

ROZPORZĄDZENIE DELEGOWANE KOMISJI (UE) 2020/1229**z dnia 29 listopada 2019 r.****uzupełniające rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) 2017/2402 w odniesieniu do regulacyjnych standardów technicznych dotyczących standardów operacyjnych repozytorium sekurytyzacji w zakresie gromadzenia, agregowania, porównywania i udostępniania danych oraz weryfikacji ich kompletności i spójności****(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. 10 ust. 7 lit. a) oraz art. 17 ust. 2 lit. b), c) i d),

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Podmioty, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, powinny być w stanie wykonywać swoje odpowiednie zadania, uprawnienia i obowiązki. Informacje udostępniane tym podmiotom przez repozytoria sekurytyzacji powinny zatem być wysokiej jakości i powinno być możliwe ich agregowanie i porównywanie między różnymi repozytoriami sekurytyzacji w terminowy, kompleksowy i uporządkowany sposób. Przed udostępnieniem tych informacji tym podmiotom repozytoria sekurytyzacji powinny zatem ocenić, czy informacje te są kompletne i spójne, oraz powinny udostępnić im sprawozdanie na koniec dnia i ogólny wskaźnik kompletności danych.
- (2) Procedury weryfikacji, czy informacje zgłaszane do repozytoriów sekurytyzacji przez jednostki inicjujące, jednostki sponsorujące lub jednostki specjalnego przeznaczenia do celów sekurytyzacji są kompletne i spójne, powinny uwzględniać różne rodzaje, cechy i praktyki sekurytyzacji. Należy zatem określić procedury weryfikacji, które obejmują porównywanie informacji zgłoszonych w odniesieniu do podobnych sekurytyzacji, takich jak sekurytyzacje tej samej jednostki inicjującej lub powiązanych jednostek inicjujących bądź sekurytyzacje z takim samym lub pokrewnym rodzajem ekspozycji bazowej, elementem strukturalnym lub elementem geograficznym.
- (3) Aby zapewnić jakość zgłaszanych informacji, procedury weryfikacji powinny mieć również zastosowanie do kompletności i spójności dokumentacji stanowiącej podstawę tych informacji. Zważywszy jednak na fakt, że weryfikacja kompletności i spójności tej dokumentacji jest stosunkowo trudna, repozytoria sekurytyzacji powinny zwracać się do jednostek przekazujących informacje o pisemne potwierdzenie kompletności i spójności udostępnionej przez nie dokumentacji bazowej dotyczącej sekurytyzacji. Istotne aktualizacje już przekazanej dokumentacji powinny być uznawane za nowy dokument dotyczący sekurytyzacji, który wymaga wystąpienia z wnioskiem o pisemne potwierdzenie.
- (4) Aby podmioty, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, były w stanie wykonywać swoje odpowiednie zadania, uprawnienia i obowiązki, szczegółowe informacje na temat sekurytyzacji, do których podmioty te muszą mieć bezpośredni i natychmiastowy dostęp, powinny być porównywalne między repozytoriami sekurytyzacji w sposób spójny i zharmonizowany. Te szczegółowe informacje powinny być zatem udostępniane w formacie XML (Extensible Markup Language), gdyż jest on powszechnie stosowany w branży finansowej.
- (5) Należy zapewnić poufność każdego rodzaju danych wymienianych między repozytoriami sekurytyzacji oraz podmiotami, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402. Taka wymiana danych powinna zatem być realizowana za pośrednictwem bezpiecznego połączenia maszyna-maszyna przy użyciu protokołów szyfrowania danych. W celu zapewnienia minimalnych wspólnych standardów należy stosować protokół komunikacyjny SSH File Transfer Protocol.

⁽¹⁾ Dz.U. L 347 z 28.12.2017, s. 35.

