

# Amtsblatt der Europäischen Union

# L 289



Ausgabe  
in deutscher Sprache

## Rechtsvorschriften

63. Jahrgang

3. September 2020

### Inhalt

#### II Rechtsakte ohne Gesetzescharakter

#### VERORDNUNGEN

- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind** <sup>(1)</sup> .... 1
- ★ **Durchführungsverordnung (EU) 2020/1225 der Kommission vom 29. Oktober 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format und die standardisierten Meldebögen, die vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft zur Bereitstellung der Einzelheiten von Verbriefungen zu verwenden sind** <sup>(1)</sup> ..... 217
- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission vom 12. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Spezifizierung der gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung zu übermittelnden Informationen** <sup>(1)</sup> ..... 285
- ★ **Durchführungsverordnung (EU) 2020/1227 der Kommission vom 12. November 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf Meldebögen für die Bereitstellung von Informationen gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung** <sup>(1)</sup> ..... 315
- ★ **Durchführungsverordnung (EU) 2020/1228 der Kommission vom 29. November 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format von Anträgen auf Registrierung als Verbriefungsregister oder auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates** <sup>(1)</sup> ..... 330
- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2020/1229 der Kommission vom 29. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die operativen Standards von Verbriefungsregistern für die Sammlung, die Aggregation und den Vergleich von Daten, den Zugang zu Daten sowie die Überprüfung der Vollständigkeit und der Konsistenz von Daten** <sup>(1)</sup> ..... 335

<sup>(1)</sup> Text von Bedeutung für den EWR.

# DE

Bei Rechtsakten, deren Titel in magerer Schrift gedruckt sind, handelt es sich um Rechtsakte der laufenden Verwaltung im Bereich der Agrarpolitik, die normalerweise nur eine begrenzte Geltungsdauer haben.

Rechtsakte, deren Titel in fetter Schrift gedruckt sind und denen ein Sternchen vorangestellt ist, sind sonstige Rechtsakte.

- ★ **Delegierte Verordnung (EU) 2020/1230 der Kommission vom 29. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten des Antrags auf Registrierung als Verbriefungsregister und der Einzelheiten des vereinfachten Antrags auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister <sup>(1)</sup> .....** 345

---

<sup>(1)</sup> Text von Bedeutung für den EWR.

## II

(Rechtsakte ohne Gesetzescharakter)

## VERORDNUNGEN

## DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2020/1224 DER KOMMISSION

vom 16. Oktober 2019

**zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind**

(Text von Bedeutung für den EWR)

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012<sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 7 Absatz 3 und Artikel 17 Absatz 2 Buchstabe a,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Artikel 7 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 gilt für Verbriefungen jeder Art, einschließlich solcher, für die gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(2)</sup> ein Prospekt zu erstellen ist, („öffentliche“ Verbriefungen) und solcher, für die kein Prospekt erstellt werden muss („private“ Verbriefungen). Artikel 17 Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 gilt für Verbriefungen, für die Informationen über ein Verbriefungsregister bereitgestellt werden, d. h. nicht für private Verbriefungen. Um dieser Unterscheidung Rechnung zu tragen, wurde diese Verordnung in separate Abschnitte unterteilt, in denen festgelegt wird, welche Informationen für sämtliche Verbriefungen und welche für öffentliche Verbriefungen anzugeben sind.
- (2) Bestimmte Informationen zu Verbriefungen müssen offengelegt werden, damit Anleger und potenzielle Anleger in der Lage sind, die gebotene Sorgfalt wirksam walten zu lassen und die Kreditrisiken sowie Modellrisiko, rechtliches und operationelles Risiko, Gegenparteiisiko, Forderungsverwaltungsrisiko, Liquiditätsrisiko und Konzentrationsrisiko der zugrunde liegenden Risikopositionen einer ordnungsgemäßen Bewertung zu unterziehen. Die offenzulegenden Informationen sollten ausreichend detailliert sein, damit die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen die Funktionsweise von Verbriefungsmärkten, Trends bei zugrunde liegenden Pools von Vermögenswerten, Verbriefungsstrukturen, Verflechtungen zwischen Gegenparteien und Auswirkungen der Verbriefung auf die makrofinanzielle Lage der Union wirksam überwachen können.
- (3) Viele Arten zugrunde liegender Risikopositionen können Gegenstand von Verbriefungen sein, z. B. Darlehen, Leasingverträge, Schulden, Kredite oder sonstige Zahlungsströme generierende Forderungen. Daher ist es angezeigt, maßgeschneiderte Meldepflichten für die häufigsten Arten zugrunde liegender Risikopositionen in der Union festzulegen, wobei sowohl den ausstehenden Beträgen als auch der lokalen Verteilung Rechnung zu tragen ist. Um sicherzustellen, dass alle Arten zugrunde liegender Risikopositionen offengelegt werden, sollten spezifische Meldepflichten für „esoterische“ zugrunde liegenden Risikopositionen festgelegt werden, die keiner der wichtigsten Arten zugeordnet werden können.

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

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

- (4) Eine zugrunde liegende Risikoposition kann unter mehrere Meldepflichten gemäß dieser Verordnung fallen. Im Einklang mit der derzeitigen Marktpraxis sollten Informationen über einen Pool zugrunde liegender Risikopositionen, der ausschließlich zugrunde liegende Kfz-Risikopositionen umfasst, unter Verwendung des entsprechenden in den Anhängen enthaltenen Meldebogens für zugrunde liegende Kfz-Risikopositionen gemeldet werden, und zwar unabhängig davon, ob es sich bei den zugrunde liegenden Kfz-Risikopositionen um Kredite oder Leasingverträge handelt. In gleicher Weise sollten im Einklang mit der derzeitigen Marktpraxis Informationen über einen Pool zugrunde liegender Risikopositionen, der ausschließlich Leasingverträge umfasst, unter Verwendung des entsprechenden in den Anhängen enthaltenen Meldebogens für zugrunde liegende Leasing-Risikopositionen gemeldet werden, es sei denn, der Pool zugrunde liegender Risikopositionen besteht ausschließlich aus Kfz-Leasingverträgen; in diesem Fall sollte der in den Anhängen enthaltene Meldebogen für Kfz-Risikopositionen verwendet werden.
- (5) Aus Gründen der Kohärenz sollten im Zusammenhang mit der Vergabe von Darlehen für Wohn- und Gewerbeimmobilien aus der Empfehlung ESRB/2016/14 des Europäischen Ausschusses für Systemrisiken <sup>(3)</sup> abgeleitete Begriffe verwendet werden. Im Einklang mit dieser Empfehlung sollten Immobilien, die sowohl für Wohn- als auch Gewerbezwecke genutzt werden, als unterschiedliche Immobilien betrachtet werden, sofern eine solche Aufschlüsselung möglich ist. Ist eine solche Aufschlüsselung nicht möglich, sollte die Immobilie nach ihrer vorherrschenden Nutzung eingestuft werden.
- (6) Um die Kontinuität mit bestehenden Meldebögen für die Offenlegung bestimmter Informationen zu gewährleisten, sollten in Bezug auf Kleinstunternehmen sowie kleine und mittlere Unternehmen aus der Empfehlung 2003/361/EG der Kommission <sup>(4)</sup> abgeleitete Begriffe verwendet werden. In gleicher Weise sollten in Bezug auf zugrunde liegende Risikopositionen in Form von Kfz-Krediten, Verbraucherkrediten, Kreditkarten und Leasingverträgen aus der Delegierten Verordnung (EU) 2015/3 der Kommission <sup>(5)</sup> abgeleitete Begriffe verwendet werden.
- (7) Die Granularität der Informationen, die über zugrunde liegende Risikopositionen von Nicht-ABCP-Verbriefungen offenzulegen sind, sollte die in den Bestimmungen für Offenlegung und Datenerhebung geforderte Informationstiefe auf Kredit-/Leasingebene widerspiegeln. Für Sorgfalts-, Überwachungs- und Aufsichtszwecke ist eine Aufschlüsselung der Daten auf Ebene der zugrunde liegenden Risikopositionen von großem Interesse für Anleger und potenzielle Anleger in Verbriefungen sowie zuständige Behörden und — in Bezug auf öffentliche Verbriefungen — die anderen in Artikel 17 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen. Darüber hinaus spielen auf Ebene der zugrunde liegenden Risikopositionen aufgeschlüsselte Daten eine Schlüsselrolle für die Wiederherstellung des Vertrauens der Öffentlichkeit und der Anleger in die Verbriefungsmärkte. Bei ABCP-Verbriefungen besteht aufgrund der Kurzfristigkeit der Verbindlichkeiten und aufgrund der Tatsache, dass es neben zugrunde liegenden Risikopositionen noch andere Unterstützungen gibt, ein geringerer Bedarf an Daten auf Kredit-/Leasingebene.
- (8) Anleger, potenzielle Anleger, zuständige Behörden und — in Bezug auf öffentliche Verbriefungen — die anderen in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen haben weniger Bedarf an Informationen über „inaktive“ Risikopositionen. Solche „inaktive“ Risikopositionen, wie Kredite, die ohne Aussicht auf künftige Rückflüsse ausgefallen sind, oder Kredite, die zurückgezahlt, frühzeitig rückgezahlt, annulliert, zurückgekauft oder substituiert wurden, wirken sich nicht mehr auf das Risikoprofil der Verbriefung aus. Deshalb sollte bei inaktiven Risikopositionen aus Gründen der Transparenz zwar gemeldet werden, dass ihr Status von „aktiv“ auf „inaktiv“ übergegangen ist, danach ist eine Meldung solcher Risikopositionen jedoch nicht mehr erforderlich.
- (9) Die Meldepflichten gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 können unter Umständen die Bereitstellung einer großen Anzahl und Vielzahl von Unterlagen und anderer Angaben erfordern. Um die Rückverfolgung dieser Unterlagen zu erleichtern, sollten Originator, Sponsor oder Verbriefungszweckgesellschaft bei der Bereitstellung von Informationen an ein Verbriefungsregister bestimmte Positionscodes verwenden.
- (10) Im Einklang mit den bewährten Verfahren für Meldepflichten und in der Absicht, Anlegern, potenziellen Anlegern, zuständigen Behörden und — in Bezug auf öffentliche Verbriefungen — den anderen in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen die Rückverfolgung der relevanten Informationen zu erleichtern, sollten den bereitgestellten Informationen standardisierte Kennungen zugewiesen werden. Diese standardisierten Kennungen sollten eindeutig sein und nicht verändert werden, damit die Entwicklung von Verbriefungsdaten im Laufe der Zeit wirksam überwacht werden kann.

<sup>(3)</sup> Empfehlung ESRB/2016/14 des Europäischen Ausschusses für Systemrisiken vom 31. Oktober 2016 zur Schließung von Lücken bei Immobiliendaten (ABl. C 31 vom 31.1.2017, S. 1).

<sup>(4)</sup> Empfehlung 2003/361/EG der Kommission vom 6. Mai 2003 betreffend die Definition der Kleinstunternehmen sowie der kleinen und mittleren Unternehmen (ABl. L 124 vom 20.5.2003, S. 36).

<sup>(5)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2015/3 der Kommission vom 30. September 2014 zur Ergänzung der Verordnung (EG) Nr. 1060/2009 des Europäischen Parlaments und des Rates in Bezug auf technische Regulierungsstandards für die Offenlegungspflichten bei strukturierten Finanzinstrumenten (ABl. L 2 vom 6.1.2015, S. 57).

- (11) Um Anleger, potenzielle Anleger, zuständige Behörden und — in Bezug auf öffentliche Verbriefungen — die anderen in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen in die Lage zu versetzen, ihren Sorgfaltspflichten und sonstigen Verpflichtungen gemäß dieser Verordnung nachzukommen, müssen die bereitgestellten Informationen vollständig, kohärent und aktuell sein. Änderungen der Risikomerkmale der zugrunde liegenden Risikopositionen oder der durch diese zugrunde liegenden Risikopositionen generierten aggregierten Cashflows oder Änderungen bezüglich anderer Informationen des Anlegerberichts können die Wertentwicklung der Verbriefung und die Preise der Tranchen/Anleihen dieser Verbriefung wesentlich beeinflussen. Daher sollten bei öffentlichen Verbriefungen Insiderinformationen und Informationen über wichtige Ereignisse bereitgestellt werden, sobald Informationen über zugrunde liegende Risikopositionen und der Anlegerbericht über ein Verbriefungsregister zur Verfügung gestellt werden. Darüber hinaus sollten bei öffentlichen Verbriefungen Insiderinformationen und Informationen über wichtige Ereignisse detaillierte Angaben zur Nicht-ABCP-Verbriefung, zum ABCP-Programm, zur ABCP-Transaktion, zu den Tranchen/Anleihen, Konten und Gegenparteien sowie Angaben zu Merkmalen, die für synthetische oder durch besicherte Kredite unterlegte Verbriefungen („CLO-Verbriefungen“) relevant sind, enthalten.
- (12) Aus Gründen der Transparenz sollten Originator, Sponsor oder Verbriefungszweckgesellschaft im Falle, dass Informationen nicht verfügbar oder nicht relevant sind, den genauen Grund und die näheren Umstände der Nichtübermittlung der Daten in standardisierter Weise angeben und erläutern. Zu diesem Zweck sollten „No data“-Optionen entwickelt werden, die bestehende Verfahren für die Offenlegung von Verbriefungsdaten widerspiegeln.
- (13) Die „No data“ („ND“)-Optionen sollten nur genutzt werden, wenn Informationen aus berechtigten Gründen nicht verfügbar sind, weil z. B. eine bestimmte Meldeposition aufgrund der Heterogenität der zugrunde liegenden Risikopositionen für eine bestimmte Verbriefung nicht relevant ist. Die Nutzung von ND-Optionen sollte jedoch in keiner Weise zu einer Umgehung der Meldepflichten führen. Die Nutzung von ND-Optionen sollte daher kontinuierlich objektiv überprüfbar sein, indem den zuständigen Behörden auf Anfrage jederzeit die Umstände, die zur Angabe von ND-Werten geführt haben, erläutert werden.
- (14) Im Interesse der Datengenauigkeit sollten sich die gemeldeten Informationen stets auf dem neuesten Stand befinden. Die bereitgestellten Informationen sollten sich daher auf einen Zeitraum beziehen, der so nah wie möglich am Datum ihrer Übermittlung liegt, und den operativen Schritten, die Originator, Sponsor oder Verbriefungszweckgesellschaft durchführen müssen, um die erforderlichen Informationen zu organisieren und zu übermitteln, gebührend Rechnung tragen.
- (15) Die Bestimmungen dieser Verordnung sind eng miteinander verknüpft, da sie festlegen, welche Informationen Originator, Sponsor oder Verbriefungszweckgesellschaft einer Verbriefung den verschiedenen Parteien gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 über diese Verbriefung zur Verfügung stellen müssen. Um sicherzustellen, dass zwischen diesen Bestimmungen, die gleichzeitig in Kraft treten sollten, Kohärenz gewährleistet ist, und um einen umfassenden Überblick über alle für die Verbriefung relevanten Angaben sowie einen problemlosen Zugriff darauf zu erleichtern, sollten diese technischen Regulierungsstandards in einer einzigen Verordnung zusammengefasst werden.
- (16) Die vorliegende Verordnung stützt sich auf die Entwürfe technischer Regulierungsstandards, die der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurden.
- (17) Die ESMA hat zu diesem Entwurf eine offene öffentliche Konsultation durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(6)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

