

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2020/1226**z dnia 12 listopada 2019 r.****uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/2402 i ustanawiające regulacyjne standardy techniczne określające informacje, które mają być przekazywane zgodnie z wymogami dotyczącymi zgłoszenia STS****(Tekst mający znaczenie dla EOG)**

KOMISJA EUROPEJSKA,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej,

uwzględniając rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/2402 z dnia 12 grudnia 2017 r. w sprawie ustanowienia ogólnych ram dla sekurytyzacji oraz utworzenia szczególnych ram dla prostych, przejrzystych i standardowych sekurytyzacji, a także zmieniające dyrektywy 2009/65/WE, 2009/138/WE i 2011/61/UE oraz rozporządzenia (WE) nr 1060/2009 i (UE) nr 648/2012 ⁽¹⁾, w szczególności jego art. 27 ust. 6,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Rozporządzenie (UE) 2017/2402 nakłada na jednostki inicjujące i jednostki sponsorujące obowiązek przekazywania pewnych informacji do Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych, w przypadku gdy jednostki te uznają, że sekurytyzacja spełnia wymogi prostych, przejrzystych i standardowych kryteriów (STS) określonych w art. 19–22 oraz 23–26 tego rozporządzenia. Informacje, które mają być przekazywane, różnią się w zależności od różnych rodzajów zgłoszonych sekurytyzacji.
- (2) W celu umożliwienia właściwym organom wypełniania ich obowiązków oraz w celu umożliwienia inwestorom i potencjalnym inwestorom przeprowadzenia analizy *due diligence*, właściwej dla zgłoszenia STS, konieczne jest stwierdzenie, czy zostały spełnione kryteria STS. W celu poinformowania o ocenie kryteriów jednorodności zgłoszenie powinno zawierać w szczególności uzasadnienie wyboru czynnika jednorodności oraz wyłączenia innych czynników. W przypadku niektórych kryteriów STS wystarczające jest proste potwierdzenie zgodności, natomiast inne kryteria wymagają dalszych informacji. W związku z tym konieczne jest rozróżnienie wymogów, w przypadku których wystarczające jest proste potwierdzenie od tych, które wymagają zwięzłego lub szczegółowego wyjaśnienia.
- (3) Sekurytyzacje, w przypadku których nie ma obowiązku sporządzenia prospektu emisyjnego zgodnie z rozporządzeniem Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1129 ⁽²⁾ (prywatne sekurytyzacje), pozwalają stronom zawierać transakcje sekurytyzacyjne bez ujawniania szczególnie chronionych informacji handlowych. Należy zatem ograniczyć publikację zawartych w zgłoszeniach STS informacji o takich sekurytyzacjach do informacji, które nie są szczególnie chronionymi informacjami handlowymi.
- (4) W celu ułatwienia dostępu do informacji istotnych w kontekście wymogów STS jednostki inicjujące i jednostki sponsorujące powinny mieć możliwość odniesienia się do odpowiedniego prospektu emisyjnego sporządzonego dla tej sekurytyzacji zgodnie z rozporządzeniem (UE) 2017/1129, innej właściwej dokumentacji bazowej, o której mowa w art. 7 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, lub wszelkich innych dokumentów istotnych dla zgłoszenia STS.
- (5) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowią projekty regulacyjnych standardów technicznych przedłożone Komisji przez ESMA.
- (6) ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat projektu regulacyjnych standardów technicznych, który stanowi podstawę niniejszego rozporządzenia, dokonał analizy potencjalnych powiązanych kosztów i korzyści oraz zwrócił się o opinię do Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych ustanowionej na podstawie art. 37 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 ⁽³⁾,

⁽¹⁾ Dz.U. L 347 z 28.12.2017, s. 35.

⁽²⁾ Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1129 z dnia 14 czerwca 2017 r. w sprawie prospektu, który ma być publikowany w związku z ofertą publiczną papierów wartościowych lub dopuszczeniem ich do obrotu na rynku regulowanym oraz uchylenia dyrektywy 2003/71/WE (Dz.U. L 168 z 30.6.2017, s. 12).

⁽³⁾ Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 z dnia 24 listopada 2010 r. w sprawie ustanowienia Europejskiego Urzędu Nadzoru (Europejskiego Urzędu Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych), zmiany decyzji nr 716/2009/WE i uchylenia decyzji Komisji 2009/77/WE (Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 4).

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Informacje, które mają być zawarte w zgłoszeniu STS

1. Zgłoszenie STS zgodne z art. 27 rozporządzenia (UE) 2017/2402 ma zawierać następujące informacje:
 - a) w przypadku sekurytyzacji nieobjętej ABCP, informacje określone w załączniku I do niniejszego rozporządzenia;
 - b) w przypadku sekurytyzacji ABCP, informacje określone w załączniku II do niniejszego rozporządzenia;
 - c) w przypadku programu ABCP, informacje określone w załączniku III do niniejszego rozporządzenia.
2. W przypadku sekurytyzacji, w odniesieniu do których nie ma obowiązku sporządzania prospektu emisyjnego zgodnie z rozporządzeniem (UE) 2017/1129, informacjom, które należy zamieścić w zgłoszeniu STS zgodnie z ust. 1, towarzyszą następujące elementy:
 - a) w przypadku sekurytyzacji nieobjętej ABCP, informacje określone w polach STSS9 i STSS10 załącznika I do niniejszego rozporządzenia;
 - b) w przypadku sekurytyzacji ABCP, informacje określone w polach STSAT9 i STSAT10 załącznika II do niniejszego rozporządzenia;
 - c) w przypadku programu ABCP, informacje określone w polu STSAP9 załącznika III do niniejszego rozporządzenia.

Do celów art. 27 ust. 1 akapit trzeci rozporządzenia (UE) 2017/2402 publikacja zgłoszenia STS w przypadku tych sekurytyzacji ogranicza się do informacji, o których mowa w niniejszym ustępie.

Artykuł 2

Informacje dodatkowe

W przypadku gdy wymienione poniżej dokumenty zawierają informacje istotne dla zgłoszenia STS, odniesienie do odpowiednich części tych dokumentów może zostać zawarte w kolumnie „Dodatkowe informacje” załączników I, II i III do niniejszego rozporządzenia, a jeżeli takie informacje są zamieszczane, dokumentacja ta jest wyraźnie wskazana:

- a) prospekt emisyjny sporządzony zgodnie z rozporządzeniem (UE) 2017/1129;
- b) wszelka inna dokumentacja bazowa, o której mowa w art. 7 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402;
- c) wszelkie inne dokumenty zawierające informacje istotne dla zgłoszenia STS.

Artykuł 3

Wejście w życie

Niniejsze rozporządzenie wchodzi w życie dwudziestego dnia po jego opublikowaniu w *Dzienniku Urzędowym Unii Europejskiej*.

Niniejsze rozporządzenie wiąże w całości i jest bezpośrednio stosowane we wszystkich państwach członkowskich.

Sporządzono w Brukseli dnia 12 listopada 2019 r.

W imieniu Komisji
Jean Claude JUNCKER
Przewodniczący

ZAŁĄCZNIK I

Informacje, które należy przedłożyć ESMA zgodnie z art. 19–22 rozporządzenia (UE) 2017/2402 w odniesieniu do sekurytyzacji nieobjętych ABCP

Informacje ogólne

Numer pola	Numer artykułu rozporządzenia (UE) 2017/2402	NAZWA POLA	INFORMACJE PODLEGAJĄCE ZGŁOSZENIU ⁽¹⁾	INFORMACJE DODATKOWE
STSS0	art. 27 ust. 1	Pierwszy punkt kontaktowy	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) podmiotu wyznaczonego jako pierwszy punkt kontaktowy i nazwa odpowiedniego właściwego organu	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980 ⁽²⁾
STSS1	Nie dotyczy	Kod identyfikacyjny instrumentu	Międzynarodowy kod identyfikujący papier wartościowy (kod ISIN) lub wszystkie obowiązujące kody ISIN, jeżeli są dostępne. W przypadku braku kodu ISIN, każdy inny niepowtarzalny kod papierów wartościowych przypisany do danej sekurytyzacji.	Jeżeli jest dostępny, zgodnie z pozycją 3.1 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980.
STSS2	Nie dotyczy	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI)	LEI jednostek inicjujących, jednostek sponsorujących oraz, jeżeli jest dostępny, pierwotnych kredytodawców.	Pozycja 4.2 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS3	Nie dotyczy	Identyfikator zgłoszenia	W przypadku zgłaszania aktualizacji – niepowtarzalny numer referencyjny nadany przez ESMA zgłoszonemu wcześniej zgłoszeniu STS.	Nie dotyczy
STSS4	Nie dotyczy	Niepowtarzalny identyfikator	Niepowtarzalny identyfikator nadany przez jednostkę sprawozdawczą zgodnie z art. 11 ust. 1 rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2020/1224 ⁽³⁾ .	Nie dotyczy
STSS5	Nie dotyczy	Identyfikator prospektu emisyjnego	Identyfikator prospektu emisyjnego dostarczony przez odpowiedni właściwy organ, jeżeli jest dostępny.	Nie dotyczy
STSS6	Nie dotyczy	Repozytorium sekurytyzacji	Nazwa zarejestrowanego repozytorium sekurytyzacji, jeżeli jest dostępna.	Nie dotyczy
STSS7	Nie dotyczy	Nazwa sekurytyzacji	Nazwa sekurytyzacji.	Sekcja 4 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS8	art. 18 i art. 27 ust. 3	Państwo prowadzenia działalności	Państwo prowadzenia działalności jednostek inicjujących, jednostek sponsorujących, SSPE i pierwotnych kredytodawców, jeżeli informacje takie są dostępne.	Nie dotyczy

STSS9	Nie dotyczy	Klasyfikacja sekurytyzacji	Rodzaj sekurytyzacji: — sekurytyzacja nieobjęta ABCP, — sekurytyzacja ABCP, — program ABCP.	Nie dotyczy
STSS10	Nie dotyczy	Klasyfikacja ekspozycji bazowych	Rodzaj ekspozycji bazowych: 1) kredyty na nieruchomości mieszkalne zabezpieczone co najmniej jedną hipoteką na nieruchomości mieszkalnej albo w pełni gwarantowane przez dowolnego uznanego dostawcę ochrony kredytowej spośród tych, o których mowa w art. 201 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 575/2013, i kwalifikujące się co najmniej do stopnia jakości kredytowej 2 zgodnie z częścią trzecią tytuł II rozdział 2 tego rozporządzenia; 2) kredyty na nieruchomości komercyjne zabezpieczone co najmniej jedną hipoteką na nieruchomości komercyjnej, którą może być między innymi budynek biurowy lub inny obiekt komercyjny; 3) instrumenty kredytowe dla osób fizycznych, przeznaczone na cele konsumpcyjne osobiste, rodzinne lub na cele konsumpcyjne gospodarstw domowych; 4) instrumenty kredytowe, w tym kredyty i umowy leasingu, udzielane wszelkiego rodzaju przedsiębiorstwom lub spółkom; 5) kredyty na zakup samochodu/umowy leasingu samochodów; 6) należności z tytułu kart kredytowych; 7) należności z tytułu dostaw i usług; 8) inne ekspozycje bazowe, które na podstawie wewnętrznych metodyk i parametrów są uznawane przez jednostkę inicjującą lub jednostkę sponsorującą za stanowiące odrębny rodzaj aktywów;	Nie dotyczy
STSS11	Nie dotyczy	Data emisji	W przypadku prospektu emisyjnego sporządzonego zgodnie z rozporządzeniem (UE) 2017/1129 (*) data zatwierdzenia prospektu emisyjnego. W każdym innym przypadku data zamknięcia ostatniej transakcji.	Nie dotyczy
STSS12	Nie dotyczy	Data zgłoszenia	Data zgłoszenia do ESMA.	Nie dotyczy
STSS13	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, oświadczenie stwierdzające zgodność z kryteriami STS potwierdzone przez tę upoważnioną osobę trzecią.	Nie dotyczy

STSS14	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, nazwa osoby trzeciej i państwo prowadzenia działalności.	Nie dotyczy
STSS15	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, nazwa właściwego organu, który upoważnił osobę trzecią.	Nie dotyczy
STSS16	art. 27 ust. 5	Status STS	Uzasadnione zgłoszenie przez jednostkę inicjującą i jednostkę sponsorującą, że sekurytyzacja nie jest już uznawana za zgodną z STS.	Nie dotyczy
STSS17	art. 27 ust. 3	Jednostka inicjująca (lub pierwotny kredytodawca) niebędąca instytucją kredytową	Odpowiedź „Tak” lub „Nie” na pytanie, czy jednostka inicjująca lub pierwotny kredytodawca jest instytucją kredytową lub firmą inwestycyjną mającą siedzibę w Unii.	Nie dotyczy
STSS18	art. 27 ust. 3	Potwierdzenie kryteriów przyznawania kredytów	Jeżeli w polu STSS17 udzielono odpowiedzi „Nie”, potwierdzenie, że wdrożone kryteria, procesy i systemy udzielania kredytu stosowane przez jednostkę inicjującą lub pierwotnego kredytodawcę są realizowane zgodnie z art. 9 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Nie dotyczy
STSS19	art. 27 ust. 3	Potwierdzenie, że udzielanie kredytu podlega nadzorowi	Jeżeli w polu STSS17 udzielono odpowiedzi „Nie”, potwierdzenie, że udzielanie kredytu, o którym mowa w art. 27 ust. 3 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402, podlega nadzorowi.	Nie dotyczy

(¹) W stosownych przypadkach należy dołączyć odniesienie do odpowiednich sekcji dokumentów bazowych, jeżeli informacje takie są dostępne.

(²) Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/980 z dnia 14 marca 2019 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1129 w odniesieniu do formatu, treści, weryfikacji i zatwierdzania prospektu, który ma być publikowany w związku z ofertą publiczną papierów wartościowych lub dopuszczeniem ich do obrotu na rynku regulowanym, i uchylające rozporządzenie Komisji (WE) nr 809/2004 (Dz.U. L 166 z 21.6.2019, s. 26).

(³) Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2020/1224 z dnia 16 października 2019 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/2402 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych określających informacje oraz szczegółowe informacje na temat sekurytyzacji, które mają być udostępniane przez jednostkę inicjującą, jednostkę sponsorującą oraz SSPE (Dz.U. L 289 z 3.9.2020, s. 1).

(⁴) Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/1129 z dnia 14 czerwca 2017 r. w sprawie prospektu, który ma być publikowany w związku z ofertą publiczną papierów wartościowych lub dopuszczeniem ich do obrotu na rynku regulowanym oraz uchylenia dyrektywy 2003/71/WE (Dz.U. L 168 z 30.6.2017, s. 12).

Informacje szczegółowe

Numer pola	Numer artykułu rozporządzenia (UE) 2017/2402	Nazwa pola	Potwierdzenie	Zwięzłe wyjaśnienie	Szczegółowe wyjaśnienie	Informacje podlegające zgłoszeniu (!)	Informacje dodatkowe
STSS20	art. 20 ust. 1	Przeniesienie ekspozycji bazowych w drodze prawdziwej sprzedaży lub cesji		√		Zwięzłe wyjaśnienie sposobu przeniesienia ekspozycji bazowych w drodze prawdziwej sprzedaży lub cesji z takich o samym skutku prawnym w sposób, który jest egzekwowalny wobec sprzedawcy lub każdej osoby trzeciej.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS21	art. 20 ust. 2	Brak rygorystycznych przepisów dotyczących wycofania (ang. clawback)		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy w sekurytyzacji uwzględniono którykolwiek z rygorystycznych przepisów dotyczących wycofania (ang. clawback), o których mowa w art. 20 ust. 2 lit. a) lub b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, oraz czy mają zastosowanie przepisy art. 20 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS22	art. 20 ust. 3	Zwolnienie z egzekwowania przepisów dotyczących wycofania (ang. clawback) w ramach krajowego prawa upadłościowego	√			W związku z rubryką STSS21 – w stosownych przypadkach – potwierdzenie, czy nie występują żadne okoliczności, które mogłyby stanowić podstawę do zastosowania przepisów dotyczących wycofania (ang. clawback) zgodnie z art. 20 ust. 1 i 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS23	art. 20 ust. 4	Przeniesienie, gdy sprzedawca nie jest pierwotnym kredytodawcą	√			Jeżeli sprzedawca nie jest pierwotnym kredytodawcą, oświadczenie potwierdzające, że sekurytyzacja jest zgodna z art. 20 ust. 1–3 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS24	art. 20 ust. 5	Przeniesienie w drodze cesji, dopełnione w późniejszym terminie		√		W przypadku gdy przeniesienie ekspozycji bazowych odbywa się w drodze cesji i dopełnienie transakcji odbywa się w terminie późniejszym niż w momencie zamknięcia sekurytyzacji, należy przedstawić zwięzłe wyjaśnienie sposobu dopełnienia oraz zwięzłe wyjaśnienie, czy dopełnienie odbywa się poprzez zastosowanie co najmniej wymaganych minimalnych ustalonych z góry czynników uruchamiających wymienionych w art. 20 ust. 5 rozporządzenia (UE) 2017/2402. W przypadku zastosowania alternatywnych mechanizmów przeniesienia potwierdzenie, że niewypłacalność jednostki inicjującej nie stanie na przeszkodzie ani nie uniemożliwi egzekwowania praw przez SSPE.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSS25	art. 20 ust. 6	Oświadczenia i zapewnienia		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy istnieją złożone przez sprzedawcę oświadczenia i zapewnienia, że ekspozycje bazowe objęte sekurytyzacją nie są obciążone, ani w inny sposób objęte warunkami, co do których można przewidzieć, że negatywnie wpłyną na wykonalność prawdziwej sprzedaży lub cesji, lub przeniesienia o takim samym skutku prawnym.	Pozycja 2.2.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS26	art. 20 ust. 7	Kryteria kwalifikowalności, które nie dopuszczają aktywnego zarządzania portfelem ekspozycji bazowych na zasadzie uznaniowej		√		Zwięzłe wyjaśnienie, w jaki sposób: — ekspozycje bazowe przeniesione ze sprzedawcy lub sędowane przez niego na rzecz SSPE spełniają wcześniej określone oraz jasne i udokumentowane kryteria kwalifikowalności, które nie dopuszczają aktywnego zarządzania portfelem tych ekspozycji na zasadzie uznaniowej, — wybór i przeniesienie ekspozycji bazowych w ramach sekurytyzacji opiera się na jasnych procesach ułatwiających identyfikację ekspozycji wybranych do sekurytyzacji lub przeniesionych na sekurytyzację, które nie pozwalają na aktywne zarządzanie portfelem na zasadzie uznaniowości.	Sekcja 2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS27	art. 20 ust. 8	Jednorodność aktywów			√	Szczegółowe wyjaśnienie dotyczące jednorodności puli ekspozycji bazowych zabezpieczających sekurytyzację. W tym celu należy zamieścić odniesienie do regulacyjnych standardów technicznych EUNB dotyczących jednorodności (rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/1851 (?) oraz szczegółowo wyjaśnić, w jaki sposób są spełniane wszystkie warunki określone w art. 1 wymienionego rozporządzenia delegowanego.	Pozycja 2.2.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS28	art. 20 ust. 9	Zobowiązania związane z ekspozycjami bazowymi: brak resekurytyzacji	√			Potwierdzenie, że ekspozycje bazowe nie obejmują żadnych pozycji sekurytyzacyjnych i że zgłoszona sekurytyzacja nie jest w związku z tym resekurytyzacją.	Pozycja 2.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSS29	art. 20 ust. 10	Prawidłowość standardu zawierania umów kredytowych		√	<p>Szczegółowe wyjaśnienie:</p> <ul style="list-style-type: none"> — czy ekspozycje bazowe zostały za- inicjowane w toku zwykłej działal- ności kredytodawcy oraz czy zasto- sowane standardy zawierania umów kredytowych nie były mniej rygorystyczne niż standardy zasto- sowane w chwili inicjowania pod- obnych ekspozycji, które nie zosta- ły objęte sekurytyzacją, — czy standardy zawierania umów kredytowych i wszelkie istotne zmiany w stosunku do wcześniej- szych standardów zawierania umów kredytowych są lub będą bez zbędnej zwłoki w pełni ujawni- ane potencjalnym inwestorom, — w jaki sposób w przypadku sekury- tyzacji, w których ekspozycjami ba- zowymi są kredyty na nierucho- mości mieszkalne, pula ekspozycji bazowych spełnia wymóg określo- ny w art. 20 ust. 10 akapit drugi rozporządzenia (UE) 2017/2402, — czy ocena zdolności kredytowej kredytobiorcy spełnia wymogi określone w art. 8 dyrektywy 2008/48/WE⁽³⁾ lub w art. 18 ust. 1– 4, ust. 5 lit. a) oraz ust. 6 dyrektywy 2014/17/UE⁽⁴⁾ lub, w stosownych przypadkach, równoważne wymo- gi w państwach trzecich. 	Pozycja 2.2.7 za- łącznika 19 do roz- porządzenia dele- gowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS30	art. 20 ust. 10	Fachowa wiedza jednostki inicjującej/kredytodawcy		√	<p>Szczegółowe wyjaśnienie, czy jednostka inicjująca lub pierwotny kredytodawca posiadają wystarczającą fachową wiedzę w zakresie inicjowania ekspozycji o charakterze podobnym do tych, które są objęte sekurytyzacją.</p>	Pozycja 2.2.7 za- łącznika 19 do roz- porządzenia dele- gowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS31	art. 20 ust. 11	Przeniesione ekspozycje bazowe bez ekspozycji, których dotyczy niewykonanie zobowiązania		√	<p>Szczegółowe wyjaśnienie, czy:</p> <ul style="list-style-type: none"> — przeniesione ekspozycje bazowe nie obejmują – w momencie wyboru – ekspozycji, których dotyczy niewykonanie zobowiązania (lub ekspozycji zrestrukturyzowanych) określonych w art. 20 ust. 11 rozporządzenia (UE) 2017/2402, — spełniono wymogi, o których mowa w art. 20 ust. 11 lit. a) ppkt (i) oraz (ii) rozporządzenia (UE) 2017/2402, — spełniono wymogi, o których mowa w art. 20 ust. 11 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, 	Pozycja 2.2.8 za- łącznika 19 do roz- porządzenia dele- gowanego Komisji (UE) 2019/980

						— spełniono wymogi, o których mowa w art. 20 ust. 11 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	
STSS32	art. 20 ust. 12	Co najmniej jedna płatność w momencie przeniesienia	√			Potwierdzenie, czy w momencie przeniesienia ekspozycji dłużnicy dokonali co najmniej jednej płatności. Potwierdzenie, czy ma zastosowanie wyłączenie na podstawie art. 20 ust. 12 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycje 3.3 i 3.4.6 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS33	art. 20 ust. 13	Splata na rzecz posiadaczy pozycji nie może być skonstruowana w taki sposób, aby zależeć w głównej mierze od sprzedaży aktywów.			√	Szczegółowe wyjaśnienie stopnia zależności spłat posiadaczy pozycji sekurytyzacyjnej od sprzedaży aktywów zabezpieczających ekspozycje bazowe.	Pozycja 3.4.1 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS34	art. 21 ust. 1	Przestrzeganie wymogów dotyczących zatrzymywania ryzyka			√	Zwięzłe wyjaśnienie, w jaki sposób jednostka inicjująca, sponsorująca lub pierwotny kredytodawca sekurytyzacji nieobjętej ABCP spełnia wymóg dotyczący zatrzymania ryzyka przewidziany w art. 6 rozporządzenia (UE) 2017/2402. Wskazanie, która jednostka zachowuje istotny udział gospodarczy netto i którą z opcji wykorzystuje się do zatrzymania ryzyka: 1) część pionową zgodnie z art. 6 ust. 3 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 2) udział sprzedawcy zgodnie z art. 6 ust. 3 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 3) losowo wybrane ekspozycje ujęte w bilansie zgodnie z art. 6 ust. 3 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 4) transzę pierwszej straty zgodnie z art. 6 ust. 3 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 5) ekspozycję pierwszej straty w każdym z aktywów zgodnie z art. 6 ust. 3 lit. e) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 6) brak zgodności z wymogami dotyczącymi zatrzymania ryzyka określonymi w art. 6 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2017/2402; 7) pozostałe wykorzystane opcje.	Pozycja 3.1 załącznika 9 oraz pozycja 3.4.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSS35	art. 21 ust. 2	Ograniczenie ryzyka stopy procentowej (IR) i ryzyka walutowego (FX) Ryzyka		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy stopy procentowe i ryzyko walutowe są odpowiednio ograniczane oraz czy podejmowane są środki mające na celu ograniczenie takiego ryzyka, a także potwierdzenie, że inwestorzy mają takie środki do dyspozycji.	Pozycje 3.4.2 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS36	art. 21 ust. 2	Instrumenty pochodne nabyte/sprzedane przez SSPE		√		Zwięzłe oświadczenie, że SSPE nie zawarła kontraktów pochodnych, z wyjątkiem okoliczności, o których mowa w art. 21 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycje 3.4.2 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS37	art. 21 ust. 2	Instrumenty pochodne zgodne ze wspólnymi standardami		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy stosowane instrumenty zabezpieczające są zapewniane i dokumentowane zgodnie ze wspólnie przyjętymi standardami.	Pozycje 3.4.2 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS38	art. 21 ust. 3	Płatności odsetek według stóp referencyjnych oparte na powszechnie stosowanych stopach procentowych		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy płatności odsetek według stóp referencyjnych w ramach sekurytyzowanych aktywów i zobowiązań są obliczane na podstawie ogólnie stosowanych rynkowych stóp procentowych lub ogólnie stosowanych stóp sektorowych odzwierciedlających koszt środków pieniężnych oraz w jaki sposób dokonuje się tych obliczeń.	Pozycje 2.2.2 i 2.2.13 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS39	art. 21 ust. 4	Żadne środki pieniężne nie zostają zatrzymane po doręczeniu zawiadomienia o wszczęciu egzekucji lub zawiadomienia o przyspieszeniu spłaty		√		Ogólna deklaracja, że spełnione są wszystkie wymogi art. 21 ust. 4 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS40	art. 21 ust. 4	a) nie zatrzymuje się żadnej kwoty środków pieniężnych	√			Potwierdzenie, że po doręczeniu zawiadomienia o wszczęciu egzekucji lub zawiadomienia o przyspieszeniu spłaty nie zostaną zatrzymane żadne środki pieniężne	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS41	art. 21 ust. 4	b) inwestorzy otrzymują środki z tytułu kwoty głównej	√			Potwierdzenie, że inwestorzy otrzymują środki z tytułu kwoty głównej ekspozycji bazowych w drodze sekencyjnej amortyzacji pozycji sekurytyzacyjnej w kolejności według uprzywilejowania danej pozycji sekurytyzacyjnej.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSS42	art. 21 ust. 4	c) spłata nie zmienia uprzywilejowania	√		Potwierdzenie, że spłata pozycji sekurytyzacyjnych nie zmienia ich uprzywilejowania.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS43	art. 21 ust. 4	d) żadne przepisy nie mogą wymagać automatycznej likwidacji ekspozycji bazowych według wartości rynkowej	√		Potwierdzenie, że żadne przepisy nie wymagają automatycznej likwidacji ekspozycji bazowych według wartości rynkowej.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS44	art. 21 ust. 5	Sekurytyzacje, które obejmują niesekwencyjną kolejność płatności	√		Potwierdzenie, że transakcje, które obejmują niesekwencyjną kolejność płatności, zawierają czynniki uruchamiające związane z dochodami z tytułu ekspozycji bazowych, powodujące powrót do sekwencyjnej kolejności płatności według uprzywilejowania. Potwierdzenie, że takie czynniki uruchamiające obejmują co najmniej pogorszenie jakości kredytowej ekspozycji bazowych poniżej uprzednio ustalonego progu.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS45	art. 21 ust. 6	Odnawialna sekurytyzacja wywołująca zdarzenia uruchamiające przedterminową spłatę w celu zakończenia okresu odnawialności na podstawie wyznaczonych czynników uruchamiających		√	W stosownych przypadkach związane wyjaśnienie, w jaki sposób przepisy art. 21 ust. 6 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402 zostały odzwierciedlone w dokumentacji transakcji.	Pozycje 2.3 i 2.4 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS46	art. 21 ust. 6 lit. a)	a) pogorszenie jakości kredytowej ekspozycji bazowych		√	W stosownych przypadkach związane wyjaśnienie, w jaki sposób przepisy art. 21 ust. 6 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402 zostały odzwierciedlone w dokumentacji transakcji.	Pozycje 2.3 i 2.4 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS47	art. 21 ust. 6 lit. b)	b) wystąpienie zdarzenia związanego z niewypłacalnością w odniesieniu do jednostki inicjującej lub jednostki obsługującej		√	W stosownych przypadkach związane wyjaśnienie, w jaki sposób przepisy lub czynniki uruchamiające określone w art. 21 ust. 6 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402 zostały odzwierciedlone w dokumentacji transakcji.	Pozycje 2.3 i 2.4 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSS48	art. 21 ust. 6 lit. c)	c) spadek wartości ekspozycji bazowych posiadanych przez SSPE poniżej uprzednio ustalonego progu	√		W stosownych przypadkach zwięzłe wyjaśnienie, w jaki sposób przepisy lub czynniki uruchamiające określone w art. 21 ust. 6 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402 zostały odzwierciedlone w dokumentacji transakcji, z podaniem odniesień do odpowiednich sekcji dokumentacji bazowej, w których można znaleźć odpowiednie informacje.	Pozycje 2.3 i 2.4 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS49	art. 21 ust. 6 lit. d)	d) niewygenerowanie wystarczającej ilości nowych ekspozycji bazowych o uprzednio ustalonej jakości kredytowej (czynnik wywołujący zakończenie okresu odnawialności)	√		W stosownych przypadkach zwięzłe wyjaśnienie, w jaki sposób przepisy art. 21 ust. 6 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/2402 zostały odzwierciedlone w dokumentacji transakcji.	Pozycje 2.3 i 2.4 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS50	art. 21 ust. 7 lit. a)	a) informacje dotyczące zobowiązań umownych jednostki obsługującej, powiernika i innych dostawców usług pomocniczych	√		Potwierdzenie, że w dokumentacji transakcji określono wszystkie wymogi określone w art. 21 ust. 7 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS51	art. 21 ust. 7 lit. b)	b) postanowienia dotyczące ciągłości obsługi zadłużenia	√		Potwierdzenie, że dokumentacja sekurytyzacyjna ściśle spełnia wymogi określone w art. 21 ust. 7 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS52	art. 21 ust. 7 lit. c)	c) postanowienia dotyczące ciągłości funkcjonowania kontrahentów instrumentów pochodnych	√		Potwierdzenie, że w dokumentacji transakcji przedstawiono wszystkie informacje, o których mowa w art. 21 ust. 7 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS53	art. 21 ust. 7 lit. c)	c) postanowienia dotyczące ciągłości funkcjonowania dostawców płynności oraz banku, w którym prowadzony jest rachunek	√		Potwierdzenie, że w dokumentacji transakcji przedstawiono wszystkie informacje wymagane na podstawie art. 21 ust. 7 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSS54	art. 21 ust. 8	Wiedza fachowa wymagana od jednostki obsługującej oraz wdrożone zasady, odpowiednie procedury i środki kontroli zarządzania ryzykiem.			√	Szczegółowe wyjaśnienie sposobu spełnienia wymogów określonych w art. 21 ust. 8 rozporządzenia (UE) 2017/2402. W wyjaśnieniu należy podać odniesienia do wszelkich zasad i procedur mających na celu zapewnienie zgodności z tymi wymogami.	Pozycja 3.4.6 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS55	art. 21 ust. 9	Jasne i spójne definicje dotyczące sposobu traktowania problemów pożyczek	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji bazowej jasno i spójnie określono definicje, środki naprawcze i działania dotyczące sytuacji zadłużeniowych określonych w art. 21 ust. 9 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 2.2.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS56	art. 21 ust. 9	Kolejność płatności i zdarzenia wywołujące zmiany	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji sekurytyzacji określono kolejność płatności i zdarzenia wywołujące zmiany zgodnie z art. 21 ust. 9 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.4.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS57	art. 21 ust. 10	Terminowe rozwiązywanie konfliktów pomiędzy kategoriami inwestorów oraz obowiązki powiernika	√			Potwierdzenie, że przepisy dotyczące terminowego rozwiązywania konfliktów zawarte w art. 21 ust. 10 rozporządzenia (UE) 2017/2402 zostały spełnione.	Pozycje 3.4.7 i 3.4.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS58	art. 22 ust. 1	Dane dotyczące historycznych wyników w zakresie niewykonania zobowiązań i strat	√			Potwierdzenie, że dane, których udostępnienia wymaga się w art. 22 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, są dostępne, wraz z wyraźnym wskazaniem, gdzie można te dane znaleźć.	Pozycja 2.2.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSS59	art. 22 ust. 2	Próba ekspozycji bazowych podlegająca zewnętrznej weryfikacji	√			Potwierdzenie, że odpowiednia i niezależna strona przeprowadziła zewnętrzną weryfikację próby ekspozycji bazowych przed emisją papierów wartościowych.	Nie dotyczy
STSS60	art. 22 ust. 3	Dostęp potencjalnych inwestorów do modelu przepływów pieniężnych z tytułu zobowiązań	√			Potwierdzenie, że potencjalni inwestorzy posiadają dostęp do modelu przepływów pieniężnych z tytułu zobowiązań przed wyceną, wraz z wyraźnym wskazaniem, gdzie można te informacje znaleźć. Po wycenie – potwierdzenie, że zapewniono potencjalnym inwestorom dostęp do takich informacji na żądanie.	Nie dotyczy

STSS61	art. 22 ust. 4	Publikacja informacji dotyczących efektywności środowiskowej ekspozycji bazowych, na które składają się kredyty na nieruchomości mieszkalne lub kredyty na zakup samochodu lub umowy leasingu samochodów	√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy informacje związane z efektywnością środowiskową aktywów finansowanych przez kredyty na nieruchomości mieszkalne lub kredyty na zakup samochodu lub umowy leasingu samochodów są dostępne zgodnie z art. 7 ust. 1 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402, wraz z oświadczeniem, gdzie można te informacje znaleźć.	Nie dotyczy
STSS62	art. 22 ust. 5	Jednostka inicjująca i jednostka sponsorująca odpowiedzialne za przestrzeganie przepisów art. 7	√		Potwierdzenie, że: <ul style="list-style-type: none"> — jednostka inicjująca i jednostka sponsorująca stosują się do przepisów art. 7 rozporządzenia (UE) 2017/2402, — przed wyceną potencjalnym inwestorom zapewniono dostęp na żądanie do informacji wymaganych w art. 7 ust. 1. lit. a), — przed wyceną zapewniono dostęp do informacji wymaganych w art. 7 ust. 1. lit. b)–d) co najmniej w formie projektu lub we wstępnej formie. 	Nie dotyczy

(¹) W stosownych przypadkach należy dołączyć odniesienie do odpowiednich sekcji dokumentów bazowych, jeżeli informacje takie są dostępne.

(²) Rozporządzenie delegowane Komisji (UE) 2019/1851 z dnia 28 maja 2019 r. uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/2402 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących jednorodności ekspozycji bazowych w ramach sekurytyzacji (Dz.U. L 280 z 6.11.2019, s. 1).

(³) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2008/48/WE z dnia 23 kwietnia 2008 r. w sprawie umów o kredyt konsumencki oraz uchylająca dyrektywę Rady 87/102/EWG (Dz.U. L 133 z 22.5.2008, s. 66).

(⁴) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/17/UE z dnia 4 lutego 2014 r. w sprawie konsumenckich umów o kredyt związanych z nieruchomościami mieszkalnymi i zmieniająca dyrektywy 2008/48/WE i 2013/36/UE oraz rozporządzenie (UE) nr 1093/2010 (Dz.U. L 60 z 28.2.2014, s. 34).

ZAŁĄCZNIK II

Informacje, które należy przedłożyć ESMA zgodnie z art. 24 rozporządzenia (UE) 2017/2402 w odniesieniu do sekurytyzacji ABCP

Informacje ogólne

Numer pola	Numer artykułu rozporządzenia (UE) 2017/2402	Nazwa pola	Informacje podlegające zgłoszeniu ⁽¹⁾	Informacje dodatkowe
STSAT0	art. 27 ust. 1	Pierwszy punkt kontaktowy	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) podmiotu wyznaczonego jako pierwszy punkt kontaktowy i nazwa odpowiedniego właściwego organu	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT1	Nie dotyczy	Kod identyfikacyjny instrumentu	Międzynarodowy kod identyfikujący papier wartościowy (kod ISIN) lub wszystkie obowiązujące kody ISIN, jeżeli są dostępne. W przypadku braku kodu ISIN, jakikolwiek inny niepowtarzalny kod papierów wartościowych przypisany do sekurytyzacji ABCP.	Jeżeli jest dostępny, zgodnie z pozycją 3.1 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980.
STSAT2	Nie dotyczy	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI)	LEI jednostek inicjujących lub jednostek sponsorujących, jeżeli jest dostępny.	Pozycja 4.2 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT3	Nie dotyczy	Identyfikator zgłoszenia	W przypadku zgłaszania aktualizacji – niepowtarzalny numer referencyjny nadany przez ESMA zgłoszonemu wcześniej zgłoszeniu STS.	Nie dotyczy
STSAT4	Nie dotyczy	Niepowtarzalny identyfikator	Niepowtarzalny identyfikator nadany przez jednostkę sprawozdawczą tej transakcji ABCP zgodnie z art. 11 ust. 2 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224	Nie dotyczy
STSAT5	Nie dotyczy	Identyfikator prospektu emisyjnego	Identyfikator prospektu emisyjnego dostarczony przez odpowiedni właściwy organ, jeżeli jest dostępny.	Nie dotyczy
STSAT6	Nie dotyczy	Repozytorium sekurytyzacji	Nazwa zarejestrowanego repozytorium sekurytyzacji, jeżeli jest dostępna.	Nie dotyczy
STSAT7	Nie dotyczy	Nazwa sekurytyzacji	Nazwa sekurytyzacji lub nazwa kodowa i nazwa stosowana, jeżeli są dostępne.	Sekcja 4 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT8	art. 18 i art. 27 ust. 3	Państwo prowadzenia działalności	Państwo prowadzenia działalności jednostek inicjujących, jednostek sponsorujących i SSPE, jeżeli informacje te są dostępne.	Nie dotyczy
STSAT9	Nie dotyczy	Klasyfikacja sekurytyzacji	Rodzaj sekurytyzacji: — sekurytyzacja nieobjęta ABCP, — sekurytyzacja ABCP, — program ABCP.	Nie dotyczy

STSAT10	Nie dotyczy	Klasyfikacja ekspozycji bazowych	Rodzaj ekspozycji bazowych: 1) kredyty na nieruchomości mieszkalne zabezpieczone co najmniej jedną hipoteką na nieruchomości mieszkalnej albo w pełni gwarantowane przez dowolnego uznanego dostawcę ochrony kredytowej spośród tych, o których mowa w art. 201 ust. 1 rozporządzenia (UE) nr 575/2013, i kwalifikujące się co najmniej do stopnia jakości kredytowej 2 zgodnie z częścią trzecią tytuł II rozdział 2 tego rozporządzenia; 2) kredyty na nieruchomości komercyjne zabezpieczone co najmniej jedną hipoteką na nieruchomości komercyjnej, którą może być między innymi budynek biurowy lub inny obiekt komercyjny; 3) instrumenty kredytowe dla osób fizycznych, przeznaczone na cele konsumpcyjne osobiste, rodzinne lub na cele konsumpcyjne gospodarstw domowych; 4) instrumenty kredytowe, w tym kredyty i umowy leasingu, udzielane wszelkiego rodzaju przedsiębiorstwom lub spółkom; 5) kredyty na zakup samochodu/umowy leasingu samochodów; 6) należności z tytułu kart kredytowych; 7) należności z tytułu dostaw i usług; 8) inne ekspozycje bazowe, które na podstawie wewnętrznych metodyk i parametrów są uznawane przez jednostkę inicjującą lub jednostkę sponsorującą za stanowiące odrębny rodzaj aktywów.	Nie dotyczy
STSAT11	Nie dotyczy	Data emisji	W przypadku prospektu emisyjnego sporządzonego zgodnie z rozporządzeniem (UE) 2017/1129 data zatwierdzenia prospektu emisyjnego. W innych przypadkach data emisji sekurytyzacji ABCP.	Nie dotyczy
STSAT12	Nie dotyczy	Data zgłoszenia	Data zgłoszenia do ESMA.	Nie dotyczy
STSAT13	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, oświadczenie stwierdzające zgodność z kryteriami STS potwierdzone przez tę upoważnioną osobę trzecią.	Nie dotyczy
STSAT14	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, nazwa osoby trzeciej i państwo, w którym prowadzi działalność.	Nie dotyczy

STSAT15	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia w sprawie sekurytyzacji, nazwa właściwego organu, który upoważnił osobę trzecią.	Nie dotyczy
STSAT16	art. 27 ust. 5	Status STS	Informacja, czy jednostka inicjująca lub jednostka sponsorująca zgłosiła, że sekurytyzacji ABCP nie należy już uznawać za sekurytyzację STS, z podaniem powodów takiego zgłoszenia.	Nie dotyczy
STSAT17	art. 27 ust. 3	Jednostka inicjująca (lub pierwotny kredytodawca) niebędąca instytucją kredytową	Odpowiedź „Tak” lub „Nie” na pytanie, czy jednostka inicjująca lub pierwotny kredytodawca jest instytucją kredytową lub firmą inwestycyjną mającą siedzibę w Unii.	Nie dotyczy
STSAT18	art. 27 ust. 3	Potwierdzenie kryteriów przyznawania kredytów	Jeżeli w polu STSS17 udzielono odpowiedzi „Nie”, potwierdzenie, że wdrożone kryteria, procesy i systemy udzielania kredytu stosowane przez jednostkę inicjującą lub pierwotnego kredytodawcę są realizowane zgodnie z art. 9 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Nie dotyczy
STSAT19	art. 27 ust. 3	Potwierdzenie, że udzielanie kredytu podlega nadzorowi	Jeżeli w polu STSS17 udzielono odpowiedzi „Nie”, potwierdzenie, że udzielanie kredytu, o którym mowa w art. 27 ust. 3 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402, podlega nadzorowi.	Nie dotyczy

(¹) W stosownych przypadkach należy dołączyć odniesienie do odpowiednich sekcji dokumentów bazowych, jeżeli informacje takie są dostępne.

Informacje szczegółowe

Numer pola	Numer artykułu rozporządzenia (UE) 2017/2402	Nazwa pola	Potwierdzenie	Zwięzłe wyjaśnienie	Szczegółowe wyjaśnienie	Informacje podlegające zgłoszeniu (¹)	Informacje dodatkowe
STSAT20	art. 24 ust. 1	Ekspozycje bazowe nabyte w drodze prawdziwej sprzedaży		√		Zwięzłe wyjaśnienie sposobu przeniesienia ekspozycji bazowych w drodze prawdziwej sprzedaży lub cesji o takim samym skutku prawnym w sposób, który jest egzekwowalny wobec sprzedawcy lub każdej osoby trzeciej.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT21	art. 24 ust. 2	Brak rygorystycznych przepisów dotyczących wycofania (ang. <i>clawback</i>)		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy w sekurytyzacji uwzględniono którykolwiek z rygorystycznych przepisów dotyczących wycofania (ang. <i>clawback</i>), o których mowa w art. 24 ust. 2 lit. a) lub b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, oraz czy przepisy art. 24 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2017/2402 mają zastosowanie.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSAT22	art. 24 ust. 3	Zwolnienie z egzekwowania przepisów dotyczących wycofania (ang. <i>clawback</i>) w ramach krajowego prawa upadłościowego	√		W związku z rubryką STSS21 – w stosownych przypadkach – potwierdzenie, że nie występują okoliczności, które mogłyby stanowić podstawę do zastosowania przepisów dotyczących wycofania (ang. <i>clawback</i>) zgodnie z art. 24 ust. 1 i 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT23	art. 24 ust. 4	Przeniesienie, gdy sprzedawca nie jest pierwotnym kredytodawcą	√		Jeżeli sprzedający nie jest pierwotnym kredytodawcą, oświadczenie potwierdzające, że sekurytyzacja jest zgodna z art. 24 ust. 1–3 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT24	art. 24 ust. 5	Przeniesienie w drodze cesji, dopełnione w późniejszym terminie.		√	W przypadku gdy przeniesienie ekspozycji bazowych odbywa się w drodze cesji i dopełnienie transakcji odbywa się w terminie późniejszym niż moment zamknięcia sekurytyzacji, należy przedstawić związane wyjaśnienie sposobu dopełnienia oraz związane wyjaśnienie, czy dopełnienie odbywa się poprzez zastosowanie co najmniej wymaganych minimalnych ustalonych z góry czynników uruchamiających zdarzenia wymienionych w art. 24 ust. 5 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT25	art. 24 ust. 6	Oświadczenia i zapewnienia		√	Związłe wyjaśnienie, czy istnieją złożone przez sprzedawcę oświadczenia i zapewnienia, że aktywa objęte sekurytyzacją nie są obciążone, ani w inny sposób objęte warunkami, co do których można przewidzieć, że negatywnie wpłyną na wykonalność prawdziwej sprzedaży lub cesji, lub przeniesienia o takim samym skutku prawnym.	Pozycja 2.2.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT26	art. 24 ust. 7	Kryteria kwalifikowalności, które nie dopuszczają aktywnego zarządzania portfelem ekspozycji bazowych na zasadzie uznaniowej		√	Związłe wyjaśnienie, czy: — ekspozycje bazowe przeniesione ze sprzedawcy lub sędowane przez niego na rzecz SSPE spełniają wcześniej określone oraz jasne i udokumentowane kryteria kwalifikowalności, które nie dopuszczają aktywnego zarządzania portfelem tych ekspozycji na zasadzie uznaniowej, — wybór i przeniesienie ekspozycji bazowych w ramach sekurytyzacji opiera się na jasnych procesach ułatwiających identyfikację ekspozycji wybranych do sekurytyzacji lub przeniesionych na sekurytyzację, które nie pozwalają na aktywne zarządzanie portfelem na zasadzie uznaniowości.	Sekcja 2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSAT27	art. 24 ust. 8	Brak resekurytyzacji	√		Potwierdzenie, że ekspozycje bazowe nie obejmują żadnych pozycji sekurytyzacyjnych i, w związku z czym, zgłoszona sekurytyzacja nie jest resekurytyzacją.	Pozycja 2.2.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT28	art. 24 ust. 9	Przeniesione ekspozycje bazowe bez ekspozycji, których dotyczy niewykonanie zobowiązania		√	Szczegółowe wyjaśnienie, w jakim stopniu przeniesione ekspozycje bazowe nie obejmują – w momencie wyboru – ekspozycji, których dotyczy niewykonanie zobowiązania lub, w stosownych przypadkach, ekspozycji zrestrukturyzowanych zgodnie z art. 24 ust. 9 rozporządzenia (UE) 2017/2402. W stosownych przypadkach oświadczenie, czy sekurytyzacja nie obejmuje jakiegokolwiek sytuacji obniżonej wiarygodności kredytowej w momencie sekurytyzacji, jak określono w art. 24 ust. 9 lit. a) ppkt (i) rozporządzenia (UE) 2017/2402. Potwierdzenie, że: — w momencie inicjowania spełnione są wymogi, o których mowa w art. 24 ust. 9 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, — w momencie wyboru spełnione są wymogi, o których mowa w art. 24 ust. 9 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 2.2.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT29	art. 24 ust. 10	Conajmniejjedna płatność w momencie przeniesienia	√		Potwierdzenie, czy w momencie przeniesienia ekspozycji dłużnicy dokonali co najmniej jednej płatności. Jeżeli nie dokonano żadnej płatności, wyjaśnienie przyczyny takiej sytuacji wraz z oświadczeniem, czy przyczyną jest jeden z wyjątków dopuszczonych w art. 20 ust. 12 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycje 3.3 i 3.4.6 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT30	art. 24 ust. 11	Splata na rzecz posiadaczy pozycji nie może być skonstruowana w taki sposób, aby zależeć w głównej mierze od sprzedaży aktywów.		√	Szczegółowe wyjaśnienie stopnia zależności splat posiadaczy pozycji sekurytyzacyjnej od sprzedaży aktywów zabezpieczających ekspozycje bazowe. W stosownych przypadkach szczegółowe wyjaśnienie, czy uznaje się, że splaty na rzecz inwestorów nie zależą od sprzedaży aktywów, jak określono w art. 24 ust. 11 akapit drugi rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.4.1 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

STSAT31	art. 24 ust. 12	Ograniczenie ryzyka stopy procentowej (IR) i ryzyka walutowego (FX) Ryzyka		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy i w jaki sposób stopy procentowe i ryzyko walutowe są odpowiednio ograniczone, i potwierdzenie, że środki podejmowane w tym celu zostały ujawnione. Zwięzłe wyjaśnienie, czy stosowane instrumenty zabezpieczające są zagwarantowane i udokumentowane zgodnie ze wspólnie przyjętymi standardami.	Pozycje 3.4.2 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT32	art. 24 ust. 12	Instrumenty pochodne nabyte/sprzedane przez SSPE		√		O ile nie odbywa się to w celu zabezpieczenia ryzyka stopy procentowej lub ryzyka walutowego, zwięzłe wyjaśnienie, czy SSPE nie zawarła kontraktów pochodnych.	Pozycje 3.4.2 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT33	art. 24 ust. 12	Instrumenty pochodne w ekspozycjach bazowych		√		Zwięzłe wyjaśnienie dotyczące obecności jakichkolwiek kontraktów pochodnych w puli ekspozycji bazowych.	Pozycje 3.4.2 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT34	art. 24 ust. 12	Instrumenty pochodne zgodne ze wspólnymi standardami		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy jakiegokolwiek kontrakty pochodne dopuszczone na podstawie art. 24 ust. 12 są zawierane i dokumentowane zgodnie ze wspólnymi standardami w dziedzinie finansów międzynarodowych.	Pozycje 3.4.7 i 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT35	art. 24 ust. 13	Jasne i spójne definicje dotyczące sposobu traktowania problemowych pożyczek	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji bazowej jasno i spójnie określono definicje, środki naprawcze i działania dotyczące sytuacji zadłużeniowych określonych w art. 24 ust. 13 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 2.2.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT36	art. 24 ust. 13	Kolejność płatności i zdarzenia wywołujące zmiany	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji transakcji określono kolejność płatności i zdarzenia wywołujące zmiany w tej kolejności zgodnie z art. 24 ust. 13 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycje 3.4.7 i 3.4.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT37	art. 24 ust. 14	Dane dotyczące historycznych wyników w zakresie niewykonania zobowiązań i strat	√			Potwierdzenie, że dane, których udostępnienia wymaga art. 24 ust. 14 rozporządzenia (UE) 2017/2402, są dostępne, wraz z wyraźnym wskazaniem, gdzie udostępniono te informacje potencjalnym inwestorom przed wyceną. Jeżeli jednostka sponsorująca nie posiada dostępu do takich danych, potwierdzenie, że sprzedawca zapewnił dostęp do danych określonych w art. 24 ust. 14 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 2.2.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

						Potwierdzenie, że dane są dostępne, i wyraźne wskazanie, gdzie te informacje są dostępne, oraz jasne oświadczenie, że dane obejmują okres nie krótszy niż pięć lat, z wyjątkiem należności z tytułu dostaw i usług oraz innych należności krótkoterminowych, dla których taki okres obserwacji historycznej wynosi nie mniej niż trzy lata.	
STSAT38	art. 24 ust. 15	Jednorodność aktywów			√	Szczegółowe wyjaśnienie dotyczące sposobu zabezpieczenia sekurytyzacji pulą ekspozycji bazowych, które są jednorodne, z uwzględnieniem cech związanych z przepływami pieniężnymi poszczególnych rodzajów aktywów, łącznie z ich cechami umownymi, cechami dotyczącymi ryzyka kredytowego i przedterminowych spłat.	Pozycja 2.2.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT39	art. 24 ust. 15	Zobowiązania związane z ekspozycjami bazowymi			√	Potwierdzenie, że pula ekspozycji bazowych ma pozostały średni ważony okres trwania nie dłuższy niż rok i że rezydualny termin zapadalności żadnej z ekspozycji bazowych nie przekracza trzech lat. Potwierdzenie, czy zastosowanie ma odstępstwo dotyczące pul kredytów na zakup samochodu, umów leasingu samochodów i transakcji leasingu sprzętu zgodnie z art. 24 ust. 15 akapit trzeci rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 2.2.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT40	art. 24 ust. 15	Zobowiązania związane z ekspozycjami bazowymi			√	W stosownych przypadkach potwierdzenie, że ekspozycje bazowe: <ul style="list-style-type: none"> — nie obejmują kredytów zabezpieczonych nieruchomościami mieszkalnymi lub komercyjnymi ani w pełni gwarantowanych kredytów na nieruchomości mieszkalne, o których mowa w art. 129 ust. 1 akapit pierwszy lit. e) rozporządzenia (UE) nr 575/2013 (?), — zawierają zobowiązania, które są umownie wiążące i egzekwowlane, z możliwością pełnego dochodzenia roszczeń od dłużników, o określonych strumieniach płatności związanych z najmem, kwotą główną, odsetkami lub związanymi z jakimikolwiek innymi prawami do otrzymywania dochodów z aktywów uzasadniających takie płatności, 	Pozycja 2.2.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

						— nie obejmują zbywalnych papierów wartościowych zdefiniowanych w art. 4 ust. 1 pkt 44 dyrektywy 2014/65/UE ⁽³⁾ , innych niż obligacje korporacyjne, i które nie są notowane w systemie obrotu.	
STSAT41	art. 24 ust. 16	Płatności odsetek według stóp referencyjnych oparte na powszechnie stosowanych stopach procentowych		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy płatności odsetek według stóp referencyjnych w ramach aktywów i zobowiązań sekurytyzacji ABCP są obliczane na podstawie ogólnie stosowanych rynkowych stóp procentowych, czy na podstawie ogólnie stosowanych stóp sektorowych odzwierciedlających koszt środków pieniężnych, oraz w jaki sposób dokonuje się tych obliczeń.	Pozycje 2.2.2 i 2.2.13 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT42	art. 24 ust. 17	Żadne środki pieniężne nie zostają zatrzymane po doręczeniu zawiadomienia o wszczęciu egzekucji lub o przyspieszeniu spłaty		√		Zwięzłe wyjaśnienie, czy spełniono wszystkie wymogi art. 24 ust. 17 rozporządzenia (UE) 2017/2402, w tym zwięzłe wyjaśnienie dotyczące przypadków, w których środki pieniężne mogą być zatrzymane.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT43	art. 24 ust. 17	a) Żadne środki pieniężne nie zostają zatrzymane po doręczeniu zawiadomienia o wszczęciu egzekucji lub o przyspieszeniu spłaty	√			Potwierdzenie, że żadne środki pieniężne nie zostaną zatrzymane po doręczeniu zawiadomienia o wszczęciu egzekucji lub zawiadomienia o przyspieszeniu spłaty.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT44	art. 24 ust. 17	b) Inwestorzy otrzymują środki z tytułu kwoty głównej	√			Potwierdzenie, że inwestorzy otrzymują środki z tytułu kwoty głównej ekspozycji bazowych w drodze sekwencyjnej amortyzacji pozycji sekurytyzacyjnej w kolejności według uprzywilejowania danej pozycji sekurytyzacyjnej.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT45	art. 24 ust. 17	c) Żadne przepisy nie mogą wymagać automatycznej likwidacji ekspozycji bazowych według wartości rynkowej	√			Potwierdzenie, że żadne przepisy nie wymagają automatycznej likwidacji ekspozycji bazowych według wartości rynkowej.	Pozycja 3.4.5 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT46	art. 24 ust. 18	Zasadność standardów zawierania umów kredytowych			√	Szczegółowe wyjaśnienie, czy ekspozycje bazowe zostały zainicjowane w toku zwykłej działalności sprzedawcy, wskazując, czy zastosowane standardy zawierania umów kredytowych są nie mniej rygorystyczne niż standardy stosowane względem ekspozycji nieobjętych sekurytyzacją.	Pozycja 2.2.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

						Szczegółowe wyjaśnienie, czy wszelkie istotne zmiany w stosunku do wcześniejszych standardów zawierania umów kredytowych zostały w pełni ujawnione jednostce sponsorującej i innym stronom bezpośrednio posiadającym ekspozycję z tytułu sekurytyzacji ABCP.	
STSAT47	art. 24 ust. 18	Wiedza fachowa sprzedawcy			√	Szczegółowe wyjaśnienie, czy sprzedawca posiada wymaganą fachową wiedzę w zakresie inicjowania ekspozycji o charakterze podobnym do charakteru ekspozycji, które zostały objęte sekurytyzacją.	Pozycja 2.2.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT48	art. 24 ust. 19	Odnawialna sekurytyzacja ABCP/czynnik pogorszenia jakości kredytowej.			√	Szczegółowe wyjaśnienie dotyczące sposobu uwzględnienia w dokumentacji sekurytyzacji przepisów lub czynników uruchamiających określonych w art. 24 ust. 19 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycje 2.3 i 2.4 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT49	art. 24 ust. 20	Obowiązki uczestników procesu sekurytyzacji	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji sekurytyzacji uwzględniono zobowiązania umowne, obowiązki i zadania jednostki sponsorującej, jednostki obsługującej i powiernika, o ile taki jest, oraz innych dostawców usług pomocniczych.	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT50	art. 24 ust. 20	Postanowienia dotyczące ciągłości obsługi zadłużenia	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji sekurytyzacji uwzględniono procedury i zadania niezbędne do zapewnienia, aby niewykonanie zobowiązania lub niewypłacalność jednostki obsługującej nie spowodowały zakończenia obsługi.	Pozycja 3.7 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT51	art. 24 ust. 20	Postanowienia dotyczące ciągłości funkcjonowania kontrahentów instrumentów pochodnych oraz banku, w którym prowadzony jest rachunek	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji sekurytyzacji uwzględniono postanowienia zapewniające zastąpienie kontrahentów instrumentów pochodnych oraz banku, w którym prowadzony jest rachunek, w przypadku niewykonania przez nich zobowiązań, ich niewypłacalności oraz innych określonych zdarzeń, w stosownych przypadkach.	Pozycja 3.8 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAT52	art. 24 ust. 20	Stabilność jednostki sponsorującej	√			Potwierdzenie, że w dokumentacji sekurytyzacji uwzględniono sposób, w jaki jednostka sponsorująca spełnia wymogi określone w art. 25 ust. 3 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980

(¹) W stosownych przypadkach należy dołączyć odniesienie do odpowiednich sekcji dokumentów bazowych, jeżeli informacje takie są dostępne.

(²) Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 575/2013 z dnia 26 czerwca 2013 r. w sprawie wymogów ostrożnościowych dla instytucji kredytowych i firm inwestycyjnych, zmieniające rozporządzenie (UE) nr 648/2012, (Dz.U. L 176 z 27.6.2013, s. 1).

(³) Dyrektywa Parlamentu Europejskiego i Rady 2014/65/UE z dnia 15 maja 2014 r. w sprawie rynków instrumentów finansowych oraz zmieniająca dyrektywę 2002/92/WE i dyrektywę 2011/61/UE (Dz.U. L 173 z 12.6.2014, s. 349).

ZAŁĄCZNIK III

Informacje, które należy dostarczyć ESMA zgodnie z art. 25 i 26 rozporządzenia (UE) 2017/2402 w sprawie programów ABCP

Informacje ogólne

Numer pola	Numer artykułu rozporządzenia (UE) 2017/2402	Nazwa pola	Informacje podlegające zgłoszeniu ⁽¹⁾	Informacje dodatkowe
STSAP0	art. 27 ust. 1	Pierwszy punkt kontaktowy	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI) podmiotu wyznaczonego jako pierwszy punkt kontaktowy i nazwa odpowiedniego właściwego organu	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAP1	Nie dotyczy	Kod identyfikacyjny instrumentu	Międzynarodowe kody identyfikujące papiery wartościowe (kody ISIN) przypisane do programów ABCP, w stosownych przypadkach.	Jeżeli jest dostępny, zgodnie z pozycją 3.1 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980.
STSAP2	Nie dotyczy	Identyfikator podmiotu prawnego (LEI)	LEI jednostek sponsorujących lub programów ABCP, jeżeli jest dostępny.	Pozycja 4.2 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAP3	Nie dotyczy	Identyfikator zgłoszenia	W przypadku zgłaszania aktualizacji – niepowtarzalny numer referencyjny nadany przez ESMA zgłoszonemu wcześniej zgłoszeniu STS.	Nie dotyczy
STSAP4	Nie dotyczy	Niepowtarzalny identyfikator	Niepowtarzalny identyfikator nadany przez jednostkę sprawozdawczą temu programowi transakcji ABCP zgodnie z art. 11 ust. 1 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224.	Nie dotyczy
STSAP5	Nie dotyczy	Identyfikator prospektu emisyjnego	Identyfikator prospektu emisyjnego dostarczony przez odpowiedni właściwy organ, jeżeli jest dostępny.	Nie dotyczy
STSAP6	Nie dotyczy	Repozytorium sekurytyzacji	Nazwa zarejestrowanego repozytorium sekurytyzacji, jeżeli jest dostępna.	Nie dotyczy
STSAP7	Nie dotyczy	Nazwa sekurytyzacji	Nazwa programu ABCP	Sekcja 4 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAP8	art. 18 i art. 27 ust. 3	Państwo prowadzenia działalności	Państwo siedziby jednostki sponsorującej lub jednostek sponsorujących.	Pozycja 4.3 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAP9	Nie dotyczy	Klasyfikacja sekurytyzacji	Rodzaj sekurytyzacji (nieobjęta ABCP, ABCP, program ABCP)	Nie dotyczy

STSAP10	Nie dotyczy	Data emisji	Data pierwszej emisji programu ABCP	Pozycja 4 załącznika 9 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAP11	Nie dotyczy	Data zgłoszenia	Data zgłoszenia STS do ESMA	Nie dotyczy
STSAP12	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, oświadczenie stwierdzające zgodność z kryteriami STS potwierdzone przez tę upoważnioną osobę trzecią.	Nie dotyczy
STSAP13	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, nazwa osoby trzeciej i miejsce prowadzenia działalności.	Nie dotyczy
STSAP14	art. 27 ust. 2	Upoważniona osoba trzecia	W przypadku gdy upoważniona osoba trzecia świadczyła usługi weryfikacji STS zgodnie z art. 27 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402, nazwa właściwego organu, który upoważnił osobę trzecią.	Nie dotyczy
STSAP15	art. 27 ust. 5	Status STS	Zgłoszenie przez jednostkę sponsorującą, że programu ABCP nie należy już uznać za STS z podaniem powodów tej zmiany.	Nie dotyczy

(¹) W stosownych przypadkach należy dołączyć odniesienie do odpowiednich sekcji dokumentów bazowych, jeżeli informacje takie są dostępne.

Informacje szczegółowe

Numer pola	Numer artykułu rozporządzenia (UE) 2017/2402	Nazwa pola	Potwierdzenie	Zwięzłe wyjaśnienie	Szczegółowe wyjaśnienie	Informacje podlegające zgłoszeniu (¹)	Informacje dodatkowe
STSAP16	art. 25 ust. 1	Jednostka sponsorująca nadzorowana przez instytucję kredytową	√			Potwierdzenie, że jednostkę sponsorującą programu nadzoruje instytucja kredytowa oraz odniesienie do dokumentu poświadczającego taki status.	Nie dotyczy
STSAP17	art. 25 ust. 2	Wsparcie jednostki sponsorującej jako dostawcy instrumentu wsparcia płynności	√			Potwierdzenie, że jednostka sponsorująca programu ABCP zapewni instrument wsparcia płynności oraz że wspiera wszystkie pozycje sekurytyzacyjne programu ABCP, w tym opis instrumentu wsparcia płynności i odniesienie do dowolnego dokumentu potwierdzającego takie postanowienie.	Nie dotyczy

STSAP18	art. 25 ust. 3	Wykazanie przez instytucję kredytową przed właściwym organem	√		Potwierdzenie, że ze względu na jej rolę jednostki sponsorującej, instytucja kredytowa nie zagraża jej wypłacalności i płynności, oraz, jeżeli jest dostępne, odniesienie do dokumentu potwierdzającego, że instytucja wykazała tę pozycję przed właściwym organem.	Nie dotyczy
STSAP19	art. 25 ust. 4	Zgodność z wymogami <i>due diligence</i> jednostki sponsorującej	√		Potwierdzenie zgodności jednostki sponsorującej z wymogami <i>due diligence</i> określonymi w art. 5 ust. 1 i 3 rozporządzenia (UE) 2017/2402, stosownie do przypadku. Potwierdzenie, że jednostka sponsorująca zwerifikowała, czy sprzedawca dysponuje zdolnościami obsługi i procesami ściągania należności, które spełniają wymogi określone w art. 265 ust. 2 lit. i)–p) rozporządzenia (UE) nr 575/2013 lub równoważne wymogi w państwach trzecich.	Nie dotyczy
STSAP20	art. 25 ust. 5	Sprzedawca (na poziomie transakcji) lub jednostka sponsorująca (na poziomie programu ABCP) muszą spełniać wymogi dotyczące zatrzymania ryzyka, o których mowa w art. 6.		√	Zwięzłe wyjaśnienie, w jaki sposób sprzedawca (sekurytyzacja ABCP) i jednostka sponsorująca (program ABCP) spełniają wymogi dotyczące zatrzymania ryzyka określone na podstawie art. 6 rozporządzenia (UE) 2017/2402 określającego wariant wykorzystany do zatrzymania ryzyka, w tym: 1) części pionowej – tj. art. 6 ust. 3 lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 2) udziału sprzedawcy – tj. art. 6 ust. 3 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 3) losowo wybranych ekspozycji utrzymywanych w bilansie – tj. art. 6 ust. 3 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 4) transzy pierwszej straty – tj. art. 6 ust. 3 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 5) ekspozycji pierwszej straty w przypadku każdego składnika aktywów – tj. art. 6 ust. 3 lit. e) rozporządzenia (UE) 2017/2402; 6) brak zgodności z wymogami zatrzymania ryzyka rozporządzenia (UE) 2017/2402; 7) inne.	Pozycja 3.4.3 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
STSAP21	art. 25 ust. 6	Zgodność na poziomie programu ABCP z art. 7 (wymogi dotyczące przejrzystości)	√		Potwierdzenie, że: — jednostka sponsorująca jest odpowiedzialna za przestrzeganie przepisów art. 7 rozporządzenia (UE) 2017/2402, — jednostka sponsorująca stosuje się do przepisów art. 7 na poziomie programu ABCP,	Nie dotyczy

						— jednostka sponsorująca udostępniła potencjalnym inwestorom przed wyceną na ich żądanie: zbiorcze informacje wymagane na podstawie art. 7 ust. 1 akapit pierwszy lit. a) rozporządzenia (UE) 2017/2402 oraz informacje wymagane na podstawie art. 7 ust. 1 akapit pierwszy lit. b)–e) rozporządzenia (UE) 2017/2402 co najmniej w formie projektu lub we wstępnej formie.	
STSAP22	art. 25 ust. 7	Wykorzystanie instrumentu wsparcia płynności, w przypadku gdy jednostka sponsorująca nie odnowi zobowiązań finansowych dotyczących takiego instrumentu	√			Zwięzłe wyjaśnienie ze strony sponsora, czy instrument wsparcia płynności zostanie wykorzystany, a zapadające papiery wartościowe spłacone w przypadku nieodnowienia przez jednostkę sponsorującą zobowiązania finansowego dotyczącego instrumentu wsparcia płynności przed jego wygaśnięciem.	Nie dotyczy
STSAP23	art. 26 ust. 1	Zgodność sekurytyzacji ABCP w ramach programu ABCP z art. 24 ust. 1–8 i ust. 12–20	√			Potwierdzenie, czy wszystkie sekurytyzacje ABCP w ramach programu spełniają następujące wymogi: <ul style="list-style-type: none"> — art. 24 ust. 1–8 rozporządzenia (UE) 2017/2402, — art. 24 ust. 12–20 rozporządzenia (UE) 2017/2402. 	Nie dotyczy
STSAP24	art. 26 ust. 1 akapity drugi i trzeci	Maksymalnie 5 % zbiorczej kwoty ekspozycji, które są ekspozycjami bazowymi ABCP może tymczasowo nie spełniać pewnych wymogów			√	Szczegółowe wyjaśnienie dotyczące tego, z którymi, o ile z którymkolwiek, wymogami art. 24 ust. 9, 10 lub 11 rozporządzenia (UE) 2017/2402 tymczasowo brak jest zgodności oraz odsetek zbiorczej kwoty ekspozycji, które są ekspozycjami bazowymi sekurytyzacji ABCP, reprezentujący ten brak zgodności, oraz dlaczego program spowodował tymczasowe naruszenie tych wymogów. Potwierdzenie, że odpowiednia i niezależna strona prowadzi regularną zewnętrzną weryfikację zgodności próby ekspozycji bazowych.	Nie dotyczy
STSAP25	art. 26 ust. 2	Pozostały średni ważony okres trwania ekspozycji bazowych programu ABCP nie może być dłuższy niż dwa lata.	√			Potwierdzenie, że pozostały średni ważony okres trwania ekspozycji bazowych programu ABCP nie jest dłuższy niż dwa lata.	Nie dotyczy

STSAP26	art. 26 ust. 3	W pełni wspierany program ABCP (przez jednostkę sponsorującą)		√		Zwięzłe wyjaśnienie dotyczące tego, czy jednostka sponsorująca w pełni wspiera program ABCP zgodnie z art. 25 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Nie dotyczy
STSAP27	art. 26 ust. 4	Brak resekurytyzacji i brak wsparcia jakości kredytowej ustanawiającego dodatkową warstwę transz na poziomie programu ABCP	√			Potwierdzenie, że program ABCP nie obejmuje żadnej resekurytyzacji oraz że wsparcie jakości kredytowej nie ustanawia dodatkowej warstwy transz na poziomie programu.	Nie dotyczy
STSAP28	art. 26 ust. 5	Brak opcji kupna	√			Potwierdzenie, że program ABCP nie zawiera opcji kupna ani klauzuli mających wpływ na ostateczny termin zapadalności, w przypadku gdy takie opcje lub klauzule mogą być wykonywane według uznania sprzedawcy, jednostki sponsorującej lub SSPE.	Nie dotyczy
STSAP29	art. 26 ust. 6	Odpowiednio ograniczone i udokumentowane ryzyko stopy procentowej i ryzyko walutowe powstające na poziomie programu ABCP.			√	Szczegółowe wyjaśnienie dotyczące tego, czy i w jaki sposób ryzyko stopy procentowej i ryzyko walutowe powstające na poziomie programu ABCP są odpowiednio ograniczane, a także jakie środki wykorzystano do ograniczenia takiego ryzyka, w tym czy SSPE zawiera kontrakty pochodne z przyczyn innych niż określone w art. 26 ust. 6 rozporządzenia (UE) 2017/2402, a także opis sposobu, w jaki takie instrumenty pochodne są zawierane i dokumentowane, a w szczególności czy jest to wykonywane zgodnie ze wspólnymi standardami w dziedzinie finansów międzynarodowych.	Nie dotyczy
STSAP30	art. 26 ust. 7 lit. a)	Wymogi dotyczące dokumentacji programu ABCP (obowiązki powiernika wobec inwestorów)	√			Potwierdzenie, że obowiązki powiernika oraz innych podmiotów mających obowiązki powiernicze, o ile takie istnieją, wobec inwestorów, określono w dokumentacji programu ABCP.	Nie dotyczy
STSAP31	art. 26 ust. 7 lit. b)	Wymogi dotyczące dokumentacji programu ABCP (zobowiązania umowne jednostki sponsorującej)	√			Potwierdzenie, że zobowiązania umowne, obowiązki i zadania jednostki sponsorującej, powiernika i innych dostawców usług pomocniczych, o ile tacy są, określono w dokumentacji programu ABCP.	Nie dotyczy

STSAP32	art. 26 ust. 7 lit. c)	Wymogi dotyczące dokumentacji programu ABCP (proces i obowiązek w przypadku jednostki obsługującej zagrożonej niewykonaniem zobowiązania)	√		Potwierdzenie, że w dokumentacji programu ABCP zawarto procesy i obowiązki dotyczące jednostki obsługującej zagrożonej niewykonaniem zobowiązania lub niewypłacalnością, by zapewnić ciągłość świadczenia usług.	Nie dotyczy
STSAP33	art. 26 ust. 7 lit. d)	Wymogi dotyczące dokumentacji programu ABCP (postanowienia dotyczące zastąpienia kontrahentów instrumentów pochodnych oraz banku, w którym prowadzony jest rachunek)	√		Potwierdzenie, że spełnione są wymogi na mocy art. 26 ust. 7 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/2402 w zakresie postanowienia dotyczącego zastąpienia kontrahentów instrumentów pochodnych oraz banku, w którym prowadzony jest rachunek, na poziomie programu ABCP w przypadku niewykonania przez nich zobowiązania, ich niewypłacalności oraz innych określonych zdarzeń, jeżeli instrument wsparcia płynności nie pokrywa takich zdarzeń.	Nie dotyczy
STSAP34	art. 26 ust. 7 lit. e)	Wymogi dotyczące dokumentacji programu ABCP (procedury służące zapewnieniu zabezpieczenia zobowiązań finansowych)	√		Potwierdzenie, że dokumentacja programu ABCP zawiera procedury zapewniające, aby w przypadku wystąpienia określonych zdarzeń, niewykonania zobowiązania lub niewypłacalności jednostki sponsorującej, przewidziane były środki naprawcze w celu osiągnięcia, stosownie do sytuacji, zabezpieczenia zobowiązań finansowych lub zastąpienia dostawcy instrumentu wsparcia płynności. Oświadczenie wskazujące odpowiednie strony prospektu emisyjnego lub innej dokumentacji bazowej, która zawiera informacje stosowne do wymogów określonych w art. 26 ust. 7 lit. e) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Nie dotyczy
STSAP35	art. 26 ust. 7 lit. f)	Wymogi dotyczące dokumentacji programu ABCP (instrument wsparcia płynności i zapadające papiery wartościowe do spłacenia, jeżeli jednostka sponsorująca nie odnowi zobowiązania finansowego dotyczącego instrumentu wsparcia płynności przed jego wygaśnięciem)	√		Potwierdzenie, że dokumentacja programu ABCP zawiera postanowienia zapewniające, aby instrument wsparcia płynności został wykorzystany, a zapadające papiery wartościowe spłacone w przypadku nieodnowienia przez jednostkę sponsorującą zobowiązania finansowego dotyczącego instrumentu wsparcia płynności przed jego wygaśnięciem. Oświadczenie wskazujące odpowiednie strony prospektu emisyjnego lub innej dokumentacji bazowej, która zawiera informacje stosowne do wymogów określonych w art. 26 ust. 7 lit. f) rozporządzenia (UE) 2017/2402.	Nie dotyczy

STSAP36	art. 26 ust. 8	Wiedza fachowa jednostki obsłu- gującej		√	Szczegółowe wyjaśnienie dotyczące sposobu, w jaki spełnia się wymogi art. 26 ust. 8 rozporządzenia (UE) 2017/2402, w tym wyjaśnienie strategii i procedur zapewniających zgodność z tymi wymogami Oświadczenie wskazujące odpowiednie strony prospektu emisyjnego lub innej dokumentacji bazowej, które zawierają stosowne wyjaśnienia mające na celu spełnienie wymogów określonych w art. 26 ust. 8 rozporządzenia (UE) 2017/2402 (w stosownych przypadkach) („wiedza fachowa jednostki obsługującej, polityka, procedury i zarządzanie ryzykiem”).	Pozycja 3.2 załącznika 19 do rozporządzenia delegowanego Komisji (UE) 2019/980
---------	-------------------	---	--	---	--	--

(¹) W stosownych przypadkach należy dołączyć odniesienie do odpowiednich sekcji dokumentów bazowych, jeżeli informacje takie są dostępne. Informacje szczegółowe