- (6) Dane dotyczące aktualnych sekurytyzacyjnych ekspozycji bazowych, sprawozdań dla inwestorów, informacji wewnętrznych oraz informacji na temat znaczącego zdarzenia, a także wskaźniki jakości i aktualności tych danych, mają zasadnicze znaczenie dla bieżącego monitorowania istniejących i potencjalnych inwestycji w sekurytyzację, jak również stabilności finansowej i ryzyka systemowego. Podmioty, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, powinny mieć zatem dostęp do tych danych w sposób doraźny lub w z góry określonych przedziałach czasowych, proporcjonalnie do ich potrzeb w zakresie otrzymywania tych danych.
- (7) Sekurytyzacje są złożone i niejednorodne, a użytkownicy danych przechowywanych w repozytoriach sekurytyzacji są różnorodni. Kwestią o zasadniczym znaczeniu jest więc ułatwienie bezpośredniego i natychmiastowego dostępu do określonych zbiorów danych i informacji. Dostęp ten powinien obejmować dostęp do wszystkich bieżących i historycznych informacji na temat sekurytyzacji przechowywanych w danym repozytorium, a w przypadku gdy informacje te odnoszą się do danych – dostęp w formacie umożliwiającym odczyt maszynowy. W tym celu należy określić ramy dotyczące składania doraźnych wniosków, które można łączyć w celu uzyskania określonych informacji. Terminy, w których repozytoria sekurytyzacji powinny udostępniać dane podmiotom, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, należy zharmonizować w celu ułatwienia wydajnego przetwarzania danych przez te podmioty i repozytoria sekurytyzacji. Jednocześnie należy zapewnić, by dane były uzyskiwane w terminach umożliwiających skuteczne wypełnianie obowiązków przez podmioty ubiegające się o te dane.
- (8) Podmioty, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, wykorzystują dane przechowywane przez repozytoria sekurytyzacji, w tym do celów porównywania aktualnych sekurytyzacji z wcześniejszymi sekurytyzacjami. Należy w związku z tym ustanowić przepis, zgodnie z którym repozytoria powinny przechowywać dokumentację dotyczącą sekurytyzacji przez 10 lat po zakończeniu sekurytyzacji, zgodnie z art. 10 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402 i art. 80 ust. 3 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 ⁽³⁾.
- (9) Przepisy niniejszego rozporządzenia są ze sobą ściśle powiązane, ponieważ odnoszą się do standardów i procedur dotyczących gromadzenia i przetwarzania informacji przechowywanych przez repozytoria sekurytyzacji oraz dostępu do tych informacji. Przepisy te należy zatem włączyć do jednego rozporządzenia.
- (10) Podstawę niniejszego rozporządzenia stanowi projekt regulacyjnych standardów technicznych przedłożony Komisji przez Europejski Urząd Nadzoru Giełd i Papierów Wartościowych (ESMA).
- (11) ESMA przeprowadził otwarte konsultacje publiczne na temat projektu regulacyjnych standardów technicznych, który stanowi podstawę niniejszego rozporządzenia, dokonał analizy możliwych kosztów i korzyści, które mogą się z nim wiązać, oraz zwrócił się o opinię do Grupy Interesariuszy z Sektora Giełd i Papierów Wartościowych powołanej zgodnie z art. 37 rozporządzenia Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 1095/2010 ⁽⁴⁾.

PRZYJMUJE NINIEJSZE ROZPORZĄDZENIE:

Artykuł 1

Definicje

Do celów niniejszego rozporządzenia stosuje się następujące definicje:

- a) „jednostka przekazująca informacje” oznacza jednostkę wyznaczoną zgodnie z art. 7 ust. 2 rozporządzenia (UE) 2017/2402;
- b) „data graniczna dla wykorzystywanych danych” oznacza datę odniesienia dla informacji zgłaszanych zgodnie z rozporządzeniem delegowanym Komisji (UE) 2020/1224 ⁽⁴⁾.

⁽³⁾ Rozporządzenie Parlamentu Europejskiego i Rady (UE) nr 648/2012 z dnia 4 lipca 2012 r. w sprawie instrumentów pochodnych będących przedmiotem obrotu poza rynkiem regulowanym, kontrahentów centralnych i repozytoriów transakcji (Dz.U. L 201 z 27.7.2012, s. 1).

⁽⁴⁾ 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 uchylecia decyzji Komisji 2009/77/WE (Dz.U. L 331 z 15.12.2010, s. 84).

⁽⁴⁾ 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 szczegóły dotyczące sekurytyzacji, które mają być udostępnione przez jednostkę inicjującą, jednostkę sponsorującą oraz SSPE (zob. s. 1 niniejszego Dziennika Urzędowego).

Artykuł 2

Sprawozdanie na koniec dnia

1. Repozytoria sekurytyzacji sporządzają codziennie jedno zagregowane sprawozdanie na koniec dnia dla wszystkich zgłoszonych im sekurytyzacji, z wyłączeniem wszelkich zgłoszonych sekurytyzacji, które zostały odrzucone zgodnie z art. 4 ust. 6. Sprawozdanie to opiera się na najbardziej aktualnych przekazanych informacjach, nie uwzględnia żadnych zgłoszonych sekurytyzacji, które zostały odrzucone zgodnie z art. 4 ust. 6, oraz zawiera co najmniej następujące informacje:

- a) niepowtarzalny identyfikator przypisany zgodnie z art. 11 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;
- b) kody ISIN transz, obligacji lub pożyczek podporządkowanych w ramach sekurytyzacji, jeżeli są dostępne;
- c) sumę bieżących sald kwoty głównej wszystkich transz, obligacji lub pożyczek podporządkowanych sekurytyzacji, w EUR, obliczoną przy zastosowaniu kursów wymiany opublikowanych na stronie internetowej Europejskiego Banku Centralnego za poprzedni dzień roboczy;
- d) nazwę sekurytyzacji;
- e) określenie, czy sekurytyzacja jest sekurytyzacją ABCP lub sekurytyzacją inną niż ABCP;
- f) określenie, czy rodzajem struktury sekurytyzacji jest rodzaj „M” odpowiadający zarządowi powierniczemu zgodnie ze zgłoszeniem w polu SESS9 w załączniku XIV do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224 lub rodzaj „S” w przypadku wszystkich innych sekurytyzacji;
- g) określenie, czy metodą transferu ryzyka sekurytyzacji jest „T” w przypadku prawdziwej sprzedaży zgodnie ze zgłoszeniem w polu IVSS11 w załączniku XII do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224 lub „S” w przypadku sekurytyzacji syntetycznej zgodnie ze zgłoszeniem w polu SESV11 w załączniku XIV do tego rozporządzenia lub „ABCP” w przypadku sekurytyzacji ABCP;
- h) nazwę i identyfikator podmiotu prawnego („LEI”) jednostki inicjującej, jednostki sponsorującej i SSPE;
- i) ostatni dzień płatności odsetek w formacie daty zgodnym z ISO 8601;
- j) znacznik czasu, w formacie daty i czasu (UTC) zgodnym z ISO 8601, z dokładnością do pełnej sekundy, ostatniego zgłoszenia danych otrzymanego przez repozytorium sekurytyzacji lub, w przypadku gdy istnieje więcej zgłoszeń danych odnoszących się do tej samej daty granicznej dla wykorzystywanych danych, znaczniki czasu, w formacie daty i czasu (UTC) zgodnym z ISO 8601, najwcześniejszego i najpóźniejszego zgłoszenia danych spośród zgłoszeń z tą samą datą graniczną dla wykorzystywanych danych;
- k) data graniczna dla wykorzystywanych danych, w formacie daty zgodnym z ISO 8601, ostatniego zgłoszenia danych otrzymanego przez repozytorium sekurytyzacji;
- l) liczbę zgłoszeń danych otrzymanych przez repozytorium sekurytyzacji, które odnoszą się do tej samej daty granicznej dla wykorzystywanych danych określonej w lit. k);
- m) wskaźnik kompletności danych, o którym mowa w art. 3, dla ostatniego zgłoszenia danych otrzymanego przez repozytorium sekurytyzacji;
- n) w odniesieniu do sekurytyzacji innych niż ABCP – państwo siedziby jednostki inicjującej lub pierwotnego kredytodawcy;
- o) w odniesieniu do sekurytyzacji ABCP – państwo siedziby jednostki sponsorującej;
- p) państwo, w którym zlokalizowana jest większość ekspozycji bazowych, pod względem bieżącego salda kwoty głównej ekspozycji bazowych;
- q) przeważający rodzaj ekspozycji bazowych w ramach sekurytyzacji, pod względem bieżącego salda kwoty głównej.
- r) Do celów lit. n), w przypadku gdy ekspozycje bazowe sekurytyzacji stanowią połączenie ekspozycji wielu jednostek inicjujących lub pierwotnych kredytodawców, państwem siedziby jednostki inicjującej lub pierwotnego kredytodawcy jest państwo jednostki inicjującej lub pierwotnego kredytodawcy, której(-go) kwota ekspozycji w ramach sekurytyzacji jest największa, pod względem bieżącego salda kwoty głównej.

2. Sprawozdanie na koniec dnia repozytoria sekurytyzacji udostępniają w formacie XML.

3. Znaczniki czasu, o których mowa w niniejszym artykule, nie mogą różnić się o więcej niż jedną sekundę od uniwersalnego czasu koordynowanego (UTC) ustalonego i utrzymywanego przez jedno z centrów czasowych wymienionych w najnowszym rocznym sprawozdaniu dotyczącym oznaczania czasu (*Annual Report on Time Activities*) opublikowanym przez Bureau International des Poids et Mesures (Międzynarodowe Biuro Miar).

Artykuł 3

Określanie wskaźnika kompletności danych

4. Repozytoria sekurytyzacji określają wskaźnik kompletności danych w odniesieniu do każdego zgłoszenia danych, stosując macierz przedstawioną w tabeli 1 w załączniku oraz następujące dane wejściowe:

$$\text{Input 1} = \frac{\sum_i^N ND1}{N}$$

$$\text{Input 2} = \frac{\sum_i^N ND2 + \sum_i^N ND3 + \sum_i^N ND4}{N}$$

gdzie:

$\sum_i^N NDx$ określa łączną liczbę pól w zgłoszeniu danych zawierających odpowiednie wartości opcji „brak danych” („ND”),

które zostały zgłoszone zgodnie z art. 9 ust. 3 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;

N określa łączną liczbę pól w zgłoszeniu danych, w których dopuszcza się zgłoszenie dowolnych wartości opcji „brak danych” („ND1” do „ND4”) zgodnie z art. 9 ust. 3 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224.

Do celów określania wskaźnika kompletności danych pola wypełnione z zastosowaniem formatu „ND4-RRRR-MM-DD” uznaje się za pola wypełnione z zastosowaniem wartości „ND4”.

Artykuł 4

Weryfikacja kompletności i spójności informacji

1. Repozytoria sekurytyzacji weryfikują kompletność i spójność zgłaszanych im informacji, sprawdzając, co następuje:
 - a) nazwę jednostki przekazującej informacje zgłoszoną w polu IVSS4 w załączniku XII lub w polu IVAS3 w załączniku XIII do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;
 - b) poprawność kodu pozycji dla zgłoszenia, podanego w tabeli 3 w załączniku I do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224.
2. W odniesieniu do informacji, o których mowa w art. 7 ust. 1 lit. a), e), f) i g) rozporządzenia (UE) 2017/2402, repozytoria sekurytyzacji sprawdzają również kompletność i spójność informacji przez:
 - a) sprawdzenie, czy zgłoszone informacje są zgodne ze strukturą i formatem szablonów określonych w załącznikach II–XV do rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) 2020/1225 ^(*);
 - b) porównanie zgłoszonych informacji:
 - (i) między różnymi polami dla tej samej daty granicznej dla wykorzystywanych danych oraz tej samej pozycji dotyczącej ekspozycji bazowej, sprawozdania dla inwestorów, informacji wewnętrznych lub informacji na temat znaczącego zdarzenia;
 - (ii) między różnymi pozycjami dotyczącymi ekspozycji bazowych, sprawozdania dla inwestorów, informacji wewnętrznych lub informacji na temat znaczącego zdarzenia dla tego samego pola i tej samej daty granicznej dla wykorzystywanych danych;
 - (iii) między tymi samymi pozycjami dotyczącymi ekspozycji bazowych, sprawozdania dla inwestorów, informacji wewnętrznych lub informacji na temat znaczącego zdarzenia dla tego samego pola i różnych dat granicznych dla wykorzystywanych danych;
 - (iv) między podobnymi sekurytyzacjami;

^(*) Rozporządzenie wykonawcze Komisji (UE) 2020/1225 z dnia 29 października 2019 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do formatu i ujednoliconych szablonów na potrzeby udostępniania przez jednostkę inicjującą, jednostkę sponсорującą i SSPE informacji oraz szczegółowych informacji na temat sekurytyzacji (zob. s. 217 niniejszego Dziennika Urzędowego).

- c) sprawdzenie, czy data graniczna dla wykorzystywanych danych w odniesieniu do zgłoszonych informacji oraz znacznik czasu zgłoszenia są zgodne z art. 10 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;
- d) sprawdzenie, czy opcje „brak danych” określone w art. 9 ust. 3 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224 są wykorzystywane wyłącznie w dozwolonych przypadkach i nie sprawiają, że zgłoszenie danych jest niedostatecznie reprezentatywne dla ekspozycji bazowych w danej sekurytyzacji.

W przypadku sekurytyzacji ABCP odesłania do ekspozycji bazowych w niniejszym ustępie należy rozumieć jako odesłania do rodzajów ekspozycji bazowych.

3. Repozytoria sekurytyzacji weryfikują kompletność i spójność dokumentacji udostępnionej im na podstawie art. 7 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, zwracając się do jednostek przekazujących informacje o pisemne potwierdzenie, że:

- a) wszystkie pozycje, o których mowa w tabeli 3 w załączniku I do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224 i które należy przekazać na podstawie art. 7 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402, zostały przekazane repozytorium sekurytyzacji;
- b) dokumentacja jest spójna z faktycznymi ustaleniami i cechami dotyczącymi danej sekurytyzacji.

4. O pisemne potwierdzenie, o którym mowa w ust. 3, występuje się w następujących terminach:

- a) pięciu dni roboczych od pierwszej emisji papierów wartościowych w ramach sekurytyzacji lub – w przypadku sekurytyzacji ABCP – pięciu dni roboczych od pierwszej emisji papierów wartościowych w ramach programu ABCP;
- b) co dwanaście miesięcy od dat wystąpienia o potwierdzenie, o których mowa w lit. a);
- c) pięciu dni roboczych od udostępnienia nowego dokumentu na podstawie art. 7 ust. 1 lit. b) rozporządzenia (UE) 2017/2402.

Repozytorium sekurytyzacji, które nie otrzymało pisemnego potwierdzenia w terminie 14 dni od dnia dowolnego wystąpienia o potwierdzenie, o którym mowa w akapicie pierwszym, zwraca się do jednostki przekazującej informacje o przekazanie mu pisemnego potwierdzenia w terminie 14 dni.

5. Repozytoria sekurytyzacji sprawdzają, czy zgłoszenie STS, o którym mowa w art. 7 ust. 1 lit. d) rozporządzenia (UE) 2017/2402, udostępnione danemu repozytorium sekurytyzacji jest zgodne ze strukturą i formatem szablonów określonych w załącznikach do rozporządzenia wykonawczego Komisji (UE) 2020/1227 ⁽⁶⁾.

6. Repozytorium sekurytyzacji odrzuca zgłoszenie informacji, które jest niekompletne lub niespójne zgodnie z ust. 1, 2 i 5, z wyjątkiem ust. 2 lit. b) ppkt (iii) i (iv). Repozytorium sekurytyzacji przypisuje zgłoszenia odrzucone na podstawie niniejszego ustępu do jednej z kategorii odrzucenia określonych w tabeli 2 w załączniku.

7. Repozytorium sekurytyzacji powiadamia bez zbędnej zwłoki podmioty, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, o tym, że:

- a) przedłożone informacje są niekompletne lub niespójne zgodnie z ust. 2 lit. b) ppkt (iii) i (iv);
- b) repozytorium sekurytyzacji nie otrzymało pisemnego potwierdzenia, o którym mowa w ust. 3.

8. W ciągu godziny od otrzymania informacji, o których mowa w art. 7 rozporządzenia (UE) 2017/2402, repozytoria sekurytyzacji przekazują jednostkom przekazującym informacje szczegółowe informacje zwrotne na temat wyników weryfikacji dokonanych na podstawie ust. 1, 2, 3 i 5, w tym o wszelkich kategoriach odrzucenia przypisanych zgodnie z ust. 6. Te informacje zwrotne muszą również obejmować co najmniej następujące elementy:

- a) niepowtarzalny identyfikator sekurytyzacji przypisany zgodnie z art. 11 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;

⁽⁶⁾ Rozporządzenie wykonawcze Komisji 2020/1227 z dnia 12 listopada 2019 r. ustanawiające wykonawcze standardy techniczne w odniesieniu do szablonów na potrzeby przekazywania informacji zgodnie z wymogami dotyczącymi zgłoszenia STS (zob. s. 315 niniejszego Dziennika Urzędowego).

- b) kod(y) pozycji, o którym(-ych) mowa w tabeli 3 w załączniku I do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;
 - c) znacznik czasu zgłoszenia, w formacie daty i czasu (UTC) zgodnym z ISO 8601, z dokładnością do pełnej sekundy, przekazanych informacji.
9. Do godziny 19.00.00 (UTC) w każdy poniedziałek repozytoria sekurytyzacji sporządzają sprawozdanie na temat wszystkich informacji odrzuconych przez nie od godziny 19.00.00 (UTC) w poprzedni poniedziałek. Sprawozdanie to zawiera co najmniej następujące pozycje:
- a) niepowtarzalny identyfikator sekurytyzacji przypisany zgodnie z art. 11 rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;
 - b) nazwę sekurytyzacji;
 - c) kody ISIN transz lub obligacji lub pożyczek podporządkowanych sekurytyzacji, jeżeli są dostępne;
 - d) nazwę i kod LEI jednostki inicjującej, jednostki sponsorującej i SSPE;
 - e) znacznik czasu, w formacie daty i czasu (UTC) zgodnym z ISO 8601, z dokładnością do pełnej sekundy, przekazanych informacji;
 - f) kod pozycji dla zgłoszenia, o którym to kodzie mowa w tabeli 3 w załączniku I do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224;
 - g) kategorię odrzucenia, o której mowa w tabeli 2 w załączniku do niniejszego rozporządzenia, oraz konkretne okoliczności prowadzące do przypisania tej kategorii odrzucenia;
 - h) wszelkie wyjaśnienia przedstawione przez jednostkę przekazującą informacje przed godziną 17.00.00 (UTC) w poniedziałek będący dniem publikacji sprawozdania i dotyczące tego, dlaczego przekazane informacje są niekompletne lub niespójne lub dlaczego nie przekazano pisemnego potwierdzenia, o którym mowa w ust. 3.

Artykuł 5

Szczegółowe informacje, do których należy zapewnić dostęp

Szczegółowe informacje, o których mowa w art. 17 ust. 2 lit. c) rozporządzenia (UE) 2017/2402, obejmują:

- a) wszystkie informacje otrzymane zgodnie z rozporządzeniem (UE) 2017/2402 przez repozytorium sekurytyzacji od jednostek przekazujących informacje;
- b) sprawozdanie na koniec dnia, o którym mowa w art. 2, wskaźnik kompletności danych, o którym mowa w art. 3, oraz wszelkie informacje wynikające z weryfikacji dokonanych na podstawie art. 4 niniejszego rozporządzenia;
- c) wszystkie wzory oraz metody obliczeń i agregacji wykorzystane do wygenerowania informacji, o których mowa w lit. a) i b).

Artykuł 6

Warunki dostępu do szczegółowych informacji

1. Dostępu do informacji, o których mowa w art. 5, udziela się na wniosek. Wniosek o udzielenie dostępu zawiera następujące informacje:

- a) nazwa podmiotu występującego z wnioskiem;
- b) dane osoby wyznaczonej do kontaktów w podmiocie występującym z wnioskiem o dostęp;
- c) rodzaj podmiotu występującego z wnioskiem o dostęp, zgodnie z art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402;
- d) imiona i nazwiska osób w podmiocie występującym z wnioskiem, które będą miały dostęp do przedmiotowych informacji;
- e) dane uwierzytelniające na potrzeby bezpiecznego połączenia za pomocą protokołu komunikacyjnego SSH File Transfer Protocol, zgodnie z wymogami art. 7 ust. 2;
- f) określenie, czy wniosek jest wnioskiem doraźnym lub też wnioskiem o udostępnienie informacji w z góry określonych przedziałach czasowych;

- g) wskazanie informacji, których dotyczy wnioski o dostęp, w oparciu o dowolne połączenie kryteriów, o których mowa w ust. 4;
- h) wszelkie inne informacje techniczne istotne dla dostępu podmiotu występującego z wnioskiem.

2. Do celów ust. 1 repozytoria sekurytyzacji:

- a) wyznaczają osobę lub osoby odpowiedzialne za utrzymywanie kontaktów z podmiotami, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402;
- b) publikują na swojej stronie internetowej warunki dostępu do informacji oraz instrukcje dotyczące składania wniosku o dostęp do tych informacji;
- c) zapewniają dostęp wyłącznie do informacji określonych we wniosku o udzielenie dostępu;
- d) tak szybko jak to możliwe, a najpóźniej trzydziestego dnia po otrzymaniu wniosku o ustanowienie dostępu do tych informacji, wprowadzają rozwiązania techniczne niezbędne do umożliwienia podmiotom, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, składania wniosków o dostęp do tych informacji.

3. Dostępu do informacji, o których mowa w art. 5, udziela się w następujących terminach:

- a) najpóźniej o godzinie 19.00.00 (UTC) w dniu, do którego odnosi się wniosek, w przypadku wniosku doraźnego lub wniosku o udostępnienie informacji w z góry określonych przedziałach czasowych, odnoszącego się do sprawozdania na koniec dnia, o którym mowa w art. 2;
- b) najpóźniej o godzinie 12.00.00 (UTC) pierwszego dnia następującego po dniu otrzymania wniosku o udzielenie dostępu, w przypadku gdy informacje dotyczą sekurytyzacji, która albo nie została jeszcze wyceniona, albo nie osiągnęła jeszcze terminu zapadalności lub której termin zapadalności upłynął mniej niż rok od daty złożenia wniosku o udzielenie dostępu;
- c) najpóźniej trzeciego dnia roboczego następującego po dniu otrzymania wniosku o udzielenie dostępu, w przypadku gdy informacje dotyczą sekurytyzacji, której termin zapadalności upłynął ponad rok od daty złożenia wniosku o udzielenie dostępu;
- d) najpóźniej trzeciego dnia roboczego następującego po dniu otrzymania wniosku o udzielenie dostępu, w przypadku gdy informacje dotyczą wielu sekurytyzacji, w przypadku których zastosowanie ma zarówno lit. b), jak i c).

4. Repozytoria sekurytyzacji udzielają podmiotom, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402, dostępu do informacji, o których mowa w art. 5, na podstawie dowolnego połączenia następujących kryteriów:

- a) rodzaj sekurytyzacji: inna niż ABCP lub ABCP;
- b) rodzaj struktury sekurytyzacji: „M” w przypadku zarządu powierniczego zgodnie ze zgłoszeniem w polu SESS9 w załączniku XIV do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224 albo „S” w przypadku wszystkich innych sekurytyzacji;
- c) metoda transferu ryzyka sekurytyzacji: „T” w przypadku prawdziwej sprzedaży zgodnie ze zgłoszeniem w polu IVSS11 w załączniku XII do rozporządzenia delegowanego (UE) 2020/1224 lub „S” w przypadku sekurytyzacji syntetycznej zgodnie ze zgłoszeniem w polu SESV11 w załączniku XIV do tego rozporządzenia lub „ABCP” w przypadku sekurytyzacji ABCP;
- d) kod pozycji sekurytyzacyjnej;
- e) rodzaj sekurytyzacyjnej ekspozycji bazowej;
- f) sekcja szablonu sekurytyzacyjnej ekspozycji bazowej;
- g) sekcja szablonu sprawozdania dla inwestorów;
- h) sekcja szablonu informacji wewnętrznych oraz informacji na temat znaczącego zdarzenia;
- i) identyfikator:
 - (i) niepowtarzalny identyfikator;
 - (ii) identyfikator transakcji;
 - (iii) międzynarodowy kod identyfikujący papier wartościowy;

- (iv) identyfikator nowej lub pierwotnej transzy lub obligacji;
 - (v) identyfikator nowej lub pierwotnej ekspozycji bazowej;
 - (vi) identyfikator nowego lub pierwotnego dłużnika;
 - (vii) identyfikator podmiotu prawnego (LEI) jednostki inicjującej;
 - (viii) identyfikator podmiotu prawnego (LEI) jednostki sponsorującej;
 - (ix) identyfikator podmiotu prawnego (LEI) SSPE;
 - (x) identyfikator podmiotu prawnego (LEI) pierwotnego kredytodawcy;
 - (xi) identyfikator podmiotu prawnego (LEI) podmiotu zarządzającego instrumentem typu CLO;
- j) elementy geograficzne:
- (i) region geograficzny;
 - (ii) prawo właściwe;
- k) data i godzina:
- (i) znacznik czasu zgłoszenia;
 - (ii) data graniczna dla wykorzystywanych danych;
 - (iii) data emisji transzy lub obligacji;
 - (iv) prawny termin zapadalności transzy lub obligacji;
 - (v) data powstania ekspozycji bazowej;
 - (vi) data zapadalności ekspozycji bazowej;
- l) waluta:
- (i) waluta transzy lub obligacji;
 - (ii) określenie waluty ekspozycji bazowej.
5. Repozytoria sekurytyzacji udostępniają następujące informacje w formacie XML:
- a) informacje, o których mowa w art. 7 ust. 1 lit. a) i lit. d)–g) rozporządzenia (UE) 2017/2402;
 - b) informacje sporządzone przez repozytoria sekurytyzacji zgodnie z art. 2 i 4 niniejszego rozporządzenia, z wyjątkiem pisemnych potwierdzeń otrzymanych na podstawie art. 4 ust. 3.

Artykuł 7

Standardy gromadzenia i udostępniania danych

1. Repozytoria sekurytyzacji stosują podpis elektroniczny oraz protokoły szyfrowania danych do celów otrzymywania danych od jednostek przekazujących informacje lub innych repozytoriów sekurytyzacji oraz do celów przesyłania danych podmiotom, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402.
2. Do celów ust. 1 repozytoria sekurytyzacji ustanawiają i utrzymują bezpieczny interfejs maszyna-maszyna oraz udostępniają ten interfejs jednostkom przekazującym informacje oraz podmiotom, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402. Interfejs ten wykorzystuje protokół komunikacyjny SSH File Transfer Protocol.
3. Repozytoria sekurytyzacji stosują znormalizowane komunikaty XML na potrzeby łączności za pośrednictwem interfejsu, o którym mowa w ust. 2, oraz udostępniania informacji określonych w art. 6 ust. 5 niniejszego rozporządzenia podmiotom, o których mowa w art. 17 ust. 1 rozporządzenia (UE) 2017/2402.

*Artykuł 8***Prowadzenie dokumentacji**

1. Repozytoria sekurytyzacji rejestrują, co następuje:
 - a) weryfikacje dokonane na podstawie niniejszego rozporządzenia oraz wszelkie inne kontrole poprawności dokonane przez repozytorium sekurytyzacji;
 - b) pisemne potwierdzenia otrzymane przez repozytorium sekurytyzacji, o których mowa w art. 4 ust. 3;
 - c) wyniki przekazane przez repozytorium sekurytyzacji zgodnie z art. 4 ust. 6 jednostce przekazującej informacje;
 - d) wszelkie wyjaśnienia przedstawione przez jednostkę przekazującą informacje i dotyczące tego, dlaczego przekazane informacje są niekompletne lub niespójne lub dlaczego nie przekazano pisemnego potwierdzenia, o którym mowa w art. 4 ust. 7;
 - e) w rejestrze zgłoszeń – szczegółowe informacje na temat wszelkich przypadków korekty lub cofnięcia zgłoszeń dokonanych przez jednostkę przekazującą informacje;
 - f) wszelkie inne informacje sporządzone lub przedłożone na podstawie niniejszego rozporządzenia.
2. Każdy wpis w dokumentacji przechowuje się przez 10 lat od upływu terminu zapadalności sekurytyzacji, do której odnosi się dany wpis.
3. W rejestrze zgłoszeń, o którym mowa w ust. 1 lit. d), ujmuje się niepowtarzalny identyfikator sekurytyzacji, kod pozycji, znacznik czasu przedmiotowego zgłoszenia, znacznik czasu zmian w zgłoszeniu oraz jasny opis zmian w przedłożonych informacjach, w tym poprzednią i nową treść tych informacji.

*Artykuł 9***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 29 listopada 2019 r.

W imieniu Komisji
Jean-Claude JUNCKER
Przewodniczący

ZAŁĄCZNIK

Macierz na potrzeby określania wskaźnika kompletności danych oraz kategorie odrzucenia zgłoszenia

Tabela 1

Macierz na potrzeby określania wskaźnika kompletności danych

		Dane wejściowe 1: Odsetek pól wypełnionych jako „ND1”			
		dane wejściowe 1 = 0 %	0 % < dane wejściowe 1 ≤ 10 %	10 % < dane wejściowe 1 ≤ 30 %	dane wejściowe 1 > 30 %
Dane wejściowe 2: Odsetek pól wypełnionych jako „ND2”, „ND3” lub „ND4-RRRR-MM-DD”	dane wejściowe 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < dane wejściowe 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < dane wejściowe 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	dane wejściowe 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabela 2

Kategorie odrzucenia zgłoszenia

Kategorie odrzucenia zgłoszenia	Uzasadnienie
Schemat	Zgłoszenie informacji odrzucono z powodu niezgodnego schematu.
Upoważnienie	Zgłoszenie informacji odrzucono, ponieważ jednostka przekazująca informacje nie była upoważniona do dokonania zgłoszenia w imieniu jednostki inicjującej, jednostki sponsorującej lub SSPE.
Logika	Zgłoszenie informacji odrzucono, ponieważ kod pozycji nie odpowiada wartościom dostępnym w tabeli 3 załącznika 1 do rozporządzenia delegowanego 2020/1224.
Treść	Zgłoszenie informacji odrzucono, ponieważ przedłożone dane są niezgodne z co najmniej jednym kryterium poprawności treści.
Reprezentatywność	Zgłoszenie informacji odrzucono na podstawie art. 4 ust. 6.