#### **Begriffsbestimmungen**

Für die Zwecke dieser Verordnung bezeichnet der Begriff

1. „meldende Stelle“ die gemäß Artikel 7 Absatz 2 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 benannte Einrichtung;

<sup>(6)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

2. „Datenstichtag“ den Stichtag für Meldungen gemäß dieser Verordnung;
3. „aktive zugrunde liegende Risikoposition“ eine zugrunde liegende Risikoposition, von der am Datenstichtag erwartet werden kann, dass sie in Zukunft Mittelzuflüsse oder -abflüsse bewirkt;
4. „inaktive zugrunde liegende Risikoposition“ eine zugrunde liegende Risikoposition, die ohne Aussicht auf künftige Rückflüsse ausgefallen ist oder zurückgezahlt, frühzeitig rückgezahlt, annulliert, zurückgekauft oder substituiert wurde;
5. „Schuldendeckungsquote“ das Verhältnis zwischen den jährlichen Mieteinkünften aus einer vollständig oder teilweise fremdfinanzierten Gewerbeimmobilie nach Abzug von Steuern und Betriebsausgaben zur Erhaltung des Werts der Immobilie und den jährlichen kombinierten Zins- und Kapitalrückzahlungen auf die Gesamtschuld des Kreditnehmers für den durch die Immobilie besicherten Kredit über einen bestimmten Zeitraum;
6. „Zinsdeckungsquote“ das Verhältnis zwischen den jährlichen Bruttomieteinkünften vor Betriebsausgaben und Steuern aus einer zur Weitervermietung erworbenen Immobilie oder den jährlichen Nettomieteinkünften aus einer oder mehreren Gewerbeimmobilien und den jährlichen Zinskosten für den durch die Immobilie oder die Immobilien besicherten Kredit.

#### ABSCHNITT 1

#### **Für alle Verbriefungen bereitzustellende Informationen**

#### Artikel 2

#### **Informationen über zugrunde liegende Risikopositionen**

(1) Die Informationen, die gemäß Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 für Nicht-ABCP-Verbriefungen bereitzustellen sind, umfassen Folgendes:

- a) Angaben zu wohnimmobilienbesicherten Krediten an private Haushalte unabhängig vom Zweck der Kreditvergabe gemäß Anhang II;
- b) Angaben zu Krediten, die dem Ankauf von Gewerbeimmobilien dienen oder durch Gewerbeimmobilien besichert sind, gemäß Anhang III;
- c) Angaben zu zugrunde liegenden Unternehmensrisikopositionen, einschließlich Krediten an Kleinst- sowie kleine und mittlere Unternehmen gemäß Anhang IV;
- d) Angaben zu zugrunde liegenden Kfz-Risikopositionen, einschließlich kraftfahrzeugbesicherter Kredite und Leasingverträge mit juristischen oder natürlichen Personen, gemäß Anhang V;
- e) Angaben zu zugrunde liegenden Konsumentenrisikopositionen gemäß Anhang VI;
- f) Angaben zu zugrunde liegenden Kreditkartenrisikopositionen gemäß Anhang VII;
- g) Angaben zu zugrunde liegenden Leasingrisikopositionen gemäß Anhang VIII;
- h) Angaben zu zugrunde liegenden Risikopositionen, die unter keine der unter den Buchstaben a bis g genannten Kategorien fallen, gemäß Anhang IX.

Für die Zwecke von Buchstabe a bezeichnet der Begriff „Wohnimmobilie“ Immobilien, die für Wohnzwecke zur Verfügung stehen (einschließlich zur Weitervermietung erworbener Immobilien), von einem privaten Haushalt erworben, gebaut oder renoviert wurden und nicht unter Gewerbeimmobilien fallen.

Für die Zwecke von Buchstabe b bezeichnet der Begriff „Gewerbeimmobilie“ bestehende oder in Entwicklung befindliche Renditeobjekte ausschließlich Sozialwohnungen und Immobilien, die sich im Besitz der Endnutzer befinden.

(2) Umfasst eine Nicht-ABCP-Verbriefung mehr als eine der in Absatz 1 genannten Arten zugrunde liegender Risikopositionen, stellt die meldende Stelle dieser Verbriefung die im entsprechenden Anhang genannten Informationen für jede zugrunde liegende Risikoposition zur Verfügung.

(3) Die meldende Stelle einer Verbriefung einer notleidenden Risikoposition stellt die in folgenden Anhängen festgelegten Informationen zur Verfügung:

- a) je nach Art der zugrunde liegenden Risikoposition die in Absatz 1 Buchstaben a bis h genannten Anhänge;
- b) Anhang X.

Für die Zwecke dieses Absatzes bezeichnet der Begriff „Verbriefung einer notleidenden Risikoposition“ eine Nicht-ABCP-Verbriefung, bei der die Mehrheit der aktiven zugrunde liegenden Risikopositionen, gemessen am zum Datenstichtag ausstehenden Kapitalsaldo, zu einer der folgenden Kategorien zählt:

- a) in Anhang V Teil 2 Nummern 213 bis 239 der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 680/2014 der Kommission <sup>(7)</sup> genannte notleidende Risikopositionen;
  - b) finanzielle Vermögenswerte mit beeinträchtigter Bonität im Sinne von Anhang A des International Financial Reporting Standard 9 in der Verordnung (EG) Nr. 1126/2008 der Kommission <sup>(8)</sup> oder finanzielle Vermögenswerte, die nach den nationalen Vorschriften zur Anwendung der allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätze (GAAP) auf der Grundlage der Richtlinie 86/635/EWG des Rates <sup>(9)</sup> als Vermögenswerte mit beeinträchtigter Bonität ausgewiesen werden.
- (4) Die meldende Stelle einer ABCP-Transaktion stellt die in Anhang XI spezifizierten Informationen zur Verfügung.
- (5) Für die Zwecke dieses Artikels umfassen die gemäß den Absätzen 1 bis 4 bereitzustellenden Informationen Angaben zu:
- a) zum Datenstichtag aktiven zugrunde liegenden Risikopositionen;
  - b) inaktiven zugrunde liegenden Risikopositionen, die zum unmittelbar vorausgegangenen Datenstichtag aktive zugrunde liegende Risikopositionen waren.

### Artikel 3

#### Informationen über Anlegerberichte

- (1) Die meldende Stelle einer Nicht-ABCP-Verbriefung stellt die in Anhang XII festgelegten Informationen über Anlegerberichte zur Verfügung.
- (2) Die meldende Stelle einer ABCP-Verbriefung stellt die in Anhang XIII festgelegten Informationen über Anlegerberichte zur Verfügung.

### Artikel 4

#### Granularität der Informationen

- (1) Die meldende Stelle stellt die in den Anhängen II bis X und XII festgelegten Informationen zur Verfügung über:
- a) jede einzelne zugrunde liegende Risikoposition;
  - b) Sicherheiten mit Angaben zu jedem einzelnen Posten zur Besicherung jeder zugrunde liegenden Risikoposition, wenn eine der folgenden Bedingungen erfüllt ist:
    - i) Die zugrunde liegende Risikoposition ist durch eine Garantie besichert;
    - ii) die zugrunde liegende Risikoposition ist durch eine Sachsicherheit oder eine finanzielle Sicherheit besichert;
    - iii) der Kreditgeber kann unilateral Sicherungsrechte auf die zugrunde liegende Risikoposition schaffen, ohne dafür die Einwilligung des Schuldners oder Garantiegebers einholen zu müssen;
  - c) jeden der drei größten Mieter einer Gewerbeimmobilie, gemessen an der von jedem Mieter zu zahlenden jährlichen Gesamtmiete;
  - d) bisherige Rückzahlungen für jede zugrunde liegende Risikoposition für jeden der letzten 36 Monate vor dem Datenstichtag;

<sup>(7)</sup> Durchführungsverordnung (EU) Nr. 680/2014 der Kommission vom 16. April 2014 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die aufsichtlichen Meldungen der Institute gemäß der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates (ABl. L 191 vom 28.6.2014, S. 1).

<sup>(8)</sup> Verordnung (EG) Nr. 1126/2008 der Kommission vom 3. November 2008 zur Übernahme bestimmter internationaler Rechnungslegungsstandards gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1606/2002 des Europäischen Parlaments und des Rates (ABl. L 320 vom 29.11.2008, S. 1).

<sup>(9)</sup> Richtlinie 86/635/EWG des Rates vom 8. Dezember 1986 über den Jahresabschluss und den konsolidierten Abschluss von Banken und anderen Finanzinstituten (ABl. L 372 vom 31.12.1986, S. 1).

- e) Cashflows für jeden Zu- oder Abflussposten in der Verbriefung gemäß der geltenden Einnahmen- oder Zahlungsrangfolge zum Datenstichtag;
- f) sämtliche Tests/Ereignisse/Auslöser, die Änderungen der Zahlungsrangfolge oder den Ersatz einer Gegenpartei bewirken.

Für die Zwecke der Buchstaben a und d werden verbrieftete Kreditbestandteile als individuelle zugrunde liegende Risikopositionen behandelt.

Für die Zwecke von Buchstabe b wird jede Immobilie, die als Sicherheit für Kredite gemäß Artikel 2 Absatz 1 Buchstaben a und b dient, als eine einzige Sicherheit behandelt.

(2) Die meldende Stelle stellt die in den Anhängen XI und XIII festgelegten Informationen zur Verfügung über:

- a) sämtliche ABCP-Transaktionen, die das ABCP-Programm zum Datenstichtag umfasst;
- b) jedes ABCP-Programm, aus dem zum Datenstichtag ABCP-Transaktionen finanziert werden, für die gemäß Buchstabe a Informationen zur Verfügung gestellt werden;
- c) sämtliche Tests/Ereignisse/Auslöser der ABCP-Verbriefung, die Änderungen der Zahlungsrangfolge oder den Ersatz einer Gegenpartei bewirken;
- d) zugrunde liegende Risikopositionen, für jede ABCP-Transaktion, zu der gemäß Buchstabe a Informationen bereitgestellt werden, und für jede Art von Risikoposition, die zum Datenstichtag nach der Liste in Anhang XI Feld IVAL5 Teil der betreffenden ABCP-Transaktion ist.

## ABSCHNITT 2

### **Informationen über Verbriefungen, für die ein Prospekt erstellt werden muss (öffentliche Verbriefungen)**

#### Artikel 5

#### **Positionscodes**

Die meldenden Stellen weisen den für Verbriefungsregister bereitzustellenden Informationen Positionscodes zu. Die meldenden Stellen weisen zu diesem Zweck den in Anhang I Tabelle 3 aufgeführten Positionscodes zu, der die betreffenden Informationen am besten widerspiegelt.

#### Artikel 6

#### **Insiderinformationen**

- (1) Die meldende Stelle einer Nicht-ABCP-Verbriefung stellt die in Anhang XIV spezifizierten Insiderinformationen zur Verfügung.
- (2) Die meldende Stelle einer ABCP-Verbriefung stellt die in Anhang XV spezifizierten Insiderinformationen zur Verfügung.

#### Artikel 7

#### **Informationen über wichtige Ereignisse**

- (1) Die meldende Stelle einer Nicht-ABCP-Verbriefung stellt die in Anhang XIV spezifizierten Informationen über wichtige Ereignisse zur Verfügung.
- (2) Die meldende Stelle einer ABCP-Verbriefung stellt die in Anhang XV spezifizierten Informationen über wichtige Ereignisse zur Verfügung.

*Artikel 8***Granularität der Informationen**

- (1) Die meldende Stelle stellt die in Anhang XIV spezifizierten Informationen zur Verfügung über:
- a) die Tranchen/Anleihen in der Verbriefung für jede Tranchenemission in der Verbriefung oder einem anderen Instrument, dem eine Internationale Wertpapierkennnummer zugewiesen wurde, und für jedes nachrangige Darlehen in der Verbriefung;
  - b) jedes Konto in der Verbriefung;
  - c) jede Gegenpartei in der Verbriefung;
  - d) bei synthetischen Nicht-ABCP-Verbriefungen:
    - i) die synthetische Deckung für sämtliche Sicherungsvereinbarungen in der Verbriefung;
    - ii) Emittentensicherheiten für jede von der Verbriefungszweckgesellschaft im Namen von Anlegern gehaltene Sicherheit, die im Rahmen der betreffenden Sicherungsvereinbarung gestellt wird;
  - e) bei Nicht-ABCP-Verbriefungen, die durch besicherte Kredite unterlegt sind, („Collateralised Loan Obligation, CLO“):
    - i) jeden CLO-Verwalter in der Verbriefung;
    - ii) die CLO-Verbriefung.

Für die Zwecke von Buchstabe d Ziffer ii wird jeder Vermögenswert, für den es eine Internationale Wertpapierkennnummer gibt, als eine Sicherheit behandelt, werden Barsicherheiten derselben Währung aggregiert und als eine Sicherheit behandelt und Barsicherheiten verschiedener Währungen als getrennte Sicherheiten ausgewiesen.

- (2) Die meldende Stelle stellt die in Anhang XV festgelegten Informationen zur Verfügung über:
- a) sämtliche ABCP-Transaktionen, die das ABCP-Programm zum Datenstichtag umfasst;
  - b) sämtliche ABCP-Programme, aus denen zum Datenstichtag ABCP-Transaktionen finanziert werden, für die gemäß Buchstabe a Informationen zur Verfügung gestellt werden;
  - c) die Tranchen/Anleihen im ABCP-Programm für jede Emission von Tranchen oder Geldmarktpapieren im Rahmen des ABCP-Programms oder eines anderen Instruments, dem eine Internationale Wertpapierkennnummer zugewiesen wurde, und für jedes nachrangige Darlehen im ABCP-Programm;
  - d) jedes Konto in der ABCP-Verbriefung;
  - e) jede Gegenpartei in der ABCP-Verbriefung.

## ABSCHNITT 3

**Gemeinsame Bestimmungen***Artikel 9***Vollständigkeit und Kohärenz der Informationen**

- (1) Die gemäß dieser Verordnung zur Verfügung gestellten Informationen müssen vollständig und kohärent sein.
- (2) Stellt die meldende Stelle fest, dass Informationen, die sie gemäß dieser Verordnung bereitgestellt hat, sachliche Fehler enthalten, so nimmt sie unverzüglich eine korrigierte Meldung aller nach dieser Verordnung erforderlichen Informationen über die Verbriefung vor.

(3) Sofern dies gemäß dem entsprechenden Anhang zulässig ist, kann die meldende Stelle zur Begründung der Nichtverfügbarkeit der bereitzustellenden Informationen einen der folgenden Werte der „No data“-Optionen („ND-Werte“) melden:

- a) „ND1“: Die erforderlichen Informationen wurden nicht erhoben, weil dies aufgrund der Vergabe- oder Zeichnungskriterien zum Zeitpunkt der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition nicht erforderlich war;
- b) „ND2“: Die erforderlichen Informationen wurden zum Zeitpunkt der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition erhoben, zum Datenstichtag aber nicht in das Berichtssystem der meldenden Stelle geladen;
- c) „ND3“: Die erforderlichen Informationen wurden zum Zeitpunkt der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition erhoben, zum Datenstichtag aber in ein vom Meldesystem der meldenden Stelle getrenntes System geladen;
- d) „ND4-YYYY-MM-TT“: Die erforderlichen Informationen wurden erhoben, können aber erst zu einem nach dem Datenstichtag liegenden Datum verfügbar gemacht werden. „YYYY-MM-TT“ dient der Angabe von Jahr, Monat und Tag des in der Zukunft liegenden Datums, zu dem die erforderlichen Informationen bereitgestellt werden;
- e) „ND5“: Die erforderlichen Informationen sind für den Meldeposten nicht relevant.

Die Meldung eines ND-Wertes für die Zwecke dieses Absatzes darf nicht dazu dienen, die Anforderungen dieser Verordnung zu umgehen.

Auf Anfrage der zuständigen Behörden gibt die meldende Stelle detailliert an, aufgrund welcher Umstände diese ND-Werte gemeldet wurden.

#### Artikel 10

##### **Zeitnahe Bereitstellung der Informationen**

- (1) Bei Nicht-ABCP-Verbriefungen muss der Datenstichtag für die Bereitstellung der in dieser Verordnung verlangten Informationen mindestens zwei Kalendermonate vor dem Datum der Datenübermittlung liegen.
- (2) Für ABCP-Verbriefungen gilt Folgendes:
  - a) Der Datenstichtag für die Bereitstellung der in Anhang XI und der in den Abschnitten über Transaktionsdaten der Anhänge XIII und XV spezifizierten Informationen muss mindestens zwei Kalendermonate vor dem Datum der Datenübermittlung liegen;
  - b) der Datenstichtag für die Bereitstellung der in allen anderen Abschnitten der Anhänge XIII und XV außer den Abschnitten über Transaktionsdaten spezifizierten Informationen muss mindestens einen Kalendermonat vor dem Datum der Datenübermittlung liegen.

#### Artikel 11

##### **Eindeutige Kennungen**

- (1) Jeder Verbriefung wird eine eindeutige Kennung zugewiesen, die aus folgenden Elementen in sequentieller Reihenfolge besteht:
  - a) Rechtsträgerkennung der meldenden Stelle;
  - b) Buchstabe „A“ bei ABCP-Verbriefungen bzw. Buchstabe „N“ bei Nicht-ABCP-Verbriefungen;
  - c) vierstellige Jahresangabe für:
    - i) bei Nicht-ABCP-Verbriefungen das Jahr, in dem die ersten Wertpapiere der Verbriefung emittiert wurden;
    - ii) bei ABCP-Verbriefungen das Jahr, in dem die ersten Wertpapiere im Rahmen des ABCP-Programms emittiert wurden;
  - d) Nummer 01 oder — wenn mehr als eine Verbriefung dieselbe Kennung gemäß den Buchstaben a, b und c erhält — eine zweistellige laufende Nummer in der Reihenfolge der Bereitstellung der Informationen über jede Verbriefung. Bei gleichzeitigen Verbriefungen wird die Reihenfolge nach Ermessen festgelegt.

- (2) Jeder ABCP-Transaktion in einem ABCP-Programm wird eine eindeutige Kennung zugewiesen, die aus folgenden Elementen in sequentieller Reihenfolge besteht:
- a) Rechtsträgerkennung der meldenden Stelle;
  - b) Buchstabe „T“;
  - c) vierstellige Jahresangabe für das erste Abschlussdatum der ABCP-Transaktion;
  - d) Nummer 01 oder — wenn mehr als eine ABCP-Transaktion dieselbe Kennung gemäß den Buchstaben a, b und c erhält — eine zweistellige laufende Nummer in der Reihenfolge des ersten Abschlussdatums jeder ABCP-Transaktion. Bei gleichzeitigen ABCP-Transaktionen wird die Reihenfolge nach Ermessen festgelegt.
- (3) Eindeutige Kennungen werden von der meldenden Stelle nicht geändert.

#### Artikel 12

##### **Meldung von Einstufungen**

- (1) Bei Angaben zur Einstufung gemäß dem Europäischen System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen (ESVG) 2010 nach der Verordnung (EU) Nr. 549/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(10)</sup> sind die in Anhang I Tabelle 1 aufgeführten Codes zu verwenden.
- (2) Bei Angaben zur Einstufung gemäß der Servicer-Watchlist sind die in Anhang I Tabelle 2 aufgeführten Codes zu verwenden.

#### Artikel 13

##### **Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 16. Oktober 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean Claude JUNCKER

---

<sup>(10)</sup> Verordnung (EU) Nr. 549/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 21. Mai 2013 zum Europäischen System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen auf nationaler und regionaler Ebene in der Europäischen Union (ABL L 174 vom 26.6.2013, S. 1).

## ANHANG I

Tabelle 1: Codes des Europäischen Systems Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen

Sektoren	Teilsektoren	ESVG-Code
<b>Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften</b>	Öffentliche nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	S.11001
	Inländisch privat kontrollierte nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	S.11002
	Ausländisch kontrollierte nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	S.11003
<b>Monetäre Finanzinstitute (MFI):</b>	Zentralbank	S.121
	Öffentliche Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)	S.12201
	Inländisch privat kontrollierte Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)	S.12202
	Ausländisch kontrollierte Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)	S.12203
	Öffentliche Geldmarktfonds	S.12301
	Inländisch privat kontrollierte Geldmarktfonds	S.12302
	Ausländisch kontrollierte Geldmarktfonds	S.12303
<b>Finanzielle Kapitalgesellschaften (ohne MFI, Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen)</b>	Öffentliche Investmentfonds (ohne Geldmarktfonds)	S.12401
	Inländisch privat kontrollierte Investmentfonds (ohne Geldmarktfonds)	S.12402
	Ausländisch kontrollierte Investmentfonds (ohne Geldmarktfonds)	S.12403
	Öffentliche sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen)	S.12501
	Inländisch privat kontrollierte sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen)	S.12502
	Ausländisch kontrollierte sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen)	S.12503
	Öffentliche Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten	S.12601
	Inländisch privat kontrollierte Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten	S.12602
	Ausländisch kontrollierte Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten	S.12603
	Öffentliche firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber	S.12701
	Inländisch privat kontrollierte firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber	S.12702
	Ausländisch kontrollierte firmeneigene Finanzierungseinrichtungen und Kapitalgeber	S.12703

<b>Versicherungsgesellschaften und Altersvorsorgeeinrichtungen</b>	Öffentliche Versicherungsgesellschaften	S.12801
	Inländisch privat kontrollierte Versicherungsgesellschaften	S.12802
	Ausländisch kontrollierte Versicherungsgesellschaften	S.12803
	Öffentliche Altersvorsorgeeinrichtungen	S.12901
	Inländisch privat kontrollierte Altersvorsorgeeinrichtungen	S.12902
	Ausländisch kontrollierte Altersvorsorgeeinrichtungen	S.12903
<b>Sonstige</b>	Staat	S.13
	Bund (Zentralstaat) (ohne Sozialversicherung)	S.1311
	Länder (ohne Sozialversicherung)	S.1312
	Gemeinden (ohne Sozialversicherung)	S.1313
	Sozialversicherung	S.1314
	Private Haushalte	S.14
	Selbständigenhaushalte (mit und ohne Arbeitnehmer)	S.141 + S.142
	Arbeitnehmerhaushalte	S.143
	Nichterwerbstätigenhaushalte	S.144
	Haushalte von Vermögenseinkommensempfängern	S.1441
	Haushalte von Renten- und Pensionsempfängern	S.1442
	Sonstige Nichterwerbstätigenhaushalte	S.1443
	Private Organisationen ohne Erwerbszweck	S.15
	Mitgliedstaaten der Europäischen Union	S.211
	Organe und Einrichtungen der Europäischen Union	S.212
Drittländer und nicht in der Europäischen Union gebietsfremde internationale Organisationen	S.22	

**Tabelle 2: Codes der Servicer-Watchlist**

<b>Code der Servicer-Watchlist</b>	<b>Bedeutung</b>	<b>Aufnahmeschwelle</b>	<b>Kriterium für die Entfernung von der Liste</b>
1A	In Verzug stehende Kapital- und Zinszahlungen	Zwei Zahlungen im Rückstand	Rückstände ausgeglichen und Kredit bedient. Wird während zwei Quartalen/Perioden weiter auf der Watchlist geführt.

1B	Keine Versicherungserneuerung oder erzwungene Deckung	30 Tage überfällig	Nachweis eines ausreichenden Versicherungsschutzes
1C	Zinsdeckungsquote unterhalb der Dividendenfalle	Zinsdeckungsquote < erforderliche Kreditkennzahlen („Cash-Falle“ oder Ausfallquote); Zinsdeckungsquote < 1,00 auf Ebene der einzelnen Darlehen	Zinsdeckungsquote oberhalb der Schwelle
1D	Schuldendeckungsquote in absoluten Zahlen	Schuldendeckungsquote Ratio < 1,00; Schuldendeckungsquote < 1,20 bei Gesundheitsversorgung und Unterkunft oder auf Ebene der einzelnen Darlehen	Schuldendeckungsquote oberhalb der Schwelle
1E	Schuldendeckungsquote sinkt nach Verbriefungsdatum	Schuldendeckungsquote < 80 % der Schuldendeckungsquote bei Verbriefungsdatum	Schuldendeckungsquote oberhalb der Schwelle Wird während zwei Quartalen/Perioden weiter auf der Watchlist geführt.
1F	Ausfall, Laufzeitende oder Feststellung vorher nicht offengelegter nachrangiger Sicherungsrechte, einschließlich Mezzanine-Darlehen.	Bei Eingang der Meldung beim Servicer	Ausfall behoben oder Genehmigung des nachrangigen Schuldtitels durch den Servicer
1G	Ungeplante Ziehungen auf Akkreditiv, Schuldendienstrücklagen oder Geschäftskapital zur Erfüllung des Schuldendienstes	Jedes solche Ereignis auf Ebene der einzelnen Darlehen	Nach Ersatz der Mittel oder des Akkreditivs, falls in den Unterlagen verlangt, ansonsten nach zwei Zinszahlungsdaten ohne weitere Ziehungen
2A	Bei Abschluss vereinbarte oder dem Servicer auf andere Weise mitgeteilte, zur Frist aber nicht abgeschlossene unbedingt erforderliche Reparaturen	Die erforderlichen Reparaturen werden nicht innerhalb von 60 Tagen nach Fälligkeit (einschließlich vom Servicer genehmigter Verlängerungen) abgeschlossen und es handelt sich um den niedrigeren Betrag von entweder 10 % des ausstehenden Kapitalsaldos oder 250 000 EUR.	Zufriedenstellende Prüfung des Abschlusses der Reparaturen
2B	Mängel bei der Planung erforderlicher Ausgaben (d. h. Investitionsaufwand, FF&E)	Kenntnis von Mängeln mit nachteiligen Auswirkungen auf den Ertrag oder den Wert der Immobilie; auf Ebene der einzelnen Darlehen/Material (> 5 % des ausstehenden Saldos)	Behebung der Mängel
2C	Eintreten eines in den Hypothekenunterlagen beschriebenen Auslöseereignisses (z. B. erforderliche Abzahlung des Kredits, Verbuchung von zusätzlichen Rücklagen, Nichteinhaltung von Mindestschwellen usw.)	Jedes solche Ereignis	Abhilfe für das in den Hypothekenunterlagen definierte Auslöseereignis
2D	Prüfung der Ertragslage. Probleme oder Nichterfüllung bezüglich Mieterlisten, Ergebnisrechnung usw.	Jedes Vorkommen mit Dauer von mindestens sechs Monaten	Abhilfe für das in den Hypothekenunterlagen definierte Auslöseereignis

2E	Ausfall bei Betriebsgenehmigung oder Franchisevereinbarung	Bei Eingang der Meldung beim Servicer	Neue Franchise/Genehmigung oder Behebung des Franchise- oder Lizenzausfalls — Vereinbarung über Beziehungen
2F	Konkurs von Kreditnehmer/Eigentümer/Sponsor oder ähnliches Ereignis (z. B. Insolvenzregelung/-verfahren, Konkurs, Zwangsverwaltung, Liquidation, freiwilliges außergerichtliches Vergleichsverfahren/freiwilliger außergerichtlicher Individualvergleich), Gegenstand einer angeordneten Auflösung oder eines Konkursantrags o. a.	Bei Eingang der Meldung beim Servicer	Wird nach Behebung bis zum nächsten Zinszahlungsdatum weiter auf der Watchlist geführt
3A(i)	Feststellung eines schlechten Zustands bei Inspektion	Jedes solche Ereignis auf Ebene der einzelnen Darlehen/Material 5 % > Nettomieteinkünfte	Mängel der Immobilie nach Ermessen des Servicers behoben oder Zugang ermöglicht und Inspektion abgeschlossen
3A(ii)	Feststellung schwierigen Zugangs bei Inspektion	Jedes solche Ereignis auf Ebene der einzelnen Darlehen/Material 5 % > Nettomieteinkünfte	Mängel der Immobilie nach Ermessen des Servicers behoben oder Zugang ermöglicht und Inspektion abgeschlossen
3B	Feststellung von Umweltproblemen bei Inspektion	Jedes solche Ereignis	Mängel der Immobilie nach Ermessen des Servicers behoben
3C	Von einem schweren Störfall oder Zwangsversteigerungsverfahren betroffene Immobilien mit Auswirkungen auf künftige Zahlungsströme, Wert/Verfall/Kaution.	Bei Feststellung durch den Servicer und Auswirkungen > 10 % des Werts oder 500 000 EUR	Nach Ermessen des Servicers wurden alle erforderlichen Reparaturen zufriedenstellend durchgeführt oder die Enteignungsverfahren erfolgreich abgeschlossen, und der Vermögenswert kann zufriedenstellend rentieren
4A	Rückgang des Nutzungsgrads des Immobilienportfolios insgesamt	20 % weniger als zum Verbriefungsdatum; auf Ebene der einzelnen Darlehen	Wenn dieser Zustand nicht mehr besteht
4B	Innerhalb der nächsten 12 Monate auslaufende Mietverträge eines Mieters oder einer Kombination der DREI WICHTIGSTEN MIETER (gemessen an der Bruttomiete) mit Mietverträgen > 30 %	Gilt nur für Büro-, Industrie- und Privatimmobilien	Wenn dieser Zustand nicht mehr besteht oder nach Ermessen des Servicers
4C	Wichtiger Mietvertrag/wichtige Mietverträge sind ausgefallen, ausgelaufen oder unklar (Räumlichkeiten sind nicht belegt, aber Miete wird gezahlt)	> 30 % der Nettomieteinkünfte	Wenn dieser Zustand nicht mehr besteht oder nach Ermessen des Servicers
5A	Bevorstehendes Laufzeitende	< 180 Tage bis zur Fälligkeit	Kredit ist abbezahlt

**Tabelle 3: Arten von Positionen und Codes**

Art der Position	Artikel der Verordnung (EU) 2017/2402	Positionscode
Zugrunde liegende Risikopositionen oder zugrunde liegenden Forderungen oder Kreditforderungen	7(1)(a)	1
Anlegerbericht	7(1)(e)	2
Endgültige Angebotsunterlage, Prospekt, abschließende Unterlagen der Transaktion, ausgenommen Rechtsgutachten	7(1)(b)(i)	3
Verkaufsvereinbarung über Vermögenswerte, Abtretungs-, Novations- oder Übertragungsvereinbarung und jedwede einschlägige Treuhanderklärung	7(1)(b)(ii)	4
Derivate- und Garantievereinbarungen, alle einschlägigen Dokumente zu Besicherungsvereinbarungen, wenn die verbrieften Risikopositionen Risikopositionen des Originators bleiben	7(1)(b)(iii)	5
Vereinbarungen über Servicing, Backup-Servicing, Verwaltung und Vereinbarungen über Zahlungsströme	7(1)(b)(iv)	6
Treuhandurkunde, Sicherheitenurkunde, Agenturvereinbarung, Vereinbarung mit der kontoführenden Bank, garantierter Beteiligungsvertrag, Vertrag bezüglich der Bedingungen oder der Rahmentreuhandvereinbarung oder Rahmenvereinbarungen zu Definitionen oder andere Rechtsdokumente gleicher Rechtsverbindlichkeit	7(1)(b)(v)	7
Vereinbarungen zwischen Gläubigern, Dokumentation von Derivaten, Vereinbarung zu nachrangigen Darlehen, Kreditverträge mit Start-ups und Liquiditätsfazilitätsverträge	7(1)(b)(vi)	8
sämtliche zugehörige Dokumentation, die zum Verständnis der Transaktion wesentlich ist	7(1)(b)	9
Bei einfachen, transparenten und standardisierten Verbriefungen die STS-Meldung nach Artikel 27 der Verordnung (EG) 2017/2402	7(1)(d)	10
Alle Insiderinformationen im Zusammenhang mit der Verbriefung, zu deren Veröffentlichung Originator, Sponsor oder Verbriefungszweckgesellschaft gemäß Artikel 17 der Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(1)</sup> verpflichtet sind	7(1)(f)	11
Alle wichtigen Ereignisse wie i) eine erhebliche Verletzung der Verpflichtungen aus den gemäß Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Verfügung gestellten Dokumenten sowie jede diesbezügliche Abhilfe, Ausnahme oder nachträglich erteilte Zustimmung; ii) eine Veränderung der strukturellen Merkmale, die die Wertentwicklung der Verbriefung wesentlich beeinflussen kann; iii) eine Veränderung der Risikomerkmale der Verbriefung oder der zugrunde liegenden Risikopositionen, die die Wertentwicklung der Verbriefung wesentlich beeinflussen kann; iv) bei STS-Verbriefungen die Tatsache, dass die Verbriefung die STS-Anforderungen nicht mehr erfüllt oder die zuständigen Behörden Abhilfe- oder Verwaltungsmaßnahmen getroffen haben; v) jede wesentliche Änderung der Unterlagen der Transaktion.	7(1)(g)	12

<sup>(1)</sup> Verordnung (EU) Nr. 596/2014 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 16. April 2014 über Marktmissbrauch (Marktmissbrauchsverordnung) und zur Aufhebung der Richtlinie 2003/6/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und der Richtlinien 2003/124/EG, 2003/125/EG und 2004/72/EG der Kommission (ABl. L 173 vom 12.6.2014, S 1).

## ANHANG II

## ANGABEN ZU ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — WOHNIMMOBILIEN (RRE)

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
RREL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission zugewiesene eindeutige Kennung <sup>(1)</sup> .	NEIN	NEIN
RREL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
RREL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes RREL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in RREL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
RREL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
RREL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes RREL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in RREL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
RREL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
RREL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft (SPV) transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbriefung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
RREL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
RREL9	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA
RREL10	Gebietsansässiger	Ist der Hauptschuldner in dem Land ansässig, in dem die Sicherheit und die zugrunde liegende Risikoposition begeben sind?	JA	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREL11	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN
RREL12	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
RREL13	Beschäftigungsstatus	Beschäftigungsstatus des Hauptschuldners: Beschäftigt — Privatsektor (EMRS) Beschäftigt — öffentlicher Sektor (EMBL) Beschäftigt — Sektor nicht bekannt (EMUK) Arbeitslos (UNEM) Selbständig (SFEM) Keine Beschäftigung, Schuldner ist juristische Person (NOEM) Student (STNT) Rentner (PNNR) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
RREL14	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldner oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und	NEIN	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p> <p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktebewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
RREL15	Kundentyp	<p>Kundentyp bei Originierung:</p> <p>Neuer Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CNEO)</p> <p>Neuer Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CEMO)</p> <p>Neuer Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (CNRO)</p> <p>Bestehender Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (ENEO)</p> <p>Bestehender Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (EEMO)</p> <p>Bestehender Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (ENRO)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
RREL16	Primäreinkommen	<p>Jährliches, für die Zeichnung der zugrunde liegenden Risikoposition zugrunde gelegtes Einkommen des Hauptschuldners zum Zeitpunkt der Originierung. Ist der Hauptschuldner eine juristische Person/ein Unternehmen, so sind die jährlichen Einkünfte dieses Schuldners anzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	NEIN
RREL17	Art des Primäreinkommens	<p>Art des in RREL16 angegebenen Einkommens:</p> <p>Bruttojahreseinkommen (GRAN)</p> <p>Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (NITS)</p>	JA	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (NITX)</p> <p>Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (NITN)</p> <p>Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (ENIS)</p> <p>Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (EITX)</p> <p>Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (EISS)</p> <p>Verfügbares Einkommen (DSPL)</p> <p>Kreditnehmer ist juristische Person (CORP)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>		
RREL18	Währung des Primäreinkommens	Währung, in der das Einkommen bzw. die Einkünfte des Primärschuldners gezahlt werden.	JA	NEIN
RREL19	Überprüfung des Primäreinkommens	<p>Überprüfung des Primäreinkommens:</p> <p>Eigenerklärung ohne weitere Prüfung (SCRT)</p> <p>Eigenerklärung mit Erschwinglichkeitsbestätigung (SCNF)</p> <p>Überprüft (VRFD)</p> <p>Keine Überprüfung des Einkommens oder Schnellprüfung („Fast Track“) (NVRF)</p> <p>Informationen von Kreditauskunfteien oder Scoring (SCRG)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
RREL20	Sekundäreinkommen	<p>Jährliches Einkommen des Sekundärschuldners zum Zeitpunkt der Originierung, das für die Zeichnung der zugrunde liegenden Risikoposition verwendet wird. Ist der Sekundärschuldner eine juristische Person, so sind die jährlichen Einkünfte dieses Schuldners anzugeben. Gibt es bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition mehr als zwei Schuldner, so ist in diesem Feld das kombinierte jährliche Gesamteinkommen aller Schuldner anzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
RREL21	Überprüfung des Sekundäreinkommens	<p>Einkommensüberprüfung des Sekundäreinkommens:</p> <p>Eigenerklärung ohne weitere Prüfung (SCRT)</p> <p>Eigenerklärung mit Erschwinglichkeitsbestätigung (SCNF)</p> <p>Überprüft (VRFD)</p> <p>Keine Überprüfung des Einkommens oder Schnellprüfung („Fast Track“) (NVRF)</p> <p>Informationen von Kreditauskunfteien oder Scoring (SCRG)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	JA
RREL22	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
RREL23	Datum der Originierung	Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREL24	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	NEIN	JA
RREL25	Ursprüngliche Laufzeit	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate) zum Zeitpunkt der Originierung.	JA	JA
RREL26	Originierungskanal	Kanal der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Büro- oder Zweigstellennetz (BRAN) Zentral oder direkt (DRCT) Vermittler (BROK) Internet (WEBI) Verpackung (TPAC) Drittpartei, aber Zeichnung ausschließlich durch Originator (TPTC) Sonstige (OTHR)	JA	JA
RREL27	Zweck	Grund für die Kreditaufnahme des Schuldners: Kauf (PURC) Refinanzierung des Hypothekarkredits (RMRT) Renovierung (RENV) Immobilienverzehr („Equity Release“) (EQRE) Bau (CNST) Schuldenkonsolidierung (DCON) Refinanzierung durch „Equity Release“-Hypothek (RMEQ) Unternehmensfinanzierung (BSFN) Kombinationshypothek (CMRT) Investmenthypothek (IMRT) Recht auf Kauf (RGBY) Staatlich geförderter Kredit (GPSPL) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
RREL28	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
RREL29	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich Gebühren). Auszuweisen ist der Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datum ihrer Originierung und nicht zum Datum des Verkaufs der zugrunde liegenden Risikoposition an die Verbriefungszweckgesellschaft oder zum Datum des Abschlusses der Verbriefung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREL30	Aktueller Kapitalsaldo	<p>Ausstehender Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die durch die Hypothek besichert sind und bei der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen.</p> <p>Der aktuelle Saldo schließt Kapitalrückstände ein. Bei einer Unterbeteiligung ist jedoch der Sparbetrag abzuziehen (d. h. Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition = zugrunde liegende Risikoposition +/- Unterbeteiligung; +/- 0, falls keine Unterbeteiligung).</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
RREL31	Vorrangige Kapitalsalden	<p>Gesamtbetrag der Salden mit höherem Rang als diese zugrunde liegende Risikoposition (einschließlich Salden mit anderen Kreditgebern). Gibt es keine vorrangigen Salden, so ist der Wert 0 einzutragen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
RREL32	Gleichrangige zugrunde liegende Risikopositionen (pari passu)	<p>Gesamtwert der dieser zugrunde liegenden Risikoposition gleichrangigen zugrunde liegenden Risikopositionen gegenüber diesem Schuldner (unabhängig davon, ob sie in diesem Pool enthalten sind oder nicht). Gibt es keine gleichrangigen Salden, so ist der Wert 0 einzutragen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
RREL33	Gesamtkreditlimit	<p>Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit flexiblen Neuziehungsfazilitäten (einschließlich Revolvierungseigenschaften) oder bei nicht vollständigem Abruf des Höchstbetrags der zugrunde liegenden Risikoposition — der maximale Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition, der potenziell ausstehend sein könnte.</p> <p>Dieses Feld ist nur für zugrunde liegende Risikopositionen mit flexiblen oder sonstigen Zeichnungseigenschaften auszufüllen. Dieses Feld dient nicht der Erfassung von Fällen, in denen der Schuldner einen erhöhten Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition neu verhandeln kann, sondern von Fällen, in denen aktuell die vertragliche Möglichkeit besteht, dass der Schuldner dies tut, und der Kreditgeber, die zusätzlichen Mittel zur Verfügung stellen kann.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
RREL34	Kaufpreis	<p>Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.</p>	NEIN	JA
RREL35	Tilgungsart	<p>Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen).</p> <p>Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX)</p>	JA	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX)</p> <p>Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE)</p> <p>Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>		
RREL36	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	NEIN	JA
RREL37	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	<p>Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen</p> <p>Monatlich (MNTH)</p> <p>Vierteljährlich (QUTR)</p> <p>Halbjährlich (SEMI)</p> <p>Jährlich (YEAR)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	JA
RREL38	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	<p>Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen</p> <p>Monatlich (MNTH)</p> <p>Vierteljährlich (QUTR)</p> <p>Halbjährlich (SEMI)</p> <p>Jährlich (YEAR)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	JA
RREL39	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
RREL40	Verhältnis zwischen Schulden und Einkommen	<p>Schulden als ausstehender Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag, einschließlich sämtlicher Beträge, die durch die Hypothek besichert und in der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen.</p> <p>Einkommen als kombiniertes Einkommen, d. h. Summe aus Primär- und Sekundäreinkommen (gemäß den Feldern RRE16 und RRE20) sowie sonstigen Einkünften.</p>	JA	JA
RREL41	Schlussrate	Gesamtbetrag der (verbrieften) Kapitalrückzahlungen zum Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
RREL42	Zinssatzart	<p>Art des Zinssatzes:</p> <p>Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition (bis Ende der Laufzeit) (FLIF)</p>	NEIN	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition, die an einen Index gebunden ist und in Zukunft an einen anderen Index gebunden wird (FINX) Fest verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition (FXRL) Fest mit künftigen regelmäßigen Anpassungen (FXPR) Fester Zinssatz der zugrunde liegenden Risikoposition mit verpflichtender Umstellung auf einen variablen Satz (FLCF) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Untergrenze (FLFL) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Obergrenze (CAPP) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Unter- und Obergrenze (FLCA) Diskontsatz (DISC) Switch-Optionalität (SWIC) Tausch des Schuldners (OBLS) Modular (MODE) Sonstige (OTHR)		
RREL43	Aktueller Zinssatz	Jährlicher Bruttosatz zur Berechnung der für die aktuelle Periode vorgesehenen Zinszahlungen auf die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition. Für einzelne Perioden berechnete Sätze müssen annualisiert werden.	NEIN	JA
RREL44	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA)	NEIN	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
RREL45	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	Laufzeit des aktuellen Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
RREL46	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb (bzw. unterhalb, in diesem Fall Eingabe als negativer Wert) des Indexsatzes.	NEIN	JA
RREL47	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
RREL48	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
RREL49	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREL50	Revisionsmarge 1	Marge für die zugrunde liegende Risikoposition am ersten Revisionsdatum. Dies bezieht sich nur auf vertragliche Änderungen hinsichtlich der Marge (z. B. von +50 auf +100 Basispunkte) oder des zugrunde liegenden Indexes (z. B. von 3M EURIBOR auf 1M EURIBOR), der für die Zinsberechnung herangezogen wird. Dieses Feld bezieht sich nicht auf das Datum, an dem der Index periodisch angepasst wird (z. B. monatliche Zurücksetzung des 1M EURIBOR). In diesem Feld ist die vollständig korrigierte Marge anzugeben, nicht die <i>Änderung</i> der Marge.	JA	JA
RREL51	Zinsrevisionsdatum 1	Datum der nächsten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte zugrunde liegende Risikopositionen usw.; dies ist nicht das nächste LIBOR/EURIBOR/Index-Anpassungsdatum).	JA	JA
RREL52	Revisionsmarge 2	Marge für die zugrunde liegende Risikoposition am zweiten Revisionsdatum. Dies bezieht sich nur auf vertragliche Änderungen hinsichtlich der Marge (z. B. von +50 auf +100 Basispunkte) oder des zugrunde liegenden Indexes (z. B. von 3M EURIBOR auf 1M EURIBOR), der für die Zinsberechnung herangezogen wird. Dieses Feld bezieht sich nicht auf das Datum, an dem der Index periodisch angepasst wird (z. B. monatliche Zurücksetzung des 1M EURIBOR). In diesem Feld ist die vollständig korrigierte Marge anzugeben, nicht die <i>Änderung</i> der Marge.	JA	JA
RREL53	Zinsrevisionsdatum 2	Datum der zweiten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte zugrunde liegende Risikopositionen usw.; dies ist nicht das nächste LIBOR/EURIBOR/Index-Anpassungsdatum).	JA	JA
RREL54	Revisionsmarge 3	Marge für die zugrunde liegende Risikoposition am dritten Revisionsdatum. Dies bezieht sich nur auf vertragliche Änderungen hinsichtlich der Marge (z. B. von +50 auf +100 Basispunkte) oder des zugrunde liegenden Indexes (z. B. von 3M EURIBOR auf 1M EURIBOR), der für die Zinsberechnung herangezogen wird. Dieses Feld bezieht sich nicht auf das Datum, an dem der Index periodisch angepasst wird (z. B. monatliche Zurücksetzung des 1M EURIBOR). In diesem Feld ist die vollständig korrigierte Marge anzugeben, nicht die <i>Änderung</i> der Marge.	JA	JA
RREL55	Zinsrevisionsdatum 3	Datum der dritten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte zugrunde liegende Risikopositionen usw.; dies ist nicht das nächste LIBOR/EURIBOR/Index-Anpassungsdatum).	JA	JA
RREL56	Revidierter Zinsindex	Nächster Zinsindex. MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA)	JA	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
RREL57	Laufzeit des revidierten Zinsindex	Laufzeit des revidierten Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	JA	JA
RREL58	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN
RREL59	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	Prozentualer Anteil der im Rahmen des Produkts zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr. Dies betrifft zugrunde liegende Risikopositionen, die vorzeitige Rückzahlungen bis zu einer bestimmten Schwelle (d. h. 10 %) zulassen, ehe Gebühren anfallen.	JA	JA
RREL60	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegenden Risikoposition erlaubt.	JA	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREL61	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition entrichtet werden. Nicht verbrieftete Beträge sind eingeschlossen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
RREL62	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA
RREL63	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung eingegangen ist.	JA	JA
RREL64	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	Gesamtbetrag der seit Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition eingegangenen vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. außerplanmäßige Kapitalrückzahlungen) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
RREL65	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA
RREL66	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem bei der zugrunde liegenden Risikoposition zum letzten Mal Zahlungsrückstände festgestellt wurden.	JA	JA
RREL67	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
RREL68	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	NEIN	NEIN
RREL69	Kontostatus	Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition: Vertragsgemäß bedient (PERF) Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR)	NEIN	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Umstrukturiert — Rückstände (RARR)</p> <p>Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen</p> <p>Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT)</p> <p>Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR)</p> <p>Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB)</p> <p>Rückstände (ARRE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT)</p> <p>Zurückgezahlt (RDMD)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
RREL70	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	<p>Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)</p>	JA	JA
RREL71	Ausfallbetrag	<p>Bruttogesamtausfallbetrag vor Anwendung von Veräußerungserlösen und -rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
RREL72	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREL73	Zugewiesene Verluste	Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Anwendung der Veräußerungserlöse (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. Berücksichtigung von Rückflüssen und Verwertungsprozess. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
RREL74	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
RREL75	Rechtsstreit	Angabe, ob ein Gerichtsverfahren anhängig ist (wenn das Konto vollständig beglichen wurde und nicht mehr Gegenstand eines Gerichtsverfahren ist, ist die Angabe auf „N“ zurückzusetzen)	NEIN	JA
RREL76	Rückgriff	Besteht über die Erlöse aus Sicherheiten für diese zugrunde liegende Risikoposition hinaus ein (vollständiger oder begrenzter) Rückgriff auf Vermögenswerte des Schuldners?	JA	JA
RREL77	Einlagenbetrag	Summe aller vom Originator oder Verkäufer gehaltenen Schuldnerbeträge, die potenziell vom Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition abgezogen werden können, ohne Beträge unter nationalen Einlegerentschädigungssystemen. Zur Vermeidung einer Doppelzählung ist eine Obergrenze auf den niedrigeren Wert (1) des Einlagenbetrags und (2) des maximalen innerhalb des Pools potenziell in Abzug zu bringenden Betrags auf Ebene des Schuldners (d. h. nicht auf Ebene der zugrunde liegenden Risikoposition) anzuwenden. Angabe in der gleichen Währung wie bei der zugrunde liegenden Risikoposition. Hat ein Schuldner mehr als eine zugrunde liegende Risikoposition im Pool, so ist dieses Feld für jede zugrunde liegende Risikoposition auszufüllen und liegt es im Ermessen der meldenden Stelle, über die Zuweisung des Einlagenbetrags auf die einzelnen zugrunde liegenden Risikopositionen zu entscheiden, wobei die oben genannte Obergrenze zu beachten ist und die Summe der Einträge in diesem Feld für die verschiedenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum korrekten Betrag führen muss. Beispiel: Schuldner A weist einen Einlagensaldo von 100 EUR auf und von zwei ausstehenden zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool beläuft sich die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR. In diesem Feld könnten entweder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 40 EUR oder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 25 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 75 EUR ausgewiesen werden (d. h. die relativen Einträge in diesem Feld sind für die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und für die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR beschränkt und die Summe der Werte für die zugrunde liegende Risikoposition 1 und die zugrunde liegende Risikoposition 2 muss 100 EUR ergeben.	NEIN	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.		
RREL78	Anbieter von Versicherungen oder Vermögensanlagen	Name des Anbieters (d. h. von Lebensversicherungen oder zugrunde liegenden Risikopositionen).	JA	JA
RREL79	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
RREL80	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
RREL81	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA
RREL82	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
RREL83	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
RREL84	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN

## Angaben zu Sicherheiten

RREC1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld RREL1.	NEIN	NEIN
RREC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung für jede zugrunde liegende Risikoposition. Die Angabe muss dem Feld RREL3 entsprechen.	NEIN	NEIN
RREC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die der Sicherheit zugewiesen wurde. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
RREC4	Neue Kennung der Sicherheit	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes RREC2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in RREC2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREC5	Art der Sicherheit	<p>(Wertmäßig) primäre Art von Vermögenswert, durch den die Schuld besichert wird. Ist eine Garantie durch eine Sachsicherheit oder finanzielle Sicherheit unterlegt, Durchschau der Garantie im Hinblick auf jede etwaige Unterlegungssicherheit.</p> <p>Automobil (CARX)  Industriefahrzeug (INDV)  Lkw-Nutzfahrzeug (CMTR)  Schienenfahrzeug (RALV)  Nautisches Nutzfahrzeug (NACM)  Nautisches Freizeitfahrzeug (NALV)  Flugzeug (AERO)  Werkzeugmaschine (MCHT)  Industrierausrüstung (INDE)  Büroausstattung (OFEQ)  IT-Ausrüstung (ITEQ)  Medizinische Ausrüstung (MDEQ)  Energiebezogene Ausrüstung (ENEQ)  Gewerbliches Gebäude (CBLD)  Wohngebäude (RBLD)  Industriegebäude (IBLD)  Sonstiges Fahrzeug (OTHV)  Sonstige Ausrüstung (OTHE)  Sonstige Immobilien (OTRE)  Sonstige Güter oder Bestände (OTGI)  Wertpapiere (SECU)  Garantie (GUAR)  Sonstiger finanzieller Vermögenswert (OTFA)  Gemischte Kategorien — Sicherheiten für alle Vermögenswerte des Schuldners (MIXD)  Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	NEIN
RREC6	Geografische Region — Sicherheit	<p>Geografische Region (NUTS3-Klassifizierung), in der eine Sachsicherheit belegen ist. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.</p>	JA	JA
RREC7	Art der Nutzung	<p>Art der Immobiliennutzung:</p> <p>Eigennutzung, d. h. Eigentum eines privaten Haushalts zum Zweck der Bereitstellung einer Unterkunft für den Eigentümer (FOWN)  Teilweise durch den Eigentümer genutzt (teilweise vermietete Immobilie) (POWN)  Nicht durch den Eigentümer genutzt oder Weitervermietung (TLET)  Urlaubs- oder Zweitwohnsitz (HOLD)</p>	JA	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Sonstige (OTHR) Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.		
RREC8	Sicherungsrechte	Höchstrangige Sicherungsrechte, die der Originator in Bezug auf die Sicherheit hält. Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
RREC9	Immobilienart	Art der Immobilie: Wohnimmobilie (Haus, freistehend oder Doppelhaushälfte) (RHOS) Wohnimmobilie (Wohnung oder Apartment) (RFLT) Wohnimmobilie (Bungalow) (RBGL) Wohnimmobilie (Reihenhaus) (RTHS) Mehrfamilienhaus (Immobilien mit mehr als vier Einheiten zur Besicherung einer zugrunde liegenden Risikoposition) (MULF) Teilweise kommerzielle Nutzung (Immobilie wird sowohl für Wohnzwecke als auch für gewerbliche Zwecke genutzt, wenn weniger als 50 % ihres Werts aus der gewerblichen Nutzung stammen, z. B. Praxis und Wohnhaus eines Hausarztes) (PCMM) Gewerbliche oder berufliche Nutzung (BIZZ) Nur Grundstück (LAND) Sonstige (OTHR) Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	NEIN	JA
RREC10	Energieeffizienzausweis	Ausweis über die Gesamtenergieeffizienz der Sicherheit zum Zeitpunkt der Originierung: A (EPCA) B (EPCB) C (EPCC) D (EPCD) E (EPCE) F (EPCF) G (EPCG) Sonstige (OTHR)	JA	JA
RREC11	Aussteller des Energieeffizienzausweises	Vollständige juristische Bezeichnung des Ausstellers des Energieeffizienzausweises. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
RREC12	Aktuelle Beleihung	Aktuelle Beleihungsquote (LTV). Bei nicht erstrangigen Sicherungsrechten ist dies die kombinierte oder Gesamt-LTV. Bei aktuell negativem Kreditsaldo ist 0 anzugeben. Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
RREC13	Aktueller Bewertungsbetrag	<p>Letzte Bewertung der Sicherheit durch einen unabhängigen externen oder internen Gutachter. Ist eine solche Bewertung nicht verfügbar, kann der aktuelle Wert der Sicherheit anhand eines Immobilienwertindex geschätzt werden, der im Hinblick auf die geografische Lage und die Art der Sicherheit hinreichend granular ist; ist auch ein solcher Immobilienwertindex nicht verfügbar, kann ein Immobilienpreisindex verwendet werden, der im Hinblick auf die geografische Lage und die Art der Sicherheit hinreichend granular ist, nachdem ein geeigneter Abschlag zur Berücksichtigung der Abschreibung auf die Sicherheit vorgenommen wurde.</p> <p>Handelt es sich bei der gemeldeten Sicherheit nicht um eine Immobiliensicherheit, so ist die letzte Bewertung der Sicherheit durch einen unabhängigen externen oder internen Gutachter oder, falls nicht verfügbar, durch den Originator anzugeben.</p> <p>Handelt es sich bei der gemeldeten Sicherheit um eine Garantie, ist der Betrag der durch diese Sicherheit garantierten zugrunde liegenden Risikoposition zugunsten des Originators anzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
RREC14	Aktuelle Bewertungsmethode	<p>Methode zur Berechnung des aktuellen Werts der Sicherheit gemäß Angabe in RREC13:</p> <p>Vollständige, interne und externe Inspektion (FIEI)</p> <p>Vollständige, ausschließlich externe Inspektion (FOEI)</p> <p>Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB)</p> <p>Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM)</p> <p>Indexiert (IDX)</p> <p>Desktop (DKTP)</p> <p>Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA)</p> <p>Steuerbehörde (TXAT)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
RREC15	Aktuelles Bewertungsdatum	Datum der jüngsten Bewertung gemäß Angabe in RREC13.	JA	JA
RREC16	Ursprüngliche Beleihung	<p>Ursprüngliche übernommene Beleihungsquote (LTV) des Originators. Bei nicht erstrangigen Sicherungsrechten ist dies die kombinierte oder Gesamt-LTV.</p> <p>Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.</p>	JA	JA
RREC17	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	<p>Ursprüngliche Bewertung der bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition verwendeten Sicherheit (d. h. vor Verbriefung).</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	NEIN
RREC18	Ursprüngliche Bewertungsmethode	<p>Methode zur Berechnung des Werts der Sicherheit bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition gemäß Angabe in RREC17:</p> <p>Vollständige, interne und externe Inspektion (FIEI)</p> <p>Vollständige, ausschließlich externe Inspektion (FOEI)</p>	JA	NEIN

Feld-Code	Bezeichnung des Feldes	Inhalt der Meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM) Indexiert (IDX) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter/Immobilienmakler (MAEA) Steuerbehörde (TXAT) Sonstige (OTHR)		
RREC19	Ursprüngliches Bewertungsdatum	Datum der ursprünglichen Bewertung der Sicherheit gemäß Angabe in RREC17.	JA	NEIN
RREC20	Verkaufsdatum	Datum des Verkaufs zwangsvollstreckter Sicherheiten.	JA	JA
RREC21	Verkaufspreis	Preis, der bei der Veräußerung von Sicherheiten im Falle einer Zwangsvollstreckung erzielt wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
RREC22	Währung der Sicherheit	Währung, auf die der in RREC13 angegebene Bewertungsbetrag lautet.	NEIN	JA
RREC23	Art des Garantiegebers	Art des Garantiegebers: Kein Garantiegeber (NGUA) Einzelperson — Familie (FAML) Einzelperson — Sonstige (IOTH) Staat (GOVE) Bank (BANK) Versicherungsprodukt (INSU) Nationale Hypothek Garantie Guarantee Scheme (NHGX) Fonds de Garantie de l'Accession Sociale (FGAS) Kautions (CATN) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN

(<sup>1</sup>) DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2020/1224 DER KOMMISSION vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (ABl. L 289 VOM 3.9.2020, S. 1).

## ANHANG III

## ANGABEN ZU ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — GEWERBEIMMOBILIEN (RRE)

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
CREL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
CREL2	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREL3	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CREL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CREL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREL4	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREL5	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CREL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CREL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
CREL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft (SPV) transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbriefung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CREL8	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL9	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
CREL10	Datum der Substitution	Im Falle der Substitution der zugrunde liegenden Risikoposition nach dem Verbriefungsdatum das Datum dieser Substitution.	NEIN	JA
CREL11	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA
CREL12	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN
CREL13	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
CREL14	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
CREL15	Datum der Originierung	Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
CREL16	Tilgungsbeginn	Datum, an dem die Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition beginnt (dies kann ein Datum vor dem Verbriefungsdatum sein)	JA	JA
CREL17	Fälligkeitstermin am Verbriefungsdatum	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition wie in der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition festgelegt. Eventuelle Verlängerungen der Fälligkeit, die gemäß der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zulässig sind, werden hier nicht berücksichtigt.	NEIN	JA
CREL18	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	NEIN	JA
CREL19	Ursprüngliche Laufzeit	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate) zum Zeitpunkt der Originierung.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL20	Dauer der Verlängerungsoption	Dauer jeder Verlängerungsoption, die hinsichtlich der zugrunde liegenden Risikoposition zur Verfügung steht, in Monaten. Stehen für eine Verlängerung der Fälligkeit mehrere Möglichkeiten zur Verfügung, so ist die Dauer der kürzesten Verlängerungsoption für die zugrunde liegende Risikoposition anzugeben.	NEIN	JA
CREL21	Art der Verlängerungsoption	Referenzschwellenwerte für die Möglichkeit der Auslösung/Inanspruchnahme der in Feld CREL20 genannten Verlängerungsoption: Mindestzinsdeckungsquote (MICR) Mindestschuldendeckungsquote (MDSC) Maximale Beleihungsquote (MLTV) Mehrfachbedingungen (MLTC) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL22	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
CREL23	Aktueller Kapitalsaldo	Ausstehender Kapitalsaldo der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die durch die Hypothek besichert sind und bei der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Der aktuelle Saldo schließt Kapitalrückstände ein. Bei einer Unterbeteiligung sind jedoch Sparbeträge abzuziehen. (d. h. Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition = zugrunde liegende Risikoposition +/- Unterbeteiligung; +/- 0, falls keine Unterbeteiligung). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL24	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich Gebühren). Auszuweisen ist der Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datum ihrer Originierung und nicht zum Datum des Verkaufs der zugrunde liegenden Risikoposition an die Verbriefungszweckgesellschaft oder zum Datum des Abschlusses der Verbriefung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CREL25	Ursprünglicher Kapitalsaldo am Verbriefungsdatum	Ursprünglicher Kapitalsaldo der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition am Verbriefungsdatum, wie im Prospekt angegeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL26	Zugesicherter nicht in Anspruch genommener Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition	Verbleibende Fazilität/nicht in Anspruch genommener Saldo der gesamten zugrunde liegenden Risikoposition am Ende der Periode. Verbleibende Fazilität der gesamten zugrunde liegenden Risikoposition nach Zinszahlungsdatum, die der Schuldner noch in Anspruch nehmen kann. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CREL27	Summe der sonstigen offenen Beträge	Kumulierte offene Beträge auf den Kredit (z. B. Versicherungsprämie, Grundstückspacht, Investitionsaufwand), die von der Verbriefungszweckgesellschaft/dem Servicer ausgegeben wurden. Kumulierte Eigentumsschutzvorschüsse oder sonstige Beträge, die vom Servicer oder der Verbriefungszweckgesellschaft vorgestreckt und vom Schuldner noch nicht erstattet wurden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL28	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
CREL29	Datum der letzten Nutzung	Datum der letzten Nutzung/Inanspruchnahme der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition.	NEIN	JA
CREL30	Zweck	Zweck der zugrunde liegenden Risikoposition. Bei mehreren Zwecken Angabe der Option, die die Vereinbarung am besten beschreibt:  Beteiligungserwerb (ACQI) Liquidationserwerb (ACQL) Refinanzierung (RFIN) Bau (CNST) Sanierung (RDVL) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CREL31	Struktur	Struktur der zugrunde liegenden Risikoposition:  Vollständiges Darlehen — nicht in nachrangige Darlehen/Schuldtitel unterteilt (LOAN)  Mehrparteien-Hypotheken einschließlich mindestens einer mit der zugrunde liegenden Risikoposition gleichrangigen Verbindlichkeit, die nicht im Rahmen des Instruments emittiert wurde (PMLP)  Mehrparteien-Hypotheken einschließlich mindestens gegenüber der zugrunde liegenden Risikoposition nachrangigen Verbindlichkeit, die nicht im Rahmen des Instruments emittiert wurde (PMLS)  A-Darlehen als Teil einer A/B-Beteiligungsstruktur (AABP) B-Darlehen als Teil einer A/B-Beteiligungsstruktur (BABP) A-Darlehen als Teil einer A/B/C-Beteiligungsstruktur (AABC) B-Darlehen als Teil einer A/B/C-Beteiligungsstruktur (BABC) C-Darlehen als Teil einer A/B/C-Beteiligungsstruktur (CABC)	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Strukturelle Mezzanine-Finanzierung (MZZD) Nachrangiger Schuldtitel mit gesonderter Darlehensdokumentation außerhalb des Emissionsinstruments (SOBD) Sonstige (OTHR)		
CREL32	A-B-Wasserfall für planmäßige Zinszahlungen vor Vollstreckung	Planmäßige Zinszahlungen vor Vollstreckung nach dem Wasserfallprinzip: Sequentiell (SQNL) B-Darlehen zuerst (BLLF) Pro-Rata (PRAT) Pro-Rata angepasst (MPRT) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL33	A-B-Wasserfall für planmäßige Kapitalrückzahlungen vor Vollstreckung	Planmäßige Kapitalrückzahlungen vor Vollstreckung nach dem Wasserfallprinzip: Sequentiell (SQNL) B-Darlehen zuerst (BLLF) Pro-Rata (PRAT) Pro-Rata angepasst (MPRT) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL34	Zuweisung von Kapitalrückzahlungen für vorrangige Darlehen	Prozentualer Anteil (in %) aller regelmäßigen planmäßigen Kapitalrückzahlungen für vorrangige Darlehen (z. B. A-Darlehen), falls es in der Kreditvereinbarung mehrere Darlehen gibt (z. B. bei Angabe von PMLS, AABP, BABP, AABC, BABC oder CABP in Feld CREL31).	NEIN	JA
CREL35	Art des Wasserfalls	Art des Wasserfalls für die Gesamtkreditvereinbarung: Zinsen A, Kapital A, Zinsen B, Kapital B (IPIP) Zinsen A, Zinsen B, Kapital A, Kapital B (IIPP) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL36	Kaufpreis für ausfallende zugrunde liegende Risikoposition	Wenn der Inhaber des nachrangigen Darlehens (z. B. Inhaber von B-Darlehen) das vorrangige Darlehen bei Ausfall erwerben kann, so ist der Kaufpreis gemäß der anwendbaren Gläubigervereinbarung anzugeben.	NEIN	JA
CREL37	Möglichkeit einer Zahlungsübernahme	Kann der Inhaber des nachrangigen Darlehens (z. B. Inhaber von B-Darlehen) Zahlungen für den Hypothekenschuldner leisten? Auswahl aus folgender Liste: Keine Möglichkeit für Zahlungsübernahme (NCP) Zahlungen über die gesamte Lebensdauer der zugrunde liegenden Risikoposition bis zu einer festen Zahl möglich (FNLP) Zahlungen über die gesamte Lebensdauer der zugrunde liegenden Risikoposition unbegrenzt möglich (NLCP) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL38	Beschränkungen des Verkaufs nachrangiger Darlehen?	Gibt es Beschränkungen hinsichtlich der Möglichkeiten der Inhaber nachrangiger Darlehen (z. B. Inhaber von B-Darlehen), diese an Dritte zu verkaufen?	NEIN	JA
CREL39	Ist der Inhaber eines nachrangigen Darlehens mit dem Schuldner verbunden?	Gibt es Inhaber nachrangiger Darlehen (z. B. Inhaber von B-Darlehen) mit unbestrittenen Ansprüchen, die mit dem gewerblichen Hypothekenschuldner verbunden (d. h. Teil derselben Finanzgruppe) sind?	NEIN	JA
CREL40	Kontrolle des Abwicklungsprozesses durch Inhaber nachrangiger Darlehen?	Kann der Inhaber eines nachrangigen Darlehens (z. B. Inhaber eines B-Darlehens) die Entscheidung zur Realisierung und Veräußerung der Sicherheiten kontrollieren und umsetzen?	NEIN	JA
CREL41	Stellen Nichtzahlungen bei vorrangig gesicherten Forderungen einen Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition dar?	Werden Nichtzahlungen bei vorrangig gesicherten Forderungen als Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition gewertet?	NEIN	JA
CREL42	Stellen Nichtzahlungen bei zugrunde liegenden Risikopositionen gleichen Ranges einen Immobilienausfall dar?	Werden Nichtzahlungen bei zugrunde liegenden Risikopositionen gleichen Ranges als Immobilienausfall gewertet?	NEIN	JA
CREL43	Einwilligung der Investoren	Ist im Falle einer Umstrukturierung die Einwilligung der Investoren notwendig? Umstrukturierungen umfassen Änderungen der Zahlungsbedingungen für verbriefte zugrunde liegende Risikopositionen (einschließlich Zinssatz, Gebühren, Vertragsstrafen, Laufzeit, Rückzahlungsplan und/oder andere allgemein akzeptierte Elemente der Zahlungsbedingungen).	JA	NEIN
CREL44	Nächste Investorenversammlung geplant	An welchem Datum ist die nächste Investorenversammlung geplant?	NEIN	JA
CREL45	Syndizierung	Ist die zugrunde liegende Risikoposition syndiziert?	JA	NEIN
CREL46	Beteiligung der Verbriefungszweckgesellschaft	Erwerb von Eigentum an der syndizierten zugrunde liegenden Risikoposition durch die Verbriefungszweckgesellschaft in Form von: Abtretung (ASGN) Novation (NOVA) Stille Abtretung (EQTB) Finanzierte Beteiligung (pari passu) (PARI) Nachrangige Beteiligung (JUNP) Rechtliche Abtretung (LGAS) Notifizierte Abtretung (NOTA)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Unterbeteiligung (SUBP) Risikobeteiligung (RSKP) Verkaufsveranstaltung (SALE) Sonstige (OTHR)		
CREL47	Folgen bei Nichteinhaltung der Finanzkennzahl	Folgen bei Nichteinhaltung der Finanzkennzahl: Ausfallereignis (EDFT) Zusätzliche Amortisierung (AAMR) Rücklagen für Cash-Falle (CTRS) Beendung des Vertrags mit Immobilienverwalter (TPRM) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL48	Strafen bei Nichtvorlage von Finanzdaten	Gibt es Strafen, wenn der Schuldner es versäumt, die in den Unterlagen der zugrunde liegenden Risikoposition geforderten Finanzdaten (Ergebnisrechnung, Zeitplan usw.) vorzulegen?	JA	NEIN
CREL49	Rückgriff	Besteht über die Erlöse aus Sicherheiten für diese zugrunde liegende Risikoposition hinaus ein (vollständiger oder begrenzter) Rückgriff auf Vermögenswerte des Schuldners?	JA	JA
CREL50	Rückgriff — Dritte	Besteht bei Verstoß des Schuldners gegen eine Verpflichtung aus der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition die Möglichkeit des (vollständigen oder teilweisen) Rückgriffs auf eine andere Partei (z. B. Garantgeber)?	JA	JA
CREL51	Servicing-Standard	Erbringt der Servicer dieser verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition auch die Servicing-Leistung für die gesamte zugrunde liegende Risikoposition oder nur für einen/mehrere Posten der gesamten zugrunde liegenden Risikoposition (z. B. Posten A oder B oder Pari-Passu-Posten)?	NEIN	NEIN
CREL52	Hinterlegte Beträge	Summe der gesetzlich belasteten Rücklagenkonten zum Datentag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL53	Einziehung von Hinterlegungen	Angabe von „Y“, wenn Zahlungen gemäß der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition nur für Zwecke der Deckung von Grundstückspachtzahlungen, Versicherungen oder Steuern (nicht Instandhaltung, Ausbauten, Investitionsaufwand usw.) in Rücklagenkonten gehalten werden.	JA	NEIN
CREL54	Einziehung sonstiger Rücklagen	Werden sonstige Beträge ausgenommen Grundstückspacht, Steuern oder Versicherungen gemäß der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition für Mietausbauten, Vermietungsprovisionen und ähnliche Dinge in Bezug auf die zugehörige Immobilie oder zur Bereitstellung einer zusätzlichen Sicherheit für einen solchen Kredit in Rücklagenkonten gehalten?	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL55	Trigger für Hinterlegung	Art des Trigger-Ereignisses, das zur Zahlung von Hinterlegungen führt: Kein Trigger (NONE) Trigger Beleihungsquote (LVTX) Trigger Zinsdeckungsquote (ICVR) Trigger Schuldendeckungsquote (DSCT) Trigger Nettoergebnis (NOIT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CREL56	Ziel für Hinterlegungsbeträge/Rücklagen	Ziel für Hinterlegungsbeträge/Rücklagen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL57	Freigabebedingungen für Hinterlegungskonto	Freigabebedingungen des Hinterlegungskontos. Im Falle von Mehrfachbedingungen ist jede Bedingung im XML-Schema anzugeben.	NEIN	JA
CREL58	Bedingungen für die Inanspruchnahme der Barreserve	Angabe, wann die Barreserve in Anspruch genommen werden kann: Nichteinhaltung der Finanzkennzahl (FICB) Trigger-Ereignis (TREV) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL59	Währung des Hinterlegungskontos	Währung, auf die das Hinterlegungskonto lautet.	NEIN	JA
CREL60	Währung der hinterlegten Zahlungen	Währung der hinterlegten Zahlungen. Felder CREL52 und CREL56.	NEIN	JA
CREL61	Rücklagengesamtsaldo	Gesamtsaldo der Rücklagenkonten auf Ebene der zugrunde liegenden Risikoposition am Zahlungsdatum, einschließlich Instandhaltung, Reparaturen und Umweltkosten usw. (außer Barrücklagen für Steuern und Versicherung) und LC für Barrücklagen. Auszufüllen, wenn in Feld CREL54 („Einziehung von sonstigen Barrücklagen“) „Y“ = Ja angegeben wird. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL62	Währung des Rücklagenkontos	Währung, auf die das Rücklagenkonto lautet.	NEIN	JA
CREL63	Hinterlegungs-Trigger eingetreten	Angabe von „Y“, wenn ein Ereignis eingetreten ist, das die Bildung von Rücklagen auslöst. Angabe von „N“, wenn Zahlungen als normale Bedingung der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition des Kreditvertrags aufgebaut werden.	NEIN	NEIN
CREL64	Hinterlegte Beträge in aktueller Periode	Betrag, der zwischen dem letzten Datenstichtag und dem Datenstichtag für die Übermittlung dieser Daten zu jeglichen Hinterlegungen oder Rücklagen addiert wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL65	Einnahmen	Summe der Einnahmen aus allen Quellen für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (d. h. Jahresbeginn bis dato oder vorangehende 12 Monate), für alle Immobilien Kann normalisiert werden, wenn dies in der geltenden Servicing-Vereinbarung vorgesehen ist. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CREL66	Betriebskosten am Verbriefungsdatum	Summe der übernommenen Betriebskosten für alle Immobilien wie im Prospekt beschrieben. Diese können Grundsteuern, Versicherung, Verwaltung, Betriebsstoffe, Instandhaltung und Reparaturen sowie unmittelbare Liegenschaftskosten für den Hausbesitzer umfassen; Investitionsaufwand und Vermietungsprovisionen sind ausgeschlossen. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Gesamtbetriebskosten der zugrunde liegenden Immobilien zu addieren. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL67	Investitionsaufwendungen am Verbriefungsdatum	Erwarteter Investitionsaufwand über die gesamte Lebensdauer der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition am Verbriefungsdatum (im Gegensatz zu Reparaturen und Instandhaltung), falls im Prospekt angegeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL68	Währung des Abschlusses	Die in der anfänglichen Finanzberichterstattung in den Feldern CREL65 — CREL66 verwendete Währung.	JA	NEIN
CREL69	Verstoß gegen Berichtspflicht durch Schuldner	Hat der Schuldner gegen seine Berichtspflicht gegenüber dem Servicer oder Kreditgeber der zugrunde liegenden Risikoposition verstoßen? Y = Ja oder N = Nein.	JA	NEIN
CREL70	Methode für die Berechnung der Schuldendeckungsquote	Beschreibung der Berechnung der Finanzkennzahl der Schuldendeckungsquote, abgeleitete Berechnungsmethode. Weicht die Berechnungsmethode für das gesamte Darlehen von der Methode für das A-Darlehen ab, so ist die Methode für das A-Darlehen anzugeben. Aktuelle Periode (CRRP) Projektion — Berechnung für die nächsten sechs Monate (PRSF) Projektion — Berechnung für die nächsten zwölf Monate (PRTF) Kombi 6 — Aktuelle Periode und Berechnung für die nächsten sechs Monate (CMSF) Kombi 12 — Aktuelle Periode und Berechnung für die nächsten sechs Monate (CMTF) Historisch — Berechnung für die nächsten sechs Monate (HISF) Historisch — Berechnung für die nächsten zwölf Monate (HITF) Modifiziert — einschließlich Berechnung einer Rücklageneinzahlung oder Angabe der wahrscheinlichen Mieteinkommensquote in Prozent (MODI) Mehrere Perioden — Berechnung für aufeinanderfolgende Perioden (MLTP) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL71	Indikator der Schuldendeckungsquote am Verbriefungsdatum	<p>Art der Berechnung oder Anwendung der Schuldendeckungsquote bei zugrunde liegenden Risikopositionen aus mehreren Immobilien:</p> <p>Teilweise — Nicht zu allen Immobilien sind Finanzdaten eingegangen, kein Eintrag des Servicers (PRTL)</p> <p>Durchschnittlich — Nicht zu allen Immobilien sind Finanzdaten eingegangen, Servicer verteilt Schuldendienst nur auf Immobilien, zu denen Finanzdaten eingegangen sind (AVER)</p> <p>Vollständig — Für alle Immobilien werden sämtliche Angaben erhoben (FULL)</p> <p>Ungünstigster Fall — Nicht zu allen Immobilien sind Finanzdaten eingegangen, Servicer verteilt Schuldendienst zu 100 % auf Immobilien, zu denen Finanzdaten eingegangen sind (WCAS).</p> <p>Keine Erfassung — Es sind keine Finanzdaten eingegangen (NCOT).</p> <p>Konsolidiert — Finanzdaten zu allen Immobilien in einer einzigen Meldung („roll-up“) vom Schuldner (COND)</p> <p>Gesamtes Darlehen auf Grundlage von Kreditverträgen (WLAG)</p> <p>Gesamtes Darlehen auf anderer Grundlage (WLOT)</p> <p>Schuldversprechen auf Grundlage eines Kreditvertrags (TNAG)</p> <p>Schuldversprechen auf anderer Grundlage (TNOT)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	JA
CREL72	Indikator der aktuellsten Schuldendeckungsquote	<p>Art der Berechnung oder Anwendung der Schuldendeckungsquote bei zugrunde liegenden Risikopositionen aus mehreren Immobilien:</p> <p>Teilweise — Nicht zu allen Immobilien sind Finanzdaten eingegangen, kein Eintrag des Servicers (PRTL)</p> <p>Durchschnittlich — Nicht zu allen Immobilien sind Finanzdaten eingegangen, Servicer verteilt Schuldendienst nur auf Immobilien, zu denen Finanzdaten eingegangen sind (AVER)</p> <p>Vollständig — Für alle Immobilien werden sämtliche Angaben erhoben (FULL)</p> <p>Ungünstigster Fall — Nicht zu allen Immobilien sind Finanzdaten eingegangen, Servicer verteilt Schuldendienst zu 100 % auf Immobilien, zu denen Finanzdaten eingegangen sind (WCAS).</p> <p>Keine Erfassung — Es sind keine Finanzdaten eingegangen (NCOT).</p> <p>Konsolidiert — Finanzdaten zu allen Immobilien in einer einzigen Meldung („roll-up“) vom Schuldner (COND)</p> <p>Gesamtes Darlehen auf Grundlage von Kreditverträgen (WLAG)</p> <p>Gesamtes Darlehen auf anderer Grundlage (WLOT)</p> <p>Schuldversprechen auf Grundlage eines Kreditvertrags (TNAG)</p> <p>Schuldversprechen auf anderer Grundlage (TNOT)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL73	Schuldendeckungsquote am Verbriefungsdatum	Berechnung der Schuldendeckungsquote für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition am Verbriefungsdatum auf der Grundlage der Unterlagen der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
CREL74	Aktuelle Schuldendeckungsquote	Berechnung der aktuellen Schuldendeckungsquote für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition auf der Grundlage der Unterlagen der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
CREL75	Ursprüngliche Beleihungsquote	Beleihungsquote (LTV) für die gesamte Kreditvereinbarung (d. h. nicht nur für den verbrieften Kreditbetrag) am Verbriefungsdatum.	JA	NEIN
CREL76	Aktuelle Beleihungsquote	Aktuelle Beleihungsquote (LTV) für die gesamte Kreditvereinbarung (d. h. nicht nur für den verbrieften Kreditbetrag).	JA	NEIN
CREL77	Zinsdeckungsquote am Verbriefungsdatum	Berechnung der Zinsdeckungsquote für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition am Verbriefungsdatum.	JA	NEIN
CREL78	Aktuelle Zinsdeckungsquote	Berechnung der aktuellen Zinsdeckungsquote für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition.	JA	NEIN
CREL79	Berechnungsmethode für Zinsdeckungsquote	Beschreibung der Berechnung der Finanzkennzahl der Zinsdeckungsquote auf Ebene der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition (oder der gesamten zugrunde liegenden Risikoposition, falls nicht für eine spezifische zugrunde liegende Risikoposition im Rahmen der allgemeinen Kreditvereinbarung spezifiziert); abgeleitete Berechnungsmethode: Aktuelle Periode (CRRP) Projektion — Berechnung für die nächsten sechs Monate (PRSF) Projektion — Berechnung für die nächsten zwölf Monate (PRTF) Kombi 6 — Aktuelle Periode und Berechnung für die nächsten sechs Monate (CMSF) Kombi 12 — Aktuelle Periode und Berechnung für die nächsten sechs Monate (CMTF) Historisch — Berechnung für die nächsten sechs Monate (HISF) Historisch — Berechnung für die nächsten zwölf Monate (HITF) Modifiziert — einschließlich Berechnung einer Rücklageneinzahlung oder Angabe der wahrscheinlichen Mieteinkommensquote in Prozent (MODI) Mehrere Perioden — Berechnung für aufeinanderfolgende Perioden (MLTP) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL80	Anzahl der Immobilien am Verbriefungsdatum	Anzahl der Immobilien, die am Verbriefungsdatum als Sicherheit für die zugrunde liegende Risikoposition dienen.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL81	Anzahl der Immobilien zum Datenstichtag	Anzahl der Immobilien, die als Sicherheit für die zugrunde liegende Risikoposition dienen.	JA	NEIN
CREL82	Immobilien zur Besicherung der zugrunde liegenden Risikoposition	Angabe der eindeutigen Sicherheitenkennungen (CREC4) der Immobilien, die zum Datenstichtag als Sicherheit für die zugrunde liegende Risikoposition dienen. Im Falle mehrerer Immobilien Angabe aller Kennungen im XML-Schema.	NEIN	NEIN
CREL83	Immobilienportfoliowert am Verbriefungsdatum	Bewertung der Immobilien zur Besicherung der zugrunde liegenden Risikoposition am Verbriefungsdatum, wie im Prospekt beschrieben. Im Falle mehrerer Immobilien sind die Werte der Immobilien zu addieren. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL84	Währung der Immobilienportfoliobewertung am Verbriefungsdatum	Währung der in CREL83 angegebenen Bewertung.	NEIN	JA
CREL85	Status der Immobilien	Status der Immobilien. Falls in der nachfolgenden Liste mehrere Situationen zutreffen, Angabe der Situation, die die Gesamtheit der Immobilien am besten beschreibt. Langfristige Vollmacht (LPOA) Zwangsverwaltung (RCVR) Zwangsvollstreckung (FCLS) Eigentümer der Immobilie (REOW) Entschuldung (Defeasence) (DFSD) Teilfreigabe (PRLS) Freigabe (RLSD) Wie bei Verbriefungsdatum (SCDT) In Special Servicing (SSRV) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL86	Bewertungsdatum am Verbriefungsdatum	Datum, an dem die Bewertung für die im Prospekt angegebenen Werte erstellt wurde. Bei mehreren Immobilien und mehreren Daten ist das letzte Datum anzugeben.	NEIN	JA
CREL87	Tilgungsart	Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen). Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX) Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX) Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE) Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CREL88	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL89	Zulässige tilgungsfreie Periode in Tagen	Anzahl der Tage nach Fälligkeitstermin einer Zahlung, während der der Kreditgeber versäumte Zahlungen nicht als Ausfallereignis betrachtet. Dies betrifft Zahlungsver säumnisse aus nichttechnischen Gründen (d. h. versäumte Zahlungen, die nicht z. B. durch Systemausfälle bedingt sind).	NEIN	JA
CREL90	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL91	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL92	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN
CREL93	Beschreibung der Vorfälligkeitsbedingungen	Muss die Angaben im Prospekt widerspiegeln. Wenn die Vorfälligkeitsbedingungen beispielsweise die Zahlung von 1 % Gebühr in Jahr 1, 0,5 % in Jahr 2 und 0,25 % in Jahr 3 des Darlehens vorsehen, kann dies im Prospekt wie folgt angegeben werden: 1 %(12), 0,5 %(24), 0,25 %(36).	JA	JA
CREL94	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegenden Risikoposition erlaubt.	JA	JA
CREL95	Wegfall des Vorfälligkeitsentgelts	Datum, nach dem die zugrunde liegende Risikoposition ohne Vorfälligkeitsentgelt vorzeitig zurückgezahlt werden kann.	NEIN	JA
CREL96	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition entrichtet werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL97	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL98	Außerplanmäßige Kapitaleinzahlungen	Außerplanmäßige Kapitaleinzahlungen in der letzten Einziehungsperiode. Sonstige Kapitaleinzahlungen während der Zinsperiode, die zum Abzahlen der zugrunde liegenden Risikoposition verwendet werden. Dies kann sich auf Veräußerungserlöse, freiwillige vorzeitige Rückzahlungen oder Liquidationsbeträge beziehen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL99	Datum der Liquidation/vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung oder Liquidationserlöse eingegangen sind.	NEIN	JA
CREL100	Code der Liquidation/vorzeitigen Rückzahlung	Code, der eingegangenen außerplanmäßigen Kapitalrückzahlungen oder Liquidationserlösen während der Einziehungsperiode zugewiesen wurde. Teilliquidation (Schuldverminderung) (PTLQ) Auszahlung vor Fälligkeit (PTPY) Liquidation oder Auflösung (LQDP) Rückkauf oder Substitution (RPSB) Volle Auszahlung bei Fälligkeit (FLPY) Diskontierte Auszahlung (DPOX) Auszahlung mit Vertragsstrafe (PYPN) Auszahlung mit Vorfälligkeitsentgelt (YLMT) Schuldverminderung mit Vertragsstrafe (CTPL) Schuldverminderung mit Vorfälligkeitsentgelt (CTYL) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL101	Zinsmehrzahlung/-minderzahlung aufgrund vorzeitiger Rückzahlungen	Zinsmehrzahlung oder -minderzahlung bei der planmäßigen Zinszahlung, die nicht mit einem Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition verbunden ist. Ergebnisse einer vorzeitigen Rückzahlung an einem anderen Datum als einem planmäßigen Fälligkeitstermin: Minderzahlung — negative Differenz zwischen den gezahlten Zinsen und dem planmäßig am Zahlungsdatum für die zugrunde liegende Risikoposition fälligen Zinsbetrag (nur, wenn nach Zahlung etwaiger „Vertragsbruchkosten“ durch den Schuldner ein Fehlbetrag bleibt). Mehrzahlung — Zinsen, die über die im Abgrenzungszeitraum für die zugrunde liegende Risikoposition fälligen aufgelaufenen Zinsen hinaus eingezogen wurden. Eine negative Zahl steht für eine Minderzahlung, eine positive für eine Mehrzahlung. Als Bezug dient die gesamte Kreditvereinbarung (d. h. nicht nur der verbrieft Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL102	Zahlungsdatum	Jüngstes Datum, an dem Kapital und Zinsen an die Verbriefungszweckgesellschaft gezahlt wurden (Stand Datenstichtag). Dies ist in der Regel das Datum der Zinszahlung für die zugrunde liegende Risikoposition.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL103	Nächstes Zahlungsanpassungsdatum	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit variabler Verzinsung Angabe des nächsten Datums, an dem die Höhe der planmäßigen Kapital- oder Zinszahlung angepasst werden soll. Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit fester Verzinsung Angabe des nächsten Zahlungsdatums.	NEIN	JA
CREL104	Nächstes Zahlungsdatum	Datum der nächsten Zahlung für die zugrunde liegende Risikoposition.	NEIN	JA
CREL105	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL106	Ursprünglicher Zinssatz	Gesamtzinssatz der zugrunde liegenden Risikoposition bei Originierung der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
CREL107	Zinssatz am Verbriefungsdatum	Gesamtzinssatz (z. B. EURIBOR und Marge), der zur Berechnung der am ersten Zinszahlungsdatum nach dem Verbriefungsdatum fälligen Zinsen für die zugrunde liegende Risikoposition herangezogen wird.	JA	NEIN
CREL108	Erstes Zahlungsanpassungsdatum	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit variabler Verzinsung Angabe des ersten Datums, an dem die Höhe der planmäßigen Kapital- und/oder Zinszahlung angepasst werden soll. Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit fester Verzinsung Angabe des ersten Datums, an dem die Höhe der planmäßigen Kapital- oder Zinszahlung angepasst werden soll (d. h. nicht des ersten Datums nach der Verbriefung, an dem sie geändert werden könnte).	JA	JA
CREL109	Zinssatzart	Art des Zinssatzes: Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition (bis Ende der Laufzeit) (FLIF) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition, die an einen Index gebunden ist und in Zukunft an einen anderen Index gebunden wird (FINX) Fest verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition (FXRL) Fest verzinslich mit künftigen regelmäßigen Anpassungen (FXPR) Fester Zinssatz der zugrunde liegenden Risikoposition mit verpflichtender Umstellung auf einen variablen Satz (FLCF) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Untergrenze (FLFL) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Obergrenze (CAPP) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Unter- und Obergrenze (FLCA) Diskontsatz (DISC) Switch-Optionalität (SWIC)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Tausch des Schuldners (OBLS) Modular (MODE) Sonstige (OTHR)		
CREL110	Aktueller Zinssatz	Jährlicher Bruttosatz zur Berechnung der für die aktuelle Periode vorgesehenen Zinszahlungen auf die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition. Für einzelne Perioden berechnete Sätze müssen annualisiert werden.	NEIN	JA
CREL111	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL112	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL113	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb (falls unterhalb Eingabe eines negativen Wertes) des Indexsatzes.	NEIN	JA
CREL114	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CREL115	Aktueller Indexsatz	Indexsatz zur Festsetzung des aktuellen Zinssatzes für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition. Zinssatz (vor Marge) zur Berechnung der Zinsen, die zu dem in Feld CREL102 genannten Zahlungsdatum für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition gezahlt wurden.	NEIN	JA
CREL116	Indexfestsetzungsdatum	Angabe des nächsten Indexfestsetzungsdatums, wenn in der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition bestimmte Daten für die Indexfestsetzung vorgesehen sind.	NEIN	JA
CREL117	Rundungsinkrement	Inkrementeller Prozentsatz, um den ein Indexsatz zur Festsetzung des Zinssatzes gemäß der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition gerundet werden sollte.	NEIN	JA
CREL118	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
CREL119	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
CREL120	Aktueller Verzugszins	Zinssatz zur Berechnung der Verzugszinsen, die zu dem in Feld CREL102 genannten Zahlungsdatum für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition gezahlt wurden.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL121	Auflaufen von Zinsen zulässig	Dürfen die Zinsen gemäß den Unterlagen, in denen die Bedingungen der zugrunde liegenden Risikoposition beschrieben sind, auflaufen und kapitalisiert werden?	JA	NEIN
CREL122	Zinsberechnungsmethode	„Tage“-Vereinbarung zur Berechnung der Zinsen: 30/360 (A011) act/365 (A005) act/360 (A004) act/act ICMA (A006) act/act ISDA (A008) act/act AFB (A010) act/366 (A009) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL123	Planmäßige Kapital- und Zinsgesamtfälligkei	Am jüngsten Zahlungsdatum fällige planmäßige Kapital- und Zinszahlung für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CREL124	Planmäßige Kapital- und Zinsgesamtzahlungen	Am jüngsten Zahlungsdatum fällige planmäßige Kapital- und Zinszahlung für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CREL125	Negative Tilgung	Negative Tilgung/aufgeschobene Zinsen/kapitalisierte Zinsen ohne Vertragsstrafe. Eine negative Tilgung liegt vor, wenn die während eines Zahlungszeitraums aufgelaufenen Zinsen höher sind als die planmäßige Zahlung und der überschüssige Betrag zu dem noch ausstehenden Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition hinzuaddiert wird. Als Bezug dient die gesamte Kreditvereinbarung (d. h. nicht nur der verbrieft Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CREL126	Aufgeschobene Zinsen	Aufgeschobene Zinsen auf den gesamten Kredit (d. h. einschließlich des verbrieften Kredits und aller anderen Darlehen, die Teil der Kreditvereinbarung mit dem Schuldner sind). Aufgeschobene Zinsen entsprechen dem Betrag, um den die Zinsen, die ein Schuldner auf einen Hypothekenkredit zahlen muss, geringer sind als der Betrag der aufgelaufenen Zinsen auf den offenen Kapitalsaldo. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CREL127	Gesamtminderezahlung bei offenen Kapital- und Zinsbeträgen	Kumulierte Kapital- und Zinsfälligkeit für die gesamte Kreditvereinbarung (d. h. nicht nur für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL128	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem der Schuldner zuletzt in Rückstand war.	JA	JA
CREL129	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CREL130	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	NEIN	NEIN
CREL131	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)	JA	JA
CREL132	Ausfallbetrag	Bruttogesamtausfallbetrag vor Anwendung von Veräußerungserlösen und -rückflüssen und einschließlich jeglicher kapitalisierter Gebühren/Strafen usw. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL133	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA
CREL134	Nachträgliche Zinszahlung	Werden die bei der zugrunde liegenden Risikoposition anfallenden Zinsen nachträglich gezahlt?	NEIN	NEIN
CREL135	Tatsächliche Verzugszinsen	Tatsächliche Verzugszinsen, die zwischen dem letzten Datenstichtag und dem Datenstichtag für die Übermittlung dieser Daten gezahlt wurden. Summe der Verzugszinsen, die der Schuldner während der Zinsperiode oder am Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition gezahlt hat. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL136	Kontostatus	<p>Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition:</p> <p>Vertragsgemäß bedient (PERF)</p> <p>Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR)</p> <p>Umstrukturiert — Rückstände (RARR)</p> <p>Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen</p> <p>Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT)</p> <p>Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR)</p> <p>Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB)</p> <p>Rückstände (ARRE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT)</p> <p>Zurückgezahlt (RDMD)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>	NEIN	NEIN
CREL137	Zugewiesene Verluste	<p>Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Anwendung der Veräußerungserlöse (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. unter Berücksichtigung von Rückflüssen und Abwicklungsprozess.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
CREL138	Nettoerlöse bei Liquidation	<p>Nettoerlöse bei Liquidation zur Feststellung der der Verbriefungszweckgesellschaft entstandenen Verluste gemäß den Verbriefungsunterlagen. Die Höhe der Nettoerlöse aus Veräußerungen bestimmt, ob es sich um einen Verlust oder eine Minderzahlung für die zugrunde liegende Risikoposition handelt.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL139	Liquidationskosten	Kosten im Zusammenhang mit der Liquidation, die bei den anderen Vermögenswerten des Emittenten saldiert werden, um den Verlust gemäß den Verbriefungsunterlagen festzustellen. Höhe der Liquidationskosten, die aus den Nettoveräußerungserlösen gezahlt werden, um festzustellen, ob Verluste vorliegen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL140	Voraussichtlicher Zeitpunkt von Rückflüssen	Erwartete Rückzahlungsfristen des Servicers der zugrunde liegenden Risikoposition in Monaten.	NEIN	JA
CREL141	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL142	Vollstreckungsbeginn	Datum, an dem ein Zwangsvollstreckungs- oder Vergleichsverfahren oder alternative Vollstreckungsverfahren gegen den Schuldner eingeleitet wurden oder vom Schuldner genehmigt wurden.	NEIN	JA
CREL143	Code der Abwicklungsstrategie	Abwicklungsstrategie: Änderung (MODI) Vollstreckung (ENFR) Zwangsverwaltung (RCVR) Insolvenz (NSOL) Verlängerung (XTSN) Darlehensverkauf (LLES) Diskontierter Auszahlung (DPFF) Immobilieigentum (PPOS) Auflösung (RSLV) Bevorstehende Rückübertragung an Servicer (PRTS) Urkunde statt Zwangsvollstreckung (DLFR) Vollständige Auszahlung (FPOF) Zusicherungen und Gewährleistungen (REWR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL144	Änderung	Art der Änderung: Verlängerung der Fälligkeit (MEXT) Tilgungsänderung (AMMC) Kapitalabschreibung (PWOFF) Befristete Zinssenkung (TMRR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Kapitalisierung der Zinsen (CINT) Kapitalisierung vorgestreckte Kosten (z. B. Versicherung, Grundstückspacht) (CPCA) Kombination (CMRT) Sonstige (OTHR)		
CREL145	Special Servicing-Status	Unterliegt die zugrunde liegende Risikoposition zum Zahlungsdatum einem Special Servicing?	NEIN	NEIN
CREL146	Datum der letzten Übertragung an Special Servicer	Datum, an dem eine zugrunde liegende Risikoposition nach einem entsprechenden Vorfall an den Special Servicer übertragen wurde. Anmerkung: Wurde die zugrunde liegende Risikoposition mehrfach übertragen, ist das Datum anzugeben, an dem die letzte Übertragung an den Special Servicer erfolgt ist.	NEIN	JA
CREL147	Datum der letzten Rückübertragung an Primary Servicer	Datum, an dem eine zugrunde liegende Risikoposition eine „korrigierte Hypothekenposition“ wird; dies entspricht dem Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Special Servicer zurück an den Master/Primary Servicer übertragen wurde. Anmerkung: Bei mehrfacher Rückübertragung der zugrunde liegenden Risikoposition ist das Datum anzugeben, an dem die letzte Rückübertragung an den Master/Primary Servicer erfolgt ist.	NEIN	JA
CREL148	Uneinbringlichkeit festgestellt	Indikator (Ja/Nein), ob der Servicer oder Special Servicer festgestellt hat, dass eventuell geleistete Vorschüsse und der offene Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition sowie sonstige aus der zugrunde liegenden Risikoposition geschuldete Beträge von Erlösen bei Veräußerer oder Liquidation der Immobilie oder der zugrunde liegenden Risikoposition uneinbringlich sind	JA	JA
CREL149	Nichteinhaltung der Finanzkennzahl/Trigger	Art der Nichteinhaltung der Finanzkennzahl oder des entsprechenden Triggers: Zinsdeckungsquote (ICRX) Schuldendeckungsquote (DSCR) Beleihungsquote (LLTV) Zinsdeckungsquote oder Schuldendeckungsquote (ICDS) Zinsdeckungsquote oder Schuldendeckungsquote oder Beleihungsquote (ICDL) Nichteinhaltung auf Immobilienebene (PROP) Nichteinhaltung auf Schuldnerenebene (OBLG) Nichteinhaltung auf Mieter- oder auf Leerstandsebene (TENT) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL150	Datum des Verstoßes	Datum, an dem ein Verstoß gegen die Bedingungen der zugrunde liegenden Risikoposition festgestellt wurde. Im Falle mehrerer Verstöße ist das Datum des frühesten Verstoßes anzugeben.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL151	Datum der Behebung des Verstoßes	Datum, an dem ein in Feld CREL150 gemeldeter Verstoß behoben wurde. Im Falle mehrerer Verstöße ist das Datum des zuletzt behobenen Verstoßes anzugeben.	NEIN	JA
CREL152	Code der Servicer-Watchlist	Wenn die zugrunde liegende Risikoposition in die Servicer-Watchlist aufgenommen wurde, ist der am besten zutreffende Code aus Anhang I Tabelle 2 anzugeben. Wenn mehrere Kriterien anwendbar sind, ist der ungünstigste Code anzugeben.	NEIN	JA
CREL153	Datum der Servicer-Watchlist	Datum, an dem die Aufnahme einer zugrunde liegenden Risikoposition in die Watchlist beschlossen wurde. Wenn eine zugrunde liegende Risikoposition in einer früheren Periode aus der Watchlist entfernt wurde und nun wieder hinzugefügt wird, ist hier das neue Eintragungsdatum anzugeben.	NEIN	JA
CREL154	Zinsswap-Anbieter	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Zinsswap, so ist hier der Zinsswap-Anbieter mit vollständiger juristischer Bezeichnung anzugeben. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
CREL155	Rechtsträgerkennung des Zinsswap-Anbieters	Angabe der Rechtsträgerkennung des Anbieters des Zinsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
CREL156	Fälligkeit des Zinsswaps	Fälligkeitstermin des Zinsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition.	NEIN	JA
CREL157	Nominalbetrag des Zinsswaps	Nominalbetrag des Zinsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL158	Währungsswap-Anbieter	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Devisenswap, so ist hier der Devisenswap-Anbieter mit vollständiger juristischer Bezeichnung anzugeben. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
CREL159	Rechtsträgerkennung des Währungsswap-Anbieters	Angabe der Rechtsträgerkennung des Anbieters des Währungsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
CREL160	Fälligkeit des Währungsswaps	Fälligkeitstermin des Währungsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition.	NEIN	JA
CREL161	Nominalbetrag des Währungsswaps	Nominalbetrag des Währungsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL162	Swap-Wechselkurs	Wechselkurs, der für einen Währungsswap festgelegt wurde.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL163	Anderer Swap-Anbieter	Vollständige juristische Bezeichnung des Anbieters eines Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition