponsors/der Sponsoren	Punkt 4.3 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP9	Entfällt	Klassifizierung der Verbriefung	Art der Verbriefung (Nicht-ABCP, ABCP, ABCP-Programm)	Entfällt

STSAP10	Entfällt	Emissionsdatum	Datum, an dem das ABCP-Programm erstmalig begeben wurde.	Punkt 4 von Anhang 9 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP11	Entfällt	Melddatum	Datum der STS-Meldung an die ESMA	Entfällt
STSAP12	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: eine Erklärung, dass die Erfüllung der STS-Kriterien durch dieses zugelassene Drittunternehmen bestätigt wurde.	Entfällt
STSAP13	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name und Sitzland dieses Dritten.	Entfällt
STSAP14	Artikel 27 Absatz 2	Zugelassener Dritter	Wurden von einem zugelassenen Dritten STS-Überprüfungsdienstleistungen nach Artikel 27 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erbracht: Name der zuständigen Behörde, die die Zulassung erteilt hat.	Entfällt
STSAP15	Artikel 27 Absatz 5	STS-Status	Meldung des Sponsors, dass das ABCP-Programm nicht mehr als STS-Verbriefung anzusehen ist, und Gründe dafür.	Entfällt

(!) Falls einschlägig, ist auch die betreffende Fundstelle in der Basisdokumentation anzugeben.

Spezifische Informationen

Feld-Nr.	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	FELDBEZEICHNUNG	Bestätigung	Kurze Erläuterung	Ausführliche Erläuterung	GEFORDERTER MELDEINHALT (!)	WEITERE ANGABEN
STSAP16	Artikel 25 Absatz 1	Sponsor muss beaufsichtigtes Kreditinstitut sein	√			Bestätigung, dass der Sponsor des Programms ein beaufsichtigtes Kreditinstitut ist, und Link zu einem Dokument, das diesen Status bescheinigt.	Entfällt
STSAP17	Artikel 25 Absatz 2	Unterstützung durch den Sponsor als Bereitsteller von Liquiditätsfazilitäten	√			Bestätigung, dass der Sponsor des ABCP-Programms als Bereitsteller von Liquiditätsfazilitäten fungiert und alle Verbriefungspositionen auf der Ebene des ABCP-Programms unterstützt, einschließlich einer Beschreibung der Liquiditätsfazilität und eines Links zu einem Dokument, mit dem diese Bereitstellung nachgewiesen wird.	Entfällt

STSAP18	Artikel 25 Absatz 3	Nachweis, den das Kreditinstitut gegenüber seiner zuständigen Behörde zu erbringen hat	√		Bestätigung, dass Solvenz und Liquidität des Kreditinstituts durch seine Rolle als Sponsor nicht gefährdet sind, und, falls verfügbar, Link zu dem Dokument, das belegt, dass es gegenüber der zuständigen Behörde einen entsprechenden Nachweis erbracht hat.	Entfällt
STSAP19	Artikel 25 Absatz 4	Erfüllung der Sorgfaltspflichten des Sponsors	√		Bestätigung, dass der Sponsor seine Sorgfaltspflichten nach Artikel 5 Absätze 1 und 3 der Verordnung (EU) 2017/2402, soweit anwendbar, erfüllt. Bestätigung, dass sich der Sponsor vergewissert hat, dass der Verkäufer Kundenbetreuungsfähigkeiten und Inkassoverfahren anwendet, die die Anforderungen des Artikels 265 Absatz 2 Buchstaben i bis p der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 oder gleichwertige Anforderungen in Drittländern erfüllen.	Entfällt
STSAP20	Artikel 25 Absatz 5	Verkäufer (auf Transaktionsebene) oder Sponsor (auf der Ebene des ABCP-Programms) müssen die Anforderungen in Bezug auf den Risikselbstbehalt gemäß Artikel 6 erfüllen		√	Kurze Erläuterung dazu, wie der Verkäufer (ABCP-Verbriefung) und der Sponsor (ABCP-Programm) die in Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 festgelegten Anforderungen in Bezug auf den Risikselbstbehalt erfüllen, unter Angabe der für den Risikselbstbehalt gewählten Option, unter anderem: 1.) vertikaler Anteil — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402; 2.) Anteil des Verkäufers — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402; 3.) nach dem Zufallsprinzip ausgewählte in der Bilanz geführte Risikopositionen — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402; 4.) Erstverlust-Tranche — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402; 5.) Erstverlust-Position bei jedem Vermögenswert — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe e der Verordnung (EU) 2017/2402; 6.) Nichteinhaltung der Risikselbstbehalt-Anforderungen der Verordnung (EU) 2017/2402; 7.) Sonstiges.	Punkt 3.4.3 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980 der Kommission
STSAP21	Artikel 25 Absatz 6	Einhaltung von Artikel 7 (Transparenzanforderungen) auf der Ebene des ABCP-Programms	√		Bestätigung, dass — der Sponsor dafür zuständig ist, dass die Bestimmungen des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 eingehalten werden; — der Sponsor Artikel 7 auf der Ebene des ABCP-Programms einhält;	Entfällt

						<p>— der Sponsor den potenziellen Anlegern auf Verlangen vor der Bepreisung Folgendes zur Verfügung gestellt hat: die Informationen nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 in aggregierter Form und die Informationen nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstaben b bis e der Verordnung (EU) 2017/2402 zumindest im Entwurf oder in vorläufiger Form.</p>	
STSAP22	Artikel 25 Absatz 7	Inanspruchnahme der Liquiditätsfazilität für den Fall, dass der Sponsor seine Zusage in Bezug auf die Finanzierung der Liquiditätsfazilität nicht erneuert	√			Kurze Erläuterung des Sponsors dazu, ob für den Fall, dass der Sponsor seine Zusage in Bezug auf die Finanzierung der Liquiditätsfazilität nicht vor deren Ablauf erneuert, die Liquiditätsfazilität in Anspruch genommen wird und die fällig werdenden Wertpapiere zurückgezahlt werden.	Entfällt
STSAP23	Artikel 26 Absatz 1	Konformität der ABCP-Verbriefungen eines ABCP-Programms mit Artikel 24 Absätze 1 bis 8 und 12 bis 20	√			Bestätigung, ob alle ABCP-Verbriefungen eines Programms die folgenden Anforderungen erfüllen: <ul style="list-style-type: none"> — Artikel 24 Absätze 1 bis 8 der Verordnung (EU) 2017/2402, — Artikel 24 Absätze 12 bis 20 der Verordnung (EU) 2017/2402. 	Entfällt
STSAP24	Artikel 26 Absatz 1 Unterabsätze 2 und 3	Höchstens 5 % des Gesamtbetrags der zugrunde liegenden Risikopositionen des ABCP-Programms dürfen vorübergehend gegen bestimmte Anforderungen verstoßen			√	Ausführliche Erläuterung, welche Anforderungen des Artikels 24 Absatz 9, 10 oder 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 gegebenenfalls vorübergehend nicht erfüllt werden, welcher Prozentanteil des Gesamtbetrags der den ABCP-Verbriefungen zugrunde liegenden Risikopositionen betroffen ist und warum das Programm vorübergehend gegen diese Anforderungen verstößt. Bestätigung, dass eine Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen einer externen Überprüfung durch eine geeignete und unabhängige Stelle unterzogen wird.	Entfällt
STSAP25	Artikel 26 Absatz 2	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAL) der zugrunde liegenden Risikopositionen eines ABCP-Programms höchstens zwei Jahre	√			Bestätigung, dass die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit der zugrunde liegenden Risikopositionen eines ABCP-Programms höchstens zwei Jahre beträgt.	Entfällt

STSAP26	Artikel 26 Absatz 3	ABCP-Programm vollständig (von einem Sponsor) unterstützt		√		Kurze Erläuterung, ob das ABCP-Programm gemäß Artikel 25 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 vollständig von einem Sponsor unterstützt wird oder nicht.	Entfällt
STSAP27	Artikel 26 Absatz 4	Keine Wiederverbriefung und keine Bonitätsverbesserung, die eine zweite Tranchierungsebene beim ABCP-Programm schafft	√			Bestätigung, dass das ABCP-Programm keine Wiederverbriefung beinhaltet und die Bonitätsverbesserung keine zweite Tranchierungsebene auf Programmebene schafft.	Entfällt
STSAP28	Artikel 26 Absatz 5	Keine Kaufoptionen	√			Bestätigung, dass das ABCP-Programm keine Kaufoptionen oder Klauseln umfasst, die sich auf die endgültige Fälligkeit der Wertpapiere auswirken und deren Ausübung im Ermessen des Verkäufers, des Sponsors oder der Verbriefungszweckgesellschaft liegt.	Entfällt
STSAP29	Artikel 26 Absatz 6	Zins- und Währungsrisiken auf ABCP-Programmebene in geeigneter Weise gemindert und dokumentiert			√	Ausführliche Erläuterung, ob und wie die auf ABCP-Programmebene auftretenden Zins- und Währungsrisiken in geeigneter Weise gemindert werden und welche Maßnahmen dazu ergriffen werden, mit der Angabe, ob die Verbriefungszweckgesellschaft aus anderen als den in Artikel 26 Absatz 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Gründen Derivatekontrakte schließt, und einer Beschreibung, wie diese Derivate gezeichnet und dokumentiert werden, insbesondere, ob dies auf der Grundlage gemeinsamer internationaler Finanzstandards geschieht.	Entfällt
STSAP30	Artikel 26 Absatz 7 Buchstabe a	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Zuständigkeiten des Treuhänders gegenüber den Anlegern)	√			Bestätigung, dass die Zuständigkeiten des Treuhänders und anderer Stellen mit treuhänderischen Pflichten gegenüber den Anlegern in den ABCP-Programmunterlagen festgelegt sind.	Entfällt
STSAP31	Artikel 26 Absatz 7 Buchstabe b	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (vertragliche Verpflichtungen des Sponsors)	√			Bestätigung, dass die vertraglichen Verpflichtungen, Aufgaben und Zuständigkeiten des Sponsors sowie gegebenenfalls des Treuhänders und anderer Anbieter von Nebenleistungen in den ABCP-Programmunterlagen festgelegt sind.	Entfällt

STSAP32	Artikel 26 Absatz 7 Buchstabe c	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Verfahren und Zuständigkeiten bei Ausfall des Forderungsverwalters)	√			Bestätigung, dass die Verfahren und Zuständigkeiten, die erforderlich sind, um bei Ausfall oder Insolvenz des Forderungsverwalters die Kontinuität der Forderungsverwaltung zu gewährleisten, in den ABCP-Programmunterlagen festgelegt sind.	Entfällt
STSAP33	Artikel 26 Absatz 7 Buchstabe d	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Bestimmungen über den Ersatz von Derivatgegenparteien und der kontoführenden Bank)	√			Bestätigung, dass die Anforderungen des Artikels 26 Absatz 7 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402 in Bezug auf Bestimmungen über den Ersatz von Derivatgegenparteien und der kontoführenden Bank auf ABCP-Programmebene bei deren Ausfall, Insolvenz oder bestimmten anderen Ereignissen, wenn die Liquiditätsfazilität diese Ereignisse nicht abdeckt, erfüllt sind.	Entfällt
STSAP34	Artikel 26 Absatz 7 Buchstabe e	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Verfahren zur Gewährleistung der Besicherung der Finanzierungszusage)	√			Bestätigung, dass in den ABCP-Programmunterlagen Verfahren festgelegt sind, mit denen sichergestellt wird, dass bei bestimmten Ereignissen, bei Ausfall oder Insolvenz des Sponsors Abhilfemaßnahmen vorgesehen sind, um gegebenenfalls eine Besicherung der Finanzierungszusage oder einen Ersatz des Bereitstellers der Liquiditätsfazilität zu erreichen. Angabe der entsprechenden Seiten im Prospekt oder der sonstigen zugrunde liegenden Dokumentation, auf denen die für die Anforderungen des Artikels 26 Absatz 7 Buchstabe e der Verordnung (EU) 2017/2402 relevanten Informationen zu finden sind.	Entfällt
STSAP35	Artikel 26 Absatz 7 Buchstabe f	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Liquiditätsfazilität und Rückzahlung fällig werdender Wertpapiere, falls der Sponsor die Finanzierungszusage für die Liquiditätsfazilität vor deren Ablauf nicht erneuert)	√			Bestätigung, dass die ABCP-Programmunterlagen Bestimmungen enthalten, die sicherstellen, dass für den Fall, dass der Sponsor seine Zusage in Bezug auf die Finanzierung der Liquiditätsfazilität nicht vor deren Ablauf erneuert, die Liquiditätsfazilität in Anspruch genommen wird und die fällig werdenden Wertpapiere zurückgezahlt werden. Angabe der entsprechenden Seiten im Prospekt oder der sonstigen zugrunde liegenden Dokumentation, auf denen die für die Anforderungen des Artikels 26 Absatz 7 Buchstabe f der Verordnung (EU) 2017/2402 relevanten Informationen zu finden sind.	Entfällt

STSAP36	Artikel 26 Absatz 8	Erfahrung des Forderungsverwal- ters			√ Ausführliche Erläuterung dazu, wie die Anforderungen des Artikels 26 Absatz 8 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt werden, einschließlich Strategien und Verfahren, mit denen die Einhaltung dieser Anforderungen sichergestellt wird. Angabe der entsprechenden Seiten im Prospekt oder der sonstigen zugrunde liegenden Dokumentation, die die einschlägigen Erläuterungen zur Einhaltung der Anforderungen des Artikels 26 Absatz 8 der Verordnung (EU) 2017/2402 (soweit anwendbar) (Erfahrung des Forderungsverwalters, Strategien, Verfahren und Risikomanagement) enthalten.	Punkt 3.2 von Anhang 19 der Delegierten Verordnung (EU) 2019/980.
---------	------------------------	--	--	--	--	---

(¹) Falls einschlägig, ist auch die betreffende Fundstelle in der Basisdokumentation anzugeben.