



Euroopa Liidu  
Nõukogu

Brüssel, 25. aprill 2022  
(OR. en)

8379/22  
ADD 1

EF 119  
ECOFIN 363  
DELECT 65

## SAATEMÄRKUSED

---

Saatja:	Euroopa Komisjoni peasekretär, allkirjastanud Martine DEPREZ, direktor
Saaja:	Jeppe TRANHOLM-MIKKELSEN, Euroopa Liidu Nõukogu peasekretär
Komisjoni dok nr:	C(2022) 1892 final
Teema:	LISAD järgmise dokumendi juurde: Komisjoni delegeeritud määrus, millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2020/1226 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses teabega, mis tuleb bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste puhul esitada kooskõlas standardväärtpaberistamise teate nõuetega

---

Käesolevaga edastatakse delegatsioonidele dokument C(2022) 1892 ANNEXES 1 to 2.

Lisatud: C(2022) 1892 final



Brüssel, 31.3.2022  
C(2022) 1892 final

ANNEXES 1 to 2

## LISAD

**järgmise dokumendi juurde:**

**Komisjoni delegeeritud määrus,**

**millega muudetakse delegeeritud määruses (EL) 2020/1226 sätestatud regulatiivseid tehnilisi standardeid seoses teabega, mis tuleb bilansiliste sünteetiliste väärtpaberistamiste puhul esitada kooskõlas standardväärtpaberistamise teate nõuetega**

## ILISA

Delegeeritud määruse (EL) 2020/1226 I, II ja III lisa muudetakse järgmiselt.

(1) I lisa muudetakse järgmiselt:

(a) tabelis „Üldine teave“ asendatakse andmeväljadele STSS4 ja STSS17 vastavad read järgmisega:

„STSS4	Ei kohaldata	Kordumatu tunnus	Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt komisjoni delegeeritud määruse (EL) 2020/1224* artikli 11 lõikele 1.  Kui seda kordumatut väärtpaberistamise tunnust kasutades esitatakse rohkem kui üks standardväärtpaberistamise teade, siis selgitus põhjuse kohta.	Ei kohaldata
STSS17	Artikli 27 lõige 3	Väärtpaberistamise tehingu algataja (või algne laenuandja) on krediidasutus	Märge „Jah“ või „Ei“ selle kohta, kas väärtpaberistamise tehingu algataja või algne laenuandja on liidus asutatud krediidasutus või investeerimisühing.	Ei kohaldata

\* 16. oktoobri 2019. aasta delegeeritud määrus (EL) 2020/1224, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2017/2402 regulatiivsete tehniliste standarditega, milles määratakse kindlaks teave ja väärtpaberistamise üksikasjad, mille väärtpaberistamise tehingu algataja, sponsor ja väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja peavad esitama (ELT L 289, 3.9.2020, lk 1).“;

(b) tabelis „Konkreetne teave“ asendatakse andmeväljadele STSS21 ja STSS22 vastavad read järgmisega:

„STSS21	Artikli 20 lõige 2	Kohaldatakse rangeid tagastamissätteid	√		Lühiselgitus selle kohta, kas väärtpaberistamise puhul kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 20 lõike 2 punktis a või b osutatud rangeid tagastamissätteid.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3
STSS22	Artikli 20 lõige 3	Erand siseriiklike maksejõuetust käsitlevate õigusnormide tagastamissätetele	√		Kinnitus selle kohta, kas kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 20 lõikes 3 osutatud tagastamissätteid.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3“

(2) II lisa muudetakse järgmiselt:

(a) tabelis „Üldine teave“ asendatakse andmeväljadele STSAT4 ja STSAT17 vastavad read järgmisega:

„STSAT4	Ei kohaldata	Kordumatu tunnus	Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 artikli 11 lõikele 1.  Kui selle väärtpaberistamise kordumatu tunnusega väljastatakse rohkem kui üks standardväärtpaberistamise teade, siis selgitus põhjuse kohta.	Ei kohaldata
STSAT17	Artikli 27 lõige 3	Väärtpaberistamise tehingu algataja (või algne laenuandja) on krediidasutus	Märge „Jah“ või „Ei“ selle kohta, kas väärtpaberistamise tehingu algataja või algne laenuandja on liidus asutatud krediidasutus või investeerimisühing.	Ei kohaldata“

(b) tabelis „Konkreetne teave“ asendatakse andmeväljadele STSAT21 ja STSAT22 vastavad read järgmisega:

STSAT21	Artikli 24 lõige 2	Kohaldatakse rangeid tagastamissätteid	√		Lühiselgitus selle kohta, kas väärtpaberistamise puhul kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 24 lõike 2 punktis a või b osutatud rangeid tagastamissätteid.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3
STSAT22	Artikli 24 lõige 3	Erand siseriiklike maksejõuetust käsitlevate õigusnormide tagastamissätetele	√		Kinnitus selle kohta, kas kohaldatakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 24 lõikes 3 osutatud tagastamissätteid.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.3

(3) III lisa tabelis „Üldine teave“ asendatakse andmeväljale STSAP4 vastav rida järgmisega:

„STSAP4	Ei kohaldata	Kordumatu tunnus	Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 artikli 11 lõikele 1.  Kui selle väärtpaberistamise kordumatu tunnusega väljastatakse rohkem kui üks standardväärtpaberistamise teade, siis selgitus põhjuse kohta.	Ei kohaldata“
---------	--------------	------------------	--	---------------

**II LISA**  
**„IV LISA**

Määruse (EL) 2017/2402 artiklite 26b–26e kohaselt bilansiliste väärtpaberistamiste kohta  
ESMA-le esitatav teave

**Üldine teave**

<b>Andmevälja kood</b>	<b>Määruse (EL) 2017/2402 artikkel</b>	<b>Andmevälja nimi</b>	<b>Esitatav teave</b>	<b>Lisateave</b>
STSSY1	Artikli 27 lõike 1 kolmas lõik	Esmane kontaktpunkt	Esmaseks kontaktpunktiks määratud üksuse juriidilise isiku tunnus ja asjaomase pädeva asutuse nimi.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2
STSSY2	Ei kohaldata	Teate kuupäev	ESMA-le teate esitamise kuupäev.	Ei kohaldata
STSSY3	Ei kohaldata	Finantsinstrumendi tunnuscode	Rahvusvaheline väärtpaberite tunnuscode või -koodid (ISIN kood), kui see või need on olemas. Kui ISIN kood puudub, siis mis tahes muu kordumatu väärtpaberikood, kui see on olemas (sh krediidiriski vahetustehingut sisaldavad võlakirjad).	Olemasolu korral delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkti 3.1 alusel
STSSY4	Ei kohaldata	Juriidilise isiku tunnus	Väärtpaberistamise tehingu algataja(te) ja sponsori(te) ning olemasolu korral algse(te) laenuandja(te) ja väärtpaberistamise eriotstarbelise(te) ettevõtja(te) juriidilise isiku tunnus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 9. lisa punkt 4.2
STSSY5	Artikli 31 lõige 3	Krediidiriskikaitse müüja	Esmas(t)e krediidiriskikaitse müüja(te) juriidilise isiku tunnus, nimi ja asukohariik	Ei kohaldata

			ning pädeva asutuse nimi.	
STSSY6	Ei kohaldata	Teate tunnus	Ajakohastatud teabe esitamise korral kordumatu viitenumber, mille ESMA on määranud varem esitatud standardväärtpaberistamise teatele.	Ei kohaldata
STSSY7	Ei kohaldata	Kordumatu tunnus	Kordumatu tunnus, mille aruandev üksus on määranud vastavalt delegeeritud määruse (EL) 2020/1224 artikli 11 lõikele 1	Ei kohaldata
STSSY8	Ei kohaldata	Väärtpaberistamise register	Asjakohasel juhul registreeritud väärtpaberistamise registri nimi.	Ei kohaldata
STSSY9	Artikli 18 teine lõik ja artikli 27 lõige 3	Asutamise riik	Väärtpaberistamise tehingu algataja(te), sponsori(te), algse(te) laenuandja(te) ja väärtpaberistamise eriotstarbelise(te) ettevõtja(te) asutamise riik.	Ei kohaldata
STSSY10	Ei kohaldata	Sünteetilise väärtpaberistamise liigitus	Sünteetilise väärtpaberistamise liik: – otsese krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine; – kaudse krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine.	Ei kohaldata
STSSY11	Ei kohaldata	Kaudse krediidiriskikaitsega sünteetiline väärtpaberistamine	Krediidiriskikaitse müüja nimi (valitsus või riigiülene asutus riskikaaluga 0 %)	Ei kohaldata
STSSY12	Ei kohaldata	Kasutatav krediidiriskikaitse leping	Kasutatava krediidiriskikaitse lepingu liik: –	Ei kohaldata

			krediituletisinstrumentid ; – finantstagatised	
STSSY13	Ei kohaldata	Aluspositsioonide liigitus	Aluspositsioonide liik, sealhulgas: 1) kaubanduse rahastamise riskipositsioonid 2) väikeste ja keskmise suurusega ettevõtjate (VKEd) laenud 3) tarbimislaenud 4) suurte äriühingute laenud 5) nii VKEde kui ka suurte äriühingute laenud 6) ärikinnisvaraga seotud riskipositsioonid 7) muu	Ei kohaldata
STSSY14	Ei kohaldata	Emiteerimise kuupäev	Tehingu lõpuleviimise kuupäev ja krediidiriskikaitse lepingu jõustumise kuupäev, kui see erineb tehingu lõpuleviimise kuupäevast.	Ei kohaldata
STSSY15	Artikli 27 lõike 2 teine lõik	Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – kinnitus	Kui loa saanud kolmas isik on osutanud standardväärtpaberistamise kontrollimise teenuseid vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 27 lõikele 2, siis kinnitus selle kohta, et see loa saanud kolmas isik on kinnitanud vastavust standardväärtpaberistamise kriteeriumidele.	Ei kohaldata
STSSY16	Artikli 27 lõike 2 teine lõik	Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – asutamise riik	Kui loa saanud kolmas isik on osutanud standardväärtpaberistamise kontrollimise teenuseid vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 27 lõikele 2, siis selle kolmanda isiku nimi ja asutamise riik.	Ei kohaldata

STSSY17	Artikli 2 7 lõike 2 teine lõik	Loa saanud kolmandast isikust kontrollija – pädev asutus	Kui loa saanud kolmas isik on osutanud standardväärtpaberistamise kontrollimise teenuseid vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 27 lõikele 2, siis loa andnud pädeva asutuse nimi.	Ei kohaldata
STSSY18	Artikli 2 7 lõige 5	Standardväärtpaberistamise staatus	Asjakohasel juhul väärtpaberistamise tehingu algataja põhjendatud teade selle kohta, et sünteetilist väärtpaberistamist ei käsitata enam standardväärtpaberistamise na.	Ei kohaldata

## Konkreetne teave

Andmevälja kood	Määruse (EL) 2017/2402 artikkel	Andmevälja nimi	Kinnitused	Lühiselgitus	Üksikasjalik selgitus	Esitatav teave	Lisateave
STSSY19	Artikli 26b lõike 1 esimene lõik	Väärtpaberistamise tehingu algataja on liidus järelevalve alla kuuluv üksus	√			Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja on üksus, millel on liidus tegevusluba või litsents.	Ei kohaldata
STSSY20	Artikli 26b lõike 1 teine lõik	Põhimõtted, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab ostetud kolmanda isiku riskipositsioonide suhtes		√		Lühiselgitus krediidi-, sissenõudmise, võla ümberkujundamise ja haldamise põhimõtete kohta, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab enda arvel ostetud ja seejärel väärtpaberistatud kolmanda isiku riskipositsioonide suhtes ning mis ei või olla leebemad kui need, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab võrreldavate ostmata riskipositsioonide suhtes.	Ei kohaldata
STSSY21	Artikli 26b lõige 2	Aluspositsioonide algatamine		√		Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonid algatatakse väärtpaberistamise tehingu algataja põhitegevuse käigus.	Ei kohaldata
STSSY22	Artikli 26b lõike 3 esimene lõik	Väärtpaberistamise tehingu algataja bilansis hoitavad varad tehingu sulgemisel	√			Kinnitus selle kohta, et tehingu sulgemisel hoitakse aluspositsioone väärtpaberistamise tehingu algataja või väärtpaberistamise tehingu algatajaga samasse gruppi kuuluva üksuse bilansis.	Ei kohaldata
STSSY23	Artikli 26b lõike 3 teine lõik	Grupi kategooria	√			Seoses andmeväljaga STSSY22 kinnitus selle kohta, milline kahest järgmisest grupist on asjakohane: a) sellistest juriidilistest isikutest koosnev grupp, mille suhtes kohaldatakse usaldatavusnõuete kohast konsolideerimist vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 I osa II jaotise 2. peatükile; b) direktiivi 2009/138/EÜ <sup>1</sup> artikli 212 lõike 1 punktis c määratletud konsolideerimisgrupp.	Ei kohaldata
STSSY24	Artikli 26b lõige 4	Väärtpaberistamise tehingu algataja riskipositsiooni täiendavat maandamist ei toimu	√			Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja ei maanda väärtpaberistamise aluspositsioonide krediidiriski rohkem, kui see on maandatud kaitsesega, mille ta saab krediidiriskikaitse lepingu kaudu.	Ei kohaldata
STSSY25	Artikli 26b lõige 5	Krediidiriskikaitse lepingu koostöös määruse (EL) nr 575/2013 artikliga 249	√			Kinnitus selle kohta, et krediidiriskikaitse leping on koostöös krediidiriski maandamise normidega, mis on sätestatud määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 249.	Ei kohaldata
STSSY26	Artikli 26b lõige 5	Krediidiriskikaitse lepingu koostöös muude krediidiriski maandamise normidega		√		Kui määruse (EL) nr 575/2013 artikkel 249 ei ole kohaldatav, siis lühiselgitus selle kohta, et on tagatud vastavus nõuetele, mis ei ole leebemad kui nimetatud artiklis sätestatud nõuded.	Ei kohaldata
STSSY27	Artikli 26b lõike 6 punkt a	Kinnitused ja tagatised – aluspositsioonide omandiõigus		√		Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaberistamise tehingu algatajal või temaga ühte konsolideerimisgruppi kuuluval üksusel on täielik ja kehtiv aluspositsioonide omandiõigus ja seonduvad lisaõigused.	Ei kohaldata
STSSY28	Artikli 26b lõike 6 punkt b	Kinnitused ja tagatised – alusvara krediidirisk jääb väärtpaberistamise tehingu algataja bilanssi		√		Lühiselgitus väärtpaberistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et kui väärtpaberistamise tehingu algataja on määruse (EL) nr 575/2013 artikli 4 lõike 1 punktis 1 määratletud krediidiasutus või direktiivi 2009/138/EÜ artikli 13 punktis 1 määratletud kindlustusandja, jääb aluspositsioonide krediidirisk väärtpaberistamise tehingu algataja või selle üksuse bilanssi, mille üle tehakse järelevalvet konsolideeritud asusel.	Ei kohaldata

<sup>1</sup> Euroopa Parlamendi ja nõukogu 25. novembri 2009. aasta direktiiv 2009/138/EÜ kindlustus- ja edasikindlustustegevuse alustamise ja jätkamise kohta (ELT L 335, 17.12.2009, lk 1)

STSSY29	Artikli 26b lõike 6 punkt c	Kinnitused ja tagatised – vastavus sobivuskriteeriumidele		√		Lühiselgitus väärtpaperistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaperistamise portfelli lisamise kuupäeval vastab iga aluspositsioon sobivuskriteeriumidele ja kõigile krediidiriskikaitse makse tegemise tingimustele kooskõlas väärtpaperistamisdokumentide hulka kuuluva krediidiriskikaitse lepinguga, välja arvatud määruse (EL) 2017/2402 artiklis 26e lõikes 1 osutatud krediidisündmuse toimumine.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY30	Artikli 26b lõike 6 punkt d	Kinnitused ja tagatised – võlgniku seaduslik ja täitmisele pööratav kohustus		√		Lühiselgitus väärtpaperistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja parima teadmise kohaselt on iga aluspositsiooni kohta sõlmitud lepingus sätestatud, et võlgnikul on juriidiline, kehtiv ja siduv kohustus lepingus kindlaks määratud rahasummad tasuda, millele saab pöörata sissenõude.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY31	Artikli 26b lõike 6 punkt e	Kinnitused ja tagatised – laenude väljastamise kriteeriumid		V		Lühiselgitus väärtpaperistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et aluspositsioonid vastavad laenude väljastamise kriteeriumidele, mis ei ole leebemad kui standardised laenude väljastamise kriteeriumid, mida väärtpaperistamise tehingu algataja kohaldab samalaadsete väärtpaperistamata riskipositsioonide suhtes.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY32	Artikli 26b lõike 6 punkt f	Kinnitused ja tagatised – võlgnikud ei ole kohustust oluliselt rikkunud ega jätnud kohustust täitmata		V		Lühiselgitus väärtpaperistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja parima teadmise kohaselt ei ole ükski võlgnik selle kuupäeva seisuga, mil aluspositsioon väärtpaperistamise portfelli lisatakse, ühtki aluspositsiooniga seotud kohustust oluliselt rikkunud ega jätnud kohustust täitmata.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY33	Artikli 26b lõike 6 punkt g	Kinnitused ja tagatised – tehingu dokumentides vaeinfo puudumine		V		Lühiselgitus väärtpaperistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja parima teadmise kohaselt ei sisalda tehingu dokumentid aluspositsioonide üksikasjade kohta vaeinfot.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY34	Artikli 26b lõike 6 punkt h	Kinnitused ja tagatised – aluspositsioonide täidetavus või sissenõutavus		V		Lühiselgitus väärtpaperistamise tehingu algataja kinnituste ja tagatiste kohta, et tehingu sulgemise või aluspositsiooni väärtpaperistamise portfelli lisamise ajal ei ole võlgniku ja algse laenuandja vahelist lepingut asjaomase aluspositsiooni kohta muudetud viisil, mis oleks aluspositsiooni täidetavust või sissenõudmist mõjutanud.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY35	Artikli 26b lõike 7 esimene lõik	Sobivuskriteeriumid, mis ei võimalda aluspositsioonide puhul aktiivset portfelli valitsemist kaalutusõiguse alusel		V		Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonid vastavad eelnevalt kindlaks määratud, selgetele ja dokumenteeritud sobivuskriteeriumidele, mis ei võimalda nende riskipositsioonide puhul aktiivset portfelli valitsemist kaalutusõiguse alusel.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu
STSSY36	Artikli 26b lõike 7 teine lõik	Erand aktiivse portfelli valitsemise keelust		V		Seoses andmeväljaga STSSY35 lühiselgitus selle kohta, et portfelli aktiivse valitsemisena ei käsitata selliste riskipositsioonide asendamist, mis on vastuolus kinnituste või tagatistega, ja vahendite täiendamise perioodi hõlmavate väärtpaperistamiste puhul selliste riskipositsioonide lisamist, mis vastavad kindlaks määratud täiendamistingimustele.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu
STSSY37	Artikli 26b lõike 7 kolmas lõik	Pärast tehingu sulgemise kuupäeva lisatud riskipositsioonide vastavus sobivuskriteeriumidele		V		Lühiselgitus selle kohta, et pärast tehingu sulgemise kuupäeva lisatud riskipositsioonid vastavad sobivuskriteeriumidele, mis ei ole leebemad kui need, mida kohaldati aluspositsioonide algasel valimisel.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu
STSSY 38	Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt a	Täielikult tagasimakstud riskipositsioon		V		Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et see on täielikult tagasi makstud või muul viisil lunastatud.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu

STSSY 39	Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt b	Likvideeritud aluspositsioonid		V		Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioon on väärtpaperistamise tehingu algataja tavapärase äritegevuse käigus likvideeritud, tingimusel et likvideerimine ei kujuta endast määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 250 osutatud kaudset toetust.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu
STSSY 40	Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt c	Krediidist tulenevate muudatuste puudumine		V		Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et aluspositsiooni muudetakse muul kui krediidist tuleneval põhjusel, nagu võla refinantseerimine või restruktureerimine, ning muudatus tehakse asjaomase aluspositsiooni tavapärase haldamise käigus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu
STSSY 41	Artikli 26b lõike 7 neljanda lõigu punkt d	Mittevastavus sobivuskriteeriumidele		V		Kui aluspositsioon kõrvaldatakse tehingust, siis lühiselgitus selle kohta, et see aluspositsioon ei vastanud tehingusse kaasamise ajal sobivuskriteeriumidele.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa 2. jagu
STSSY 42	Artikli 26b lõike 8 esimene lõik	Varade homogeensus			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaperistamine on tagatud selliste aluspositsioonide kogumiga, mis on vara liigilt homogeensed. Seejuures viidatakse komisjoni delegeeritud määrusele (EL) 2019/1851 <sup>2</sup> .	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 43	Artikli 26b lõike 8 esimene lõik	Üksnes üht liiki varad			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas aluspositsioonide kogum koosneb üksnes üht liiki varadest.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 44	Artikli 26b lõike 8 teine lõik	Lepinguliselt siduvad ja täitmisele pööratavad kohustused		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY42 osutatud aluspositsioonid sisaldavad lepinguliselt siduvaid ja täitmisele pööratavaid kohustusi, mis annavad võlgnike ja vajaduse korral garantiandjate suhtes täieliku regressioiguse.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 45	Artikli 26b lõike 8 kolmas lõik	Kindlapiirilised perioodilised maksed			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas andmeväljal STSSY42 osutatud aluspositsioonidega kaasnevad kindlapiirilised perioodilised maksevood, mille osamaksete summad võivad erineda ning mis on seotud rendi-, põhisumma- või intressimaksetega või muu õigusega saada neid makseid toetatavelt varadelt tulu.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 46	Artikli 26b lõike 8 kolmas lõik	Tulu vara müügist			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kas ja kuidas andmeväljal STSSY42 osutatud aluspositsioonid võivad tulu anda ka finantseeritud või liisitud vara müügist.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 47	Artikli 26b lõike 8 neljas lõik	Vabalt võõrandatavate väärtpaperite puudumine			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas aluspositsioonid ei sisalda Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/65/EL <sup>3</sup> artikli 4 lõike 1 punktis 44 määratletud muid vabalt võõrandatavaid väärtpaperid kui äriühingute võlakirjad, mis ei ole kauplemiskohas noteeritud.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 48	Artikli 26b lõige 9	Edasiväärtpaperistamise keeld	V			Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonid ei sisalda väärtpaperistamise positsioone.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2
STSSY 49	Artikli 26b lõike 10 esimene lõik	Laenude väljastamise standardite avalikustamine potentsiaalsetele investoritele	V			Kinnitus selle kohta, et laenude väljastamise standardid, mille kohaselt aluspositsioonid algatatakse, ning olulised muutused võrreldes varasemate laenude väljastamise standarditega tehakse potentsiaalsetele investoritele põhjendatult viivitusega täielikult teatavaks.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7

<sup>2</sup> Komisjoni 28. mai 2019. aasta delegeeritud määrus (EL) 2019/1851, millega täiendatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrust (EL) 2017/2402 regulatiivsete tehniliste standarditega väärtpaperistamise aluspositsioonide homogeensususe kohta (ELT L 285, 6.11.2019, lk 1).

<sup>3</sup> Euroopa Parlamendi ja nõukogu 15. mai 2014. aasta direktiiv 2014/65/EL finantsinstrumentide turgude kohta ning millega muudetakse direktiive 2002/92/EÜ ja 2011/61/EL (ELT L 173, 12.6.2014, lk 349).

STSSY 50	Artikli 26b lõike 10 esimene lõik	Täielik regressiõigus võlgniku vastu	V			Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonide väljastamisel antakse täielik regressiõigus võlgniku suhtes, kes ei ole väärtpaperistamise eriotstarbeline ettevõtja.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 51	Artikli 26b lõike 10 esimene lõik	Laenude väljastamise standardid – kolmandate isikute osalemise puudumine	V			Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonidega seotud krediidi- või väljastamisotsuste tegemisel ei osale kolmandad isikud.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 52	Artikli 26b lõike 10 teine lõik	Laenude väljastamise standardid – eluasemelaenud	V			Selliste väärtpaperistamiste korral, mille aluspositsioonid on eluasemelaenud, kinnitus selle kohta, et laenukogum ei sisalda laene, mille turustamisel ja väljastamisel on tuginetud eeldusele, et laenu taotlejale, või kui see on kohaldatav, siis vahendajatele, on teada antud, et laenuandja ei pruugi esitatud teavet kontrollida.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 53	Artikli 26b lõike 10 kolmas lõik	Laenude väljastamise standardid – laenuvõtja hindamine	V			Kinnitus selle kohta, et laenuvõtja krediidivõimelisuse hindamine vastab Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2008/48/EÜ <sup>4</sup> artiklis 8 sätestatud nõuetele või Euroopa Parlamendi ja nõukogu direktiivi 2014/17/EL <sup>5</sup> artikli 18 lõigetes 1–4, artikli 18 lõike 5 punktis a ja artikli 18 lõikes 6 sätestatud nõuetele, või kui see on kohaldatav, kolmandate riikide samaväärsetele nõuetele.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 54	Artikli 26b lõike 10 neljas lõik	Väärtpaperistamise tehingu algataja või algse laenuandja asjatundlikkus	V			Kinnitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataval või algsel laenuandjal on asjatundlikkus väärtpaperistatavate riskipositsioonidega samalaadsete riskipositsioonide algatamise alal.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.7
STSSY 55	Artikli 26b lõike 11 punkt a	Makseviivitus olevate riskipositsioonide puudumine		V		Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonide valimise ajal ei kuulu nende hulka makseviivitus olevaid riskipositsioone määruse (EL) nr 575/2013 artikli 178 lõike 1 tähenduses ega riskipositsioone halvenenud krediidikvaliteediga võlgniku või garantiandja suhtes, kes väärtpaperistamise tehingu algataja või algse laenuandja parima teadmise kohaselt on kolme aasta jooksul enne algatamise kuupäeva kuulutatud maksejõuetuks või kelle võlausaldajatele on kohus andnud lõpliku ja edasikaebamisele mittekuuluva nõudeõiguse või õiguse saada makse tegemata jätmise tulemusel tekkinud kahju eest hüvitist või kelle suhtes on kolme aasta jooksul enne aluspositsioonide valimist toimunud seoses viivisnõuetega võla restruktureerimise protsess, välja arvatud juhul, kui i) restruktureeritud aluspositsiooniga ei ole kaasnenud uusi võlgnevusi alates kuupäevast, mil toimus restruktureerimine, mis peab olema toimunud vähemalt üks aasta enne aluspositsioonide valimise kuupäeva; või ii) algataja poolt vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punktile a ja punkti e alapunktile i esitatud teabes on sõnaselgelt esitatud restruktureeritud aluspositsioonide osakaal, restruktureerimise aeg ja üksikasjad ning nende tulemusnäitajad alates restruktureerimise kuupäevast. Kui mõni neist kahest erandist on kohaldatav, tuleb esitada selle kohta lühiselgitus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.8
STSSY 56	Artikli 26b lõike 11 punkt b	Varasema halva krediidiajaloo puudumine		V		Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonide valimise ajal ei kuulu nende hulka makseviivitus olevaid riskipositsioone määruse (EL) nr 575/2013 artikli 178 lõike 1 tähenduses ega	Ei kohaldata

<sup>4</sup> Euroopa Parlamendi ja nõukogu 23. aprilli 2008. aasta direktiiv 2008/48/EÜ, mis käsitleb tarbijakrediidilepinguid ja millega tunnistatakse kehtetuks nõukogu direktiiv 87/102/EMÜ (ELT L 133, 22.5.2008, lk 66).

<sup>5</sup> Euroopa Parlamendi ja nõukogu 4. veebruari 2014. aasta direktiiv 2014/17/EL elamukinnisvaraga seotud tarbijakrediidilepingute kohta ning millega muudetakse direktiive 2008/48/EÜ ja 2013/36/EL ja määrust (EL) nr 1093/2010 (ELT L 60, 28.2.2014, lk 34).

						riskipositsioone halvenenud krediidikvaliteediga võlgniku või garantiandja suhtes, kes väärtpaperistamise tehingu algataja või algse laenuandja parima teadmise kohaselt oli aluspositsiooni algatamise ajal, kui see on kohaldatav, kantud avalikku halva krediidiajalooa isikute krediidiregistrisse, või kui sellist avalikku krediidiregistrit ei eksisteerinud, muusse krediidiregistrisse, mis on algatajale või algsele laenuandjale kättesaadav.	
STSSY 57	Artikli 26b lõike 11 punkt c	Maksmata jätmise risk ei ole suurem kui väärtpaperistamata riskipositsioonide puhul		V		Lühiselgitus selle kohta, et aluspositsioonide valimise ajal ei kuulu nende hulka makseviivituses olevaid riskipositsioone määruse (EL) nr 575/2013 artikli 178 lõike 1 tähenduses ega riskipositsioone halvenenud krediidikvaliteediga võlgniku või garantiandja suhtes, kes väärtpaperistamise tehingu algataja või algse laenuandja parima teadmise kohaselt on saanud krediidikvaliteedi hinnangu või krediidikvaliteedi astme, mis näitab, et lepingus kokkulepitud maksete tegemata jätmise risk on palju suurem kui algataja hoitavate võrreldavate väärtpaperistamata riskipositsioonide puhul.	Ei kohaldata
STSSY 58	Artikli 26b lõige 12	Alusvara lisamisel vähemalt üks makse	V			Kinnitus selle kohta, et võlgnikud on aluspositsioonide lisamise ajaks teinud vähemalt ühe makse, välja arvatud juhul, kui: a) tegemist on uueneva väärtpaperistamisega, mis on tagatud ühes osas tasutavate riskipositsioonidega või mille lõpptähtaeg on lühem kui üks aasta, sealhulgas vaba tagasimaksega krediidiga seonduvad igakuised piiranguteta maksed; või b) riskipositsioon kujutab endast sellise riskipositsiooni refinantseerimist, mis on juba tehinguga hõlmatud. Kui mõni neist kahest erandist on kohaldatav, tuleb esitada selle kohta lühiselgitus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.3 ja 3.4.6
STSSY 59	Artikli 26c lõige 1	Riski säilitamise nõude täitmine			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaperistamise tehingu algataja või algne laenuandja täidab riski säilitamise nõude vastavalt määruse (EL) 2017/2402 artiklile 6.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 9. lisa punkt 3.1 ja 19. lisa punkt 3.4.3
STSSY 60	Artikli 26c lõike 2 esimene lõik	Intressimäära- ja valuutariskide maandamine	V			Kinnitus selle kohta, et: a) tehingu dokumentides kirjeldatakse väärtpaperistamisest tulenevaid intressimäära- ja valuutariske ning nende võimalikku mõju väärtpaperistamise tehingu algatajale ja investoritele tehtavatele maksetele, b) need riskid maandatakse asjakohaselt ja kõik sel otstarbel võetud meetmed avalikustatakse investoritele.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8
STSSY61	Artikli 26c lõike 2 esimene lõik	Krediidiriskikaitse tagatis ja krediidiriskikaitse makse on nomineeritud samas valuutas	V			Kinnitus selle kohta, et kõik tagatised, millega tagatakse investori kohustused krediidiriskikaitse lepingu alusel, on nomineeritud samas valuutas, milles on nomineeritud krediidiriskikaitse makse.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8
STSSY 62	Artikli 26c lõike 2 teine lõik	Väärtpaperistamise eriotstarbelise ettevõtja kohustused on võrdsed tema tuluga või sellest väiksemad		V		Lühiselgitus selle kohta, et kui väärtpaperistamisel kasutatakse väärtpaperistamise eriotstarbelist ettevõtjat, on väärtpaperistamise eriotstarbelise ettevõtja poolt investoritele tehtavate intressimaksetega seotud kohustuste summa igal maksekuupäeval võrdne tuluga, mida väärtpaperistamise eriotstarbeline ettevõtja saab väärtpaperistamise tehingu algatajalt ja tagatiskokkulepetest, või sellest väiksem.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8
STSSY 63	Artikli 26c lõike 2 kolmas lõik	Tuletisinstrumentide kasutamine ainult	V			Kinnitus selle kohta, et aluspositsioonide kogum ei sisalda tuletisinstrumente, välja arvatud juhul, kui eesmärk on aluspositsioonide intressimäära- või	Delegeeritud määruse (EL)

		intressimäära- või valutariski maandamiseks				valutariski maandamine.	2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8
STSSY 64	Artikli 26c lõike 2 kolmas lõik	Tuletisinstrumentide kasutamise vastavalt üldtunnustatud standarditele		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY63 osutatud erandi korral on kasutatavate tuletisinstrumentide emissioon tagatud ja need on dokumenteeritud vastavalt üldtunnustatud standarditele.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.2 ja 3.8
STSSY 65	Artikli 26c lõike 3 esimene ja teine lõik	Üldkasutatavatel intressimääradel põhinevad viiteintressimaksed ilma keerukate valemite või tuletisinstrumentide deta		V		Tehinguga seoses tehtavate viiteintressimääraga seotud maksete korral lühiselgitus selle kohta, kummal järgmistest need põhinevad: a) üldkasutatavad turu intressimäärad või üldkasutatavad sektoripõhised määrad, mis kajastavad vahendite kulusid, mitte aga keerukad valemid ega tuletisinstrumentid; või b) tulu, mis tuleneb tagasest, millega investori kohustused on krediidiriskikaitse lepingu alusel tagatud. Lühiselgitus selle kohta, et kõik aluspositsioonidega seoses tasumisele kuuluvad viiteintressimääraga seotud maksed põhinevad üldkasutatavatel turu intressimääradel või üldkasutatavatel sektoripõhistel määradel, mis kajastavad vahendite kulusid, mitte aga keerukat valemite ega tuletisinstrumentidel.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.2.2 ja 2.2.13
STSSY 66	Artikli 26c lõike 4 esimene lõik	Täitmisele pööramise sündmus ei piira investori täitemeetmeid		V		Lühiselgitus selle kohta, et investoril on lubatud võtta täitemeetmeid pärast täitmisele pööramise sündmust väärtpaperistamise tehingu algataja suhtes.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 67	Artikli 26c lõike 4 teine lõik	Krediidiriskikaitse lepingu täitmisele pööramine – ükski rahasumma ei jää väärtpaperistamise eriotstarbelisest ettevõtjast üle kandmata		V		Kui väärtpaperistamisel kasutatakse väärtpaperistamise eriotstarbelist ettevõtjat ja täitmise teade või krediidiriskikaitse lepingu lõpetamise teade on kätte toimetatud, siis lühiselgitus selle kohta, et ükski rahasumma ei jää väärtpaperistamise eriotstarbelisest ettevõtjast üle kandmata, välja arvatud see, mis on vajalik väärtpaperistamise eriotstarbelise ettevõtja toimimiseks, selliste makseviivituses aluspositsioonide eest kaitsemaksete tegemiseks, mis olid lõpetamise ajal veel ümberkujundamisel, ja investoritele korrapäraste tagasimaksete tegemiseks kooskõlas väärtpaperistamise lepingu tingimustega.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 68	Artikli 26c lõike 5 esimene lõik	Kahjude jaotamine nõudeõiguse järgu alusel		V		Lühiselgitus selle kohta, et kahjud jaotatakse väärtpaperistamise positsiooni omanikele vastavalt väärtpaperistamise seeria nõudeõiguse järgule, alustades kõige madalama nõudeõiguse järguga väärtpaperistamise seeriast.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 69	Artikli 26c lõike 5 teine lõik	Järjestikune amortiseerimine		V		Lühiselgitus selle kohta, et igal maksekuupäeval väärtpaperistamise seeriaste tagasimaksmata summa kindlakstegemiseks kohaldatakse kõigi väärtpaperistamise seeriaste suhtes järjestikust amortiseerimist, alustades kõige kõrgema nõudeõiguse järguga väärtpaperistamise seeriast.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 70	Artikli 26c lõike 5 kolmas lõik	Mittejärjestikune maksehierarhia		V		Erandina andmeväljast STSSY 69 lühiselgitus selle kohta, et tehingutes, mille puhul kohaldatakse mittejärjestikust maksehierariat, nähakse ette aluspositsioonide tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid, mis tingivad maksehieraria ümberpööramise nii, et amortiseerimisel hakatakse makseid tegema vastavalt nõudeõiguse järgule.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 71	Artikli 26c lõike 5 kolmanda lõigu punkt a	Tulemusnäitajatega seotud käivitavad tegurid		V		Üksikasjalik selgitus andmeväljal STSSY70 osutatud kohustusliku tulemusnäitajatega seotud käivitava teguri kohta, milleks on kas makseviivituses olevate riskipositsioonide kumulatiivse summa suurenemine või kumulatiivse kahju suurenemine üle teatava protsendi alusportfelli tagasimaksmata summast.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5

STSSY 72	Artikli 26c lõike 5 kolmanda lõigu punkt b	Tulemusnäitajate ja seotud käivitavad tegurid			V	Üksikasjalik selgitus andmeväljal STSSY70 osutatud möödunud perioodiga seotud käivitava lisateguri kohta.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 73	Artikli 26c lõike 5 kolmanda lõigu punkt c	Tulemusnäitajate ja seotud käivitavad tegurid			V	Üksikasjalik selgitus andmeväljal STSSY70 osutatud eesmiseva perioodiga seotud käivitava teguri kohta.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 74	Artikli 26c lõike 5 seitsmes lõik	Amortiseeritavate väärtpaberistamise seeriade summaga võrdne tagatise summa			V	Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaberistamise seeriade amortiseerudes tagastatakse investoritele tagatise summa, mis on võrdne nende seeriade amortisatsiooni summaga, eeldusel et investorid on nende seeriade kohta tagatise esitanud.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 75	Artikli 26c lõike 5 kaheksas lõik	Toimunud krediidisündmus ja krediidiriskikaitse summa igal maksekuupäeval			V	Lühiselgitus selle kohta, et kui seoses aluspositsioonidega on toimunud andmeväljadel STSSY100 või STSSY101 osutatud krediidisündmus ja võla ümberkujundamine ei ole nende puhul lõpule viidud, peab järelejäänud krediidiriskikaitse summa olema igal maksekuupäeval vähemalt nende aluspositsioonide tagasimaksmata nimiväärtusega, millest on maha arvatud kõigi nende aluspositsioonidega seoses tehtud vahepealsete maksete summa.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.5
STSSY 76	Artikli 26c lõike 6 punkt a	Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – krediidikvaliteet			V	Kui väärtpaberistamise puhul on tegemist uueneva väärtpaberistamisega, siis lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad asjakohaseid ennetähtaegse amortiseerimise klausleid või käivitavaid tegureid, mis tingivad uueneva väärtpaberistamise perioodi lõppemise, kui aluspositsioonide krediidikvaliteet halveneb eelnevalt kindlaks määratud künniseni või sellest allapoole.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.3 ja 2.4
STSSY 77	Artikli 26c lõike 6 punkt b	Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – kahju			V	Kui väärtpaberistamise puhul on tegemist uueneva väärtpaberistamisega, siis lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad asjakohaseid ennetähtaegse amortiseerimise klausleid või käivitavaid tegureid, mis tingivad uueneva väärtpaberistamise perioodi lõppemise, kui kahju suureneb üle eelnevalt kindlaks määratud künnise.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.3 ja 2.4
STSSY 78	Artikli 26c lõike 6 punkt c	Ennetähtaegse amortiseerimise klauslid või käivitavad tegurid – uued aluspositsioonid			V	Kui väärtpaberistamise puhul on tegemist uueneva väärtpaberistamisega, siis lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad asjakohaseid ennetähtaegse amortiseerimise klausleid või käivitavaid tegureid, mis tingivad uueneva väärtpaberistamise perioodi lõppemise, kui kindlaksmääratud ajavahemikul ei looda piisaval hulgal uusi aluspositsioone, mis vastaksid eelnevalt kindlaks määratud krediidikvaliteedile.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 2.3 ja 2.4
STSSY 79	Artikli 26c lõike 7 punkt a	Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – nõudehaldaja			V	Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt märgitud nõudehaldaja lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2
STSSY 80	Artikli 26c lõike 7 punkt a	Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – usaldusisik			V	Lühiselgitus selle kohta, et asjakohasel juhul on tehingu dokumentides selgelt märgitud usaldusisiku ja muude kõrvalteenuste osutajate lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2
STSSY 81	Artikli 26c lõike 7 punkt a	Lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus – kontrolli tegev kolmas isik			V	Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt märgitud andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegeva kolmanda isiku lepingulised kohustused, ülesanded ja vastutus.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2

STSSY 82	Artikli 26c lõike 7 punkt b	Teenuseosutajate asendamine nende makseviivituse või maksejõuetuse korral		V		Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt kindlaks määratud sätted, mis tagavad nõudehaldaja, usaldusisiku, muude kõrvalteenuste osutajate või andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegeva kolmanda isiku asendamise, kui üks nimetatud teenuseosutajatest on makseviivituses või maksejõuetu ning kui teenuseosutaja ei ole väärtpaberistamise tehingu algataja, nii et kõnealuste teenuste osutamine ei lõpe.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.2
STSSY 83	Artikli 26c lõike 7 punkt c	Nõuete haldamise protseduurid		V		Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt kindlaks määratud nõuete haldamise protseduurid, mida rakendatakse aluspositsioonide suhtes tehingu sulgemise kuupäeval ja pärast seda, ning asjaolud, mille korral võib selliseid protseduure muuta.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6
STSSY 84	Artikli 26c lõike 7 punkt d	Nõuete haldamise standardid		V		Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on selgelt kindlaks määratud nõuete haldamise standardid, mida nõudehaldaja on kohustatud aluspositsioonide haldamise käigus järgima kogu väärtpaberistamise kestuse jooksul.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6
STSSY 85	Artikli 26c lõike 8 esimene lõik	Nõudehaldaja nõutav asjatundlikkus		V		Lühiselgitus selle kohta, et nõudehaldajal on asjatundlikkus väärtpaberistatud positsioonidega samalaadsete positsioonide haldamise alal.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6
STSSY 86	Artikli 26c lõike 8 esimene lõik	Hästi dokumenteeritud ja asjakohased põhimõtted, protseduurid ja riskijuhtimise kontrollimeetmed	V			Kinnitus selle kohta, et nõudehaldajal on seoses riskipositsioonide haldamisega olemas hästi dokumenteeritud ja asjakohased põhimõtted, protseduurid ja riskijuhtimise kontrollimeetmed.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6
STSSY 87	Artikli 26c lõike 8 teine lõik	Vähemalt sama ranged haldamise protseduurid kui need, mida kohaldatakse sarnaste väärtpaberistamata riskipositsioonide suhtes	V			Lühiselgitus selle kohta, et nõudehaldaja kohaldab aluspositsioonide haldamise protseduure, mis on vähemalt sama ranged kui protseduurid, mida väärtpaberistamise tehingu algataja kohaldab samalaadsete väärtpaberistamata riskipositsioonide suhtes.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 3.4.6
STSSY 88	Artikli 26c lõige 9	Alusvara registri olemasolu			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaberistamise tehingu algataja peab ajakohastatud alusvara registrit, et aluspositsioone igal ajal kindlaks teha.	Ei kohaldata
STSSY 89	Artikli 26c lõige 9	Alusvara register – sisu		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 88 osutatud alusvara register sisaldab andmeid krediidituletsinstrumendi tingimuste aluseks oleva võlainstrumendi emiteerinud võlgnike kohta ja selle krediidituletsinstrumendi tingimuste aluseks oleva võlainstrumendi kohta, millest aluspositsioonid tulenevad, ning iga aluspositsiooni puhul nimiväärtust, mis on kaitstud ja tagasimaksmata.	Ei kohaldata
STSSY 90	Artikli 26c lõige 10	Eri kategooria investorite vaheliste konfliktide õigeaegne lahendamine	V			Kinnitus selle kohta, et tehingu dokumendid sisaldavad selgeid sätteid, mis võimaldavad aegsasti lahendada konflikte eri kategooria investorite vahel.	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punktid 3.4.7 ja 3.4.8
STSSY 91	Artikli 26c lõige 10	Väärtpaberistamise eriotstarbeline ettevõtja – selgelt kindlaks määratud hääleõigused	V			Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise eriotstarbelise ettevõtja kasutamise korral on hääleõigused selgelt kindlaks määratud ja võlakirjaomanike vahel jaotatud ning usaldusisiku ja muude investorite ees usaldusülesandeid täitvate üksuste kohustused on selgelt kindlaks määratud.	Ei kohaldata
STSSY 92	Artikli 26d lõige 1	Varasemad makseviivituse ja kahjumi tulemusnäitajad	V			Kinnitus selle kohta, et enne hinnakujundust tehakse potentsiaalsetele investoritele kättesaadavaks andmed varasemate staatiliste ja dünaamiliste makseviivituse ja kahjumi tulemusnäitajate kohta (mis hõlmavad vähemalt viieaastast perioodi), nagu viivis seisundit ja	Delegeeritud määruse (EL) 2019/980 19. lisa punkt 2.2.2

						makseviivitust kajastavad andmed, selliste riskipositsioonide puhul, mis on üldjoontes sarnased väärtpaperistatavate positsioonidega; samuti nende andmete allikad ja asjaolud, mille alusel peetakse positsioone sarnaseks.	
STSSY 93	Artikli 26d lõige 2	Aluspositsioonide valimi väliskontroll	V			Kinnitus selle kohta, et enne tehingu sulgemist teeb asjakohane sõltumatu isik aluspositsioonide valimi väliskontrolli ja kontrollib muu hulgas, kas aluspositsioonid kvalifitseeruvad krediidiriskikaitse lepingu alusel krediidiriskikaitse saamiseks.	Ei kohaldata
STSSY 94	Artikli 26d lõige 3	Kohustiste rahavoo mudeli kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele	V			Kinnitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja teeb potentsiaalsetele investoritele enne väärtpaperistamise hinnakujundust kättesaadavaks kohustiste rahavoo mudeli, mis kajastab täpselt lepingul põhinevat seost aluspositsioonide ning väärtpaperistamise tehingu algataja, investorite, muude kolmandate isikute, ja kui see on asjakohane, väärtpaperistamise eriotstarbelise ettevõtja vahel liikuvate maksete vahel, ning teeb selle mudeli pärast hinnakujundust kättesaadavaks investoritele jooksvalt ja potentsiaalsetele investoritele nende taotluse korral.	Ei kohaldata
STSSY 95	Artikli 26d lõike 4 esimene lõik	Eluasemelaenudest või autolaenudest või -liisingutest koosnevate aluspositsioonide keskkonnatoime avaldamine		V		Väärtpaperistamise puhul, mille aluspositsioonid on eluasemelaenud või autolaenud või -liisingud, ja kui ei kohaldata andmeväljal STSSY 96 osutatud erandit, lühiselgitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja teeb määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punkti a kohaselt avalikustatava teabe osana kättesaadavaks teabe laenudega rahastatavate varade keskkonnatoime kohta.	Ei kohaldata
STSSY 96	Artikli 26d lõike 4 teine lõik	Erand eluasemelaenudest või autolaenudest või -liisingutest koosnevate aluspositsioonide keskkonnatoime avaldamise nõudest		V		Kui väärtpaperistamise tehingu algataja otsustab teha erandi andmeväljal STSSY 95 nõudest, siis lühiselgitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja avaldab kättesaadava teabe aluspositsioonidest rahastatavate varade põhilise negatiivse mõju kohta kestlikkusteguritele.	Ei kohaldata
STSSY97	Artikli 26d lõige 5	Väärtpaperistamise tehingu algataja vastutus määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 täitmise eest	V			Kinnitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja vastutab määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 täitmise eest.	Ei kohaldata
STSSY 98	Artikli 26d lõige 5	Määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punkti a kohase teabe kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele	V			Kinnitus selle kohta, et määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punktis a nõutud teave tehakse potentsiaalsetele investoritele taotluse korral enne hinnakujundust kättesaadavaks.	Ei kohaldata
STSSY 99	Artikli 26d lõige 5	Määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 punktide b, c ja d kohase teabe kättesaadavus potentsiaalsetele investoritele vähemalt kavandina või esialgsel kujul	V			Kinnitus selle kohta, et määruse (EL) 2017/2402 artikli 7 lõike 1 esimese lõigu punktides b, c ja d nõutud teave tehakse enne hinnakujundust kättesaadavaks vähemalt kavandina või esialgsel kujul ning seejärel tehakse lõplikud dokumendid investoritele kättesaadavaks hiljemalt 15 päeva jooksul pärast tehingu sulgemist.	Ei kohaldata
STSSY 100	Artikli 26e lõike 1 esimese lõigu punkt a	Krediidisündmused ja garantiide kasutamine		V		Kui riski ülekandmiseks kasutatakse garantiisid, siis lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse leping hõlmab vähemalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 215 lõike 1 punktis a osutatud krediidisündmusi.	Ei kohaldata
STSSY 101	Artikli 26e lõike 1 esimese lõigu punkt b	Krediidisündmused ja krediituletitisinstrumentide kasutamine		V		Kui riski ülekandmiseks kasutatakse krediituletitisinstrumente, siis lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse leping hõlmab vähemalt määruse (EL) nr 575/2013 artikli 216 lõike 1 punktis a	Ei kohaldata

						osutatud krediidisündmusi.	
STSSY 102	Artikli 26e lõike 1 teine lõik	Krediidiriskikaitse lepingu dokumenteerimine		V		Lühiselgitus selle kohta, et kõik krediidisündmused dokumenteeritakse.	Ei kohaldata
STSSY 103	Artikli 26e lõike 1 kolmas lõik	Võla restruktureerimise meetmed ei välista sobivate krediidisündmuste käivitumist		V		Lühiselgitus selle kohta, et määruse (EL) nr 575/2013 artikli 47b tähenduses võla restruktureerimise meetmed, mida kohaldatakse aluspositsioonide suhtes, ei välista sobivate krediidisündmuste käivitumist.	Ei kohaldata
STSSY 104	Artikli 26e lõike 2 esimene lõik	Krediidiriskikaitse makse põhineb tegelikul realiseerunud kahjumil ning standardsetel sissenõudmispõhimõtete ja -menetlustel		V		Lühiselgitus selle kohta, et pärast krediidisündmuse toimumist arvutatakse krediidiriskikaitse makse väärtpaperistamise tehingu algataja või alge laenuandja asjaomast liiki riskipositsioonidest tegelikult realiseerunud kahjumi põhjal, milleni jõuti tema standardsete sissenõudmispõhimõtete ja -menetlustega kooskõlas toimunud ümberkujundamise järel ning mis on makse tegemise ajal kajastatud tema finantsaruannetes.	Ei kohaldata
STSSY 105	Artikli 26e lõike 2 esimene lõik	Kindlaksmääratud aja jooksul tasutav krediidiriskikaitse makse		V		Lühiselgitus selle kohta, et lõplik krediidiriskikaitse makse tasutakse kindlaksmääratud ajavahehiku jooksul pärast asjaomast riskipositsiooni puudutava võla ümberkujundamise lõppu, kui võla ümberkujundamine lõpeb enne graafikujärgset õiguslikku tähtaega või krediidiriskikaitse lepingu ennetähtaegset lõpetamist.	Ei kohaldata
STSSY 106	Artikli 26e lõike 2 esimene lõik	Vahepealne krediidiriskikaitse makse hiljemalt kuus kuud pärast krediidisündmust		V		Kui kahjumliku võla ümberkujundamist ei ole asjaomase aluspositsiooni puhul lõpule viidud määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 2 teises lõigus osutatud kuuekuulise perioodi lõpuks, siis lühiselgitus selle kohta, et vahepealne krediidiriskikaitse makse tehakse hiljemalt kuue kuu möödumisel andmeväljadel STSSY100 ja STSSY101 osutatud krediidisündmuse toimumisest.	Ei kohaldata
STSSY 107	Artikli 26e lõike 2 teise lõigu punktid a ja b	Vahepealne krediidiriskikaitse makse on suurem kui asjakohane oodatav kahju		V		Lühiselgitus selle kohta, et vahepealne krediidiriskikaitse makse katab vähemalt järgmistest summadest suurema: a) oodatava kahju summa, mis võrdub väärtuse langusega, mille väärtpaperistamise tehingu algataja on kandnud vahepealse makse tegemise ajal kooskõlas kohaldatava raamatupidamistavaga oma finantsaruannetes, eeldusel et krediidiriskikaitse lepingut ei ole olemas ja see ei kata kahjumit; või b) kui see on asjakohane, siis oodatava kahju summa, mis on määratud kindlaks vastavalt määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 3. peatükile.	Ei kohaldata
STSSY 108	Artikli 26e lõike 2 kolmas lõik	Vahepealse krediidiriskikaitse makse tingimused		V		Vahepealse krediidiriskikaitse makse tegemise korral lühiselgitus selle kohta, et tehakse ka andmeväljal STSSY106 osutatud lõplik krediidiriskikaitse makse, millega kohandatakse kahju vahepealset arveldamist vastavalt tegelikule realiseerunud kahjumile.	Ei kohaldata
STSSY 109	Artikli 26e lõike 2 neljas lõik	Vahepealse ja lõpliku krediidiriskikaitse makse arvutamise meetod		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus määratakse kindlaks vahepealse ja lõpliku krediidiriskikaitse makse arvutamise meetod.	Ei kohaldata
STSSY 110	Artikli 26e lõike 2 viies lõik	Krediidiriskikaitse makse on proportsionaalne tagasimaksmata osa nimiväärtusega		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse makse on proportsionaalne krediidiriskikaitse lepinguga hõlmatud vastava aluspositsiooni tagasimaksmata osa nimiväärtusega.	Ei kohaldata
STSSY 111	Artikli 26e lõike 2 kuues lõik	Krediidiriskikaitse makse täitmisele pööratavus		V		Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja õigus krediidiriskikaitse maksele on täitmisele pööratav.	Ei kohaldata

STSSY 112	Artikli 26e lõike 2 kuues lõik	Krediidiriskikaitse lepingu kohaselt investorite makstav summa on krediidiriskikaitse lepingus kindlaks määratud		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu kohaselt investorite makstav summa on krediidiriskikaitse lepingus selgelt kindlaks määratud ja piiratud.	Ei kohaldata
STSSY 113	Artikli 26e lõike 2 kuues lõik	Summade arvutamine kõikidel juhtudel		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu alusel investorite makstavaid summasid on võimalik igal juhul arvutada.	Ei kohaldata
STSSY 114	Artikli 26e lõike 2 kuues lõik	Investorite maksete asjaolud on krediidiriskikaitse lepingus kindlaks määratud		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus on selgelt määratud kindlaks asjaolud, mille korral investorid on kohustatud makseid tegema.	Ei kohaldata
STSSY 115	Artikli 26e lõike 2 kuues lõik	Kontrolli tegeva kolmanda isiku hinnang asjaoludele, mis tingivad investorite maksed		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik hindab, kas on tekkinud krediidiriskikaitse lepingus sätestatud asjaolud, mille korral investorid on kohustatud makseid tegema.	Ei kohaldata
STSSY 116	Artikli 26e lõike 2 seitsmes lõik	Krediidiriskikaitse makse summa arvutamine üksiku aluspositsiooni tasandil		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse makse summa arvutatakse selle üksiku aluspositsiooni tasandil, mille puhul on toimunud krediidisündmus.	Ei kohaldata
STSSY 117	Artikli 26e lõike 3 esimene lõik	Võla ümberkujundamise maksimaalse pikendusperioodi kindlaksmääramine		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus on kindlaks määratud maksimaalne pikendusperiood, mida kohaldatakse võla ümberkujundamisele selliste aluspositsioonide puhul, millega seoses on toimunud määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõikes 1 osutatud krediidisündmus, kuid võla ümberkujundamist ei ole graafikujärgsel õiguslikul tähtajal või krediidiriskikaitse lepingu ennetähtaegsel lõpetamisel lõpule viidud.	Ei kohaldata
STSSY 118	Artikli 26e lõike 3 esimene lõik	Pikendusperiood on lühem kui kaks aastat		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 117 osutatud pikendusperiood ei ole pikem kui kaks aastat.	Ei kohaldata
STSSY 119	Artikli 26e lõike 3 esimene lõik	Lõplik krediidiriskikaitse makse väärtpaperistamise tehingu algataja lõpliku kahju hinnangu alusel		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingus nähakse ette, et andmeväljal STSSY 117 osutatud pikendusperioodi lõpuks tehakse viimane krediidiriskikaitse makse väärtpaperistamise tehingu algataja lõpliku kahju hindamise põhjal, mille väärtpaperistamise tehingu algataja kajastab selleks ajaks oma finantsaruannetes eeldusel, et krediidiriskikaitse lepingut ei ole olemas ja see ei kata kahjumit.	Ei kohaldata
STSSY 120	Artikli 26e lõike 3 teine lõik	Krediidiriskikaitse lepingu lõpetamine		V		Kui krediidiriskikaitse leping lõpetatakse, siis lühiselgitus selle kohta, et võla ümberkujundamine seoses enne lõpetamist toimunud võimalike lahendamata krediidisündmustega jätkub samal viisil, nagu on kirjeldatud määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 3 esimeses lõigus.	Ei kohaldata
STSSY 121	Artikli 26e lõike 3 kolmas lõik	Krediidiriskikaitse preemiad sõltuvad tagasimaksmata osa nimiväärtusest		V		Lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu alusel makstavad krediidiriskikaitse preemiad on struktureeritud nii, et need sõltuvad nõuetekohaselt teenindatavate nõuete tagasimaksmata osa nimiväärtusest maksmise ajal ja kajastavad kaitstud väärtpaperistamise seeria riski.	Ei kohaldata
STSSY 122	Artikli 26e lõike 3 kolmas lõik	Krediidiriskikaitse lepingus ei määrata kindlaks mehhanisme, mis võivad ära hoida või vähendada kahju tegelikku jaotamist		V		Lühiselgitus selle kohta, et seoses andmeväljal STSSY117 osutatuga ei määrata krediidiriskikaitse lepingus kindlaks garanteeritud preemiaid, preemiate ettemakseid, hinnaalandusmehhanisme ega muid mehhanisme, mis võivad ära hoida või vähendada kahju tegelikku jaotamist investoritele või mille abil tagastatakse	Ei kohaldata

		investoritele				väärtpaperistamise tehingu algatajale osa makstud preemiast pärast tehingu lõpptähtaega.	
STSSY 123	Artikli 26e lõike 3 neljas lõik	Erand seoses preemiate ettemaksetega		V		Lühiselgitus selle kohta, et erandina andmeväljadest STSSY121 ja STSSY122 on preemiate ettemaksete lubatud juhul, kui garantiiskeem on liikmesriigi õiguses konkreetset ette nähtud ja sellele on andnud edasigarantii mõni määruse (EL) nr 575/2013 artikli 214 lõike 2 punktides a–d loetletud üksus, tingimusel et järgitakse riigiabi eeskirju.	Ei kohaldata
STSSY 124	Artikli 26e lõike 3 viies lõik	Krediidiriskikaitse preemia kirjeldus tehingu dokumentides		V		Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides kirjeldatakse, kuidas arvutatakse krediidiriskikaitse preemiad ja võimalikud võimalikud võlakirjakupongid iga maksekuupäeva puhul kogu väärtpaperistamise tehingu kestuse jooksul.	Ei kohaldata
STSSY 125	Artikli 26e lõike 3 kuues lõik	Investorite õiguste täitmisele pööratavus		V		Lühiselgitus selle kohta, et investorite õigus saada krediidiriskikaitse preemiaid on täitmisele pööratav.	Ei kohaldata
STSSY 126	Artikli 26e lõike 4 esimene lõik	Kontrolli tegeva kolmanda isiku määramine enne tehingu sulgemise kuupäeva	V			Kinnitus selle kohta, et enne tehingu sulgemise kuupäeva määrab väärtpaperistamise tehingu algataja kontrolli tegeva kolmanda isiku.	Ei kohaldata
STSSY 127	Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt a	Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – krediidiriskikaitse lepingu tingimustes osutatud krediidisündmus	V			Kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kas tegemist on krediidiriskikaitse lepingu tingimustes osutatud krediidisündmusega.	Ei kohaldata
STSSY 128	Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt b	Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – aluspositsiooni kuulumine alusportfelli	V			Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY 126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas aluspositsioon oli asjaomase krediidisündmuse toimumise ajal alusportfellis.	Ei kohaldata
STSSY 129	Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt c	Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – vastavus sobivuskriteeriumidele alusportfelli lisamise ajal	V			Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas aluspositsioon vastas alusportfelli lisamise ajal sobivuskriteeriumidele.	Ei kohaldata
STSSY 130	Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt d	Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – vastavus täiendamistingimuste	V			Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas täiendamine vastas täiendamistingimustele, kui aluspositsioon lisati väärtpaperistamisele täiendamise tulemusel.	Ei kohaldata
STSSY 131	Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt e	Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – kahju vastavus väärtpaperistamise tehingu algataja kasumiaruandele	V			Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas lõpliku kahjumi summa vastab väärtpaperistamise tehingu algataja kasumiaruandes kajastatud kahjumile.	Ei kohaldata
STSSY 132	Artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punkt f	Kontrolli tegeva kolmanda isiku kontroll – kahjude õige jagamine investorite vahel	V			Iga aluspositsiooni puhul, millega seoses on esitatud krediidisündmuse teade, kinnitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik kontrollib, kas viimase krediidiriskikaitse makse tasumise ajal on aluspositsioonidega seotud kahjud investorite vahel õigesti jagatud.	Ei kohaldata
STSSY 133	Artikli 26e lõike 4 teine lõik	Kontrolli tegev kolmas isik on väärtpaperistamise tehingu algatajast, investoritest ja (asjakohasel juhul)		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik on väärtpaperistamise tehingu algatajast ja investoritest ning asjakohasel juhul väärtpaperistamise eriotstarbelisest ettevõtjast sõltumatu.	Ei kohaldata

		väärtpaperistamis e eriotstarbelisest ettevõtjast sõltumatu					
STSSY 134	Artikli 26e lõike 4 teine lõik	Kontrolli tegeva kolmanda isiku määramine tehingu sulgemise kuupäevaks		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik on andnud tehingu sulgemise kuupäevaks nõusoleku kontrolli tegevaks kolmandaks isikuks määramisele.	Ei kohaldata
STSSY 135	Artikli 26e lõike 4 kolmas lõik	Kontrolli tegeva kolmanda isiku valimipõhine kontroll		V		Lühiselgitus selle kohta, et andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegev kolmas isik teeb kontrolli valimi alusel, mitte iga üksiku aluspositsiooni alusel, mille jaoks krediidiriskikaitse makset nõutakse.	Ei kohaldata
STSSY 136	Artikli 26e lõike 4 kolmas lõik	Investorite võimalus taotleda, et kontrolli tegev kolmas isik kontrolliks konkreetsed aluspositsioone		V		Lühiselgitus selle kohta, kas ja kuidas investorid võivad taotleda mis tahes konkreetsed aluspositsiooni sobivuse kontrollimist, kui nad ei ole valimipõhise kontrolliga rahul.	Ei kohaldata
STSSY 137	Artikli 26e lõike 4 neljas lõik	Kontrolli tegeva kolmanda isiku juurdepääs kogu asjakohasele teabele		V		Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja lisab tehingu dokumentidesse kohustuse edastada andmeväljal STSSY126 osutatud kontrolli tegevale kolmandale isikule kogu teave, mis on vajalik määrase (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 4 esimese lõigu punktides a–f sätestatud nõuete täitmise kontrollimiseks.	Ei kohaldata
STSS 138	Artikli 26e lõike 5 esimese lõigu punktid a–f	Lõpetamissündmu sed		V		Lühiselgitus selle kohta, et väärtpaperistamise tehingu algataja ei või tehingut lõpetada enne selle graafikujärgset lõpptähtaega ühelgi muul põhjusel kui määrase (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 5 punktides a–f loetletud sündmused.	Ei kohaldata
STSS 139	Artikli 26e lõike 5 teine lõik	Tehingu dokumendid – ostuoptsioonid		V		Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on täpsustatud, kas asjaomane tehing hõlmab mõnda määrase (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 5 esimese lõigu punktides d ja e osutatud ostuoptsiooni ja kuidas sellised optsioonid on struktureeritud.	Ei kohaldata
STSS 140	Artikli 26e lõike 5 kolmas lõik	Tehingu dokumendid – ajaline ostuoptsioon ei ole struktureeritud eesmärgiga vältida kahju jaotamist krediidikvaliteedi parandamise positsioonidele		V		Määrase (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 5 esimese lõigu punkti d kohaldamisel lühiselgitus selle kohta, et ajaline ostuoptsioon ei ole struktureeritud eesmärgiga vältida kahju jaotamist krediidikvaliteedi parandamise positsioonidele või muudele investorite omatavatele positsioonidele ega muul viisil struktureeritud krediitikvaliteedi parandamise võimaldamiseks.	Ei kohaldata
STSS 141	Artikli 26e lõike 5 neljas lõik	Ostuoptsioon		V		Kui tehing hõlmab ajalist ostuoptsiooni, siis lühiselgitus selle kohta, et andmeväljadel STSS139 ja STSS 140 osutatud nõuded on täidetud, sealhulgas ajalise ostuoptsiooni kasutamise põhjendus ja usutav teave, millest nähtub, et ostuoptsiooni kasutamise põhjuseks ei ole alusvara kvaliteedi halvenemine.	Ei kohaldata
STSS 142	Artikli 26e lõike 5 viies lõik	Otsene krediidiriskikaitse – tagatise tagastamine investoritele vastavalt väärtpaperistamis e seeriate nõudeõiguse järgule		V		Otsese krediidiriskikaitse korral lühiselgitus selle kohta, et krediidiriskikaitse lepingu lõpetamisel tagastatakse tagatis investoritele vastavalt väärtpaperistamise seeriate nõudeõiguse järgule, kohaldades väärtpaperistamise tehingu algataja suhtes kohaldatavaid asjakohaseid maksejõuetust käsitlevaid õigusnorme.	Ei kohaldata
STSS 143	Artikli 26e lõige 6	Tehingu lõpetamine investorite poolt, kui krediidiriskikaitse preemia jäetakse maksmata		V		Lühiselgitus selle kohta, et investorid ei või lõpetada tehingut enne selle kavandatud lõpptähtaega ühelgi muul põhjusel kui krediidiriskikaitse preemia maksmata jätmine või muu lepingulise kohustuse oluline rikkumine väärtpaperistamise tehingu algataja poolt.	Ei kohaldata

STSSY 144	Artikli 26e lõike 7 punkt a	Investoritele pakutava sünteetilise ületulu summa on kindlaks määratud tehingu dokumentides ja väljendatud kindla protsendina portfelli tagasimaksmata summast		V		Kui väärtpaperistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediitkvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et sünteetilise ületulu summa, mida väärtpaperistamise tehingu algataja kohustub kasutama krediitkvaliteedi parandamiseks igal makseperioodil, on kindlaks määratud tehingu dokumentides ja väljendatud kindla protsendina portfelli tagasimaksmata summast asjaomase makseperioodi alguses (fikseeritud sünteetiline ületulu).	Ei kohaldata
STSSY 145	Artikli 26e lõike 7 punkt b	Kasutamata sünteetilise ületulu tagastamine väärtpaperistamise tehingu algatajale		V		Kui väärtpaperistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediitkvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et sünteetiline ületulu, mida ei kasutata selleks, et katta igal makseperioodil realiseerunud krediitkajum, tagastatakse väärtpaperistamise tehingu algatajale.	Ei kohaldata
STSSY 146	Artikli 26e lõike 7 punkt c	Sisereitingute meetodit kasutavad väärtpaperistamise tehingu algatajad – aasta kohta ette nähtud summa ei ole suurem kui regulatiivne aastane oodatav kahju		V		Kui väärtpaperistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediitkvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 143 osutatud sisereitingute meetodi kasutamise korral ei ole ette nähtud kogusumma aasta kohta suurem kui kõigi aluspositsioonide asjaomase aasta oodatava kahju summa, mis on arvatud vastavalt nimetatud määruse artiklile 158.	Ei kohaldata
STSSY 147	Artikli 26e lõike 7 punkt d	Väärtpaperistamise tehingu algatajad, kes ei kasuta sisereitingute meetodit – alusportfelli ühe aasta oodatava kahju arvutamine määratakse selgelt kindlaks tehingu dokumentides		V		Kui väärtpaperistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediitkvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et kui väärtpaperistamise tehingu algataja ei kasuta määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 143 osutatud sisereitingute meetodit, määratakse alusportfelli ühe aasta oodatava kahju arvutamine selgelt kindlaks tehingu dokumentides.	Ei kohaldata
STSSY 148	Artikli 26e lõike 7 punkt e	Sünteetilise ületulu tingimuste sätestamine tehingu dokumentides		V		Kui väärtpaperistamise tehingu algataja näeb ette sünteetilise ületulu, mida pakutakse investoritele krediitkvaliteedi parandamiseks, siis lühiselgitus selle kohta, et määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõikes 7 ette nähtud tingimused on sätestatud tehingu dokumentides.	Ei kohaldata
STSS 149	Artikli 26e lõike 8 punktid a, b ja c	Kasutatav krediitriskikaitse		V		Lühiselgitus selle kohta, millisele järgmistest vormidest krediitriskikaitse leping vastab: a) määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 4. peatükis sätestatud nõuetele vastav garantii, millega krediitrisk kantakse üle mõnele määruse (EL) nr 575/2013 artikli 214 lõike 2 punktides a–d loetletud üksusele, tingimusel et investorite suhtes olevate riskipositsioonide puhul saab nimetatud määruse III osa II jaotise 2. peatüki alusel kasutada 0 % riskikaalu; b) määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 4. peatükis sätestatud nõuetele vastav garantii, millel on mõne käesoleva lõike punktis a osutatud üksuse edasigarantii; c) punktides a ja b osutamata muu krediitriskikaitse selliste garantiide, krediituletisinstrumentide või krediitrisiki vahetustehingut sisaldavate võlakirjade kujul, mis vastavad määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 249 sätestatud nõuetele, tingimusel et investorite kohustused on tagatud tagatisega, mis vastab määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõigetes 9 ja 10 sätestatud nõuetele.	Ei kohaldata

STSSY 150	Artikli 26e lõike 9 esimese lõigu punkt a	Väärtpaberistamise tehingu algataja õigus kasutada tagatist investorite krediidiriskikaitse maksetega seotud kohustuste täitmiseks on asjakohaste tagatiskokkulepete kaudu täitmisele pööratav			V	Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 8 punktis c osutatud krediidiriskikaitse kasutamise korral üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas väärtpaberistamise tehingu algataja õigus kasutada tagatist investorite krediidiriskikaitse maksetega seotud kohustuste täitmiseks on täitmisele pööratav ja kuidas tagatakse selle õiguse täitmisele pööratavus asjakohaste tagatiskokkulepetega.	Ei kohaldata
STSSY 151	Artikli 26e lõike 9 esimese lõigu punkt b	Investorite õigus väärtpaberistamise lõppemisel või väärtpaberistamise seeriate amortiseerumisel kasutamata tagatisele			V	Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 8 punktis c osutatud krediidiriskikaitse kasutamise korral lühiselgitus selle kohta, et investorite õigus tagastada väärtpaberistamise lõppemisel või väärtpaberistamise seeriate amortiseerumisel tagatised, mida ei ole kasutatud krediidiriskikaitse maksete tegemiseks, on täitmisele pööratav.	Ei kohaldata
STSSY 152	Artikli 26e lõike 9 esimese lõigu punkt c	Väärtpaberitesse investeeritud tagatis – sobivuskriteeriumide ja hoidmise korra kindlaksmääramine ja tehingu dokumentides			V	Määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 8 punktis c osutatud krediidiriskikaitse kasutamise korral üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas juhul, kui tagatis on investeeritud väärtpaberitesse, on tehingu dokumentides nähtud selliste väärtpaberite jaoks ette sobivuskriteeriumid ja hoidmise kord.	Ei kohaldata
STSSY 153	Artikli 26e lõike 9 teine lõik	Väärtpaberistamise tehingu algataja krediidirisk jääb investorite krediidiriskiks			V	Lühiselgitus selle kohta, et tehingu dokumentides on täpsustatud, kas väärtpaberistamise tehingu algataja krediidirisk jääb investorite krediidiriskiks.	Ei kohaldata
STSSY 154	Artikli 26e lõike 9 kolmas lõik	Õiguslik arvamus, mis kinnitab krediidiriskikaitse täitmisele pööratavust kõikides jurisdiktsioonides	V			Kinnitus selle kohta, et väärtpaberistamise tehingu algataja on saanud kvalifitseeritud õigusnõustajalt arvamuse, mis kinnitab krediidiriskikaitse täitmisele pööratavust kõigis asjaomastes jurisdiktsioonides.	Ei kohaldata
STSSY155	Artikli 26e lõike 10 esimese lõigu punkt a	Kvaliteetne tagatis – 0 % riskiga kaalutud võlaväärtpaberid			V	Kui krediidiriskikaitset pakutakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 punkti a kohaselt määruse (EL) nr 575/2013 III osa II jaotise 2. peatükis osutatud 0 % riskiga kaalutud võlaväärtpaberite kujul, siis lühiselgitus selle kohta, et täidetud on kõik järgmised tingimused: i) võlaväärtpaberite maksimaalne järelejäänud tähtaeg on kuni kolm kuud ega ole pikem kui järelejäänud aeg järgmise maksekuupäevani; ii) võlaväärtpaberid saab lunastada sellise rahasumma vastu, mis võrdub kaitstud väärtpaberistamise seeria tagasimaksmata summaga; iii) võlaväärtpaberid hoiab väärtpaberistamise tehingu algatajast ja investoritest sõltumatu deponitoorium.	Ei kohaldata
STSSY 156	Artikli 26e lõike 10 esimese lõigu punkt b	Kvaliteetne tagatis – raha kolmandast isikust krediidiasutuses, mille krediidikvaliteedi aste on 3 või üle selle			V	Kui krediidiriskikaitset pakutakse määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 punkti b kohaselt, siis lühiselgitus tagatiskokkuleppe kohta, millega väärtpaberistamise tehingu algatajale ja investorile antakse tagatis rahana, mida hoitakse kolmandast isikust krediidiasutuses, mille krediidikvaliteedi aste on 3 või üle selle kooskõlas määruse (EL) nr 575/2013 artiklis 136 sätestatud krediidikvaliteedi astmete määramisega.	Ei kohaldata
STSSY 157	Artikli 26e lõike 10 teine lõik	Erand – tagatis väärtpaberistamise tehingu algataja juures hoiustatud rahana			V	Kui kasutatakse erandit määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 esimesest lõigust, siis üksikasjalik selgitus tagatiskokkuleppe kohta, mille kohaselt ainult väärtpaberistamise tehingu algataja võib kasutada kvaliteetse tagatisena raha, mis on hoiustatud väärtpaberistamise tehingu algataja või tema sidusettevõtja juures, ja investori nõusolek selle tagatiskokkuleppega.	Ei kohaldata

STSSY 158	Artikli 26e lõike 10 kolmas lõik	Tagatis väärtpaberistamise tehingu algataja juures hoiustatud rahana – pädeva asutuse luba			V	Üksikasjalik selgitus määruse (EL) 2017/2402 artikli 29 lõike 5 kohaselt määratud pädeva asutuse nõusoleku kohta, et tagatisena võib kasutada raha, mis on hoiustatud väärtpaberistamise tehingu algataja või tema sidusettevõtja juures, kui väärtpaberistamise tehingu algataja või tema sidusettevõtja vastab krediitkvaliteedi astmele 3, tingimusel et võimalik on dokumenteerida tururaskused, finantsinstitutsiooni liikmesriigile määratud krediitkvaliteedi astmega seotud objektiivsed takistused või liikmesriigis esinevad märkimisväärsed võimalikud kontsentratsiooniprobleemid, mis tulenevad määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 teises lõigus osutatud krediitkvaliteedi astme 2 miinimumnõude kohaldamisest.	Ei kohaldata
STSSY 159	Artikli 26e lõike 10 neljas lõik	Tagatise ülekandmine, kui kolmandast isikust krediidasutus või väärtpaberistamise tehingu algataja ei vasta enam minimaalsele krediitkvaliteedi astmele			V	Üksikasjalik selgitus selle kohta, kuidas tagatis kooskõlas määruse (EL) 2017/2402 artikli 26e lõike 10 neljanda lõiguga üle kantakse, kui tagatist hoiustati rahana krediidasutuses, mis ei vasta enam minimaalsele krediitkvaliteedi astmele.	Ei kohaldata
STSSY 160	Artikli 26e lõike 10 viies lõik	Vastavus tagatisnõuetele investeeringu puhul krediidiriski vahetustehingut sisaldavatesse võlakirjadesse, mille on emiteerinud väärtpaberistamise tehingu algataja	V			Kinnitus selle kohta, et kooskõlas määruse (EL) nr 575/2013 artikliga 218 on tehtud investeringu krediidiriski vahetustehingut sisaldavatesse võlakirjadesse, mille on emiteerinud väärtpaberistamise tehingu algataja.	Ei kohaldata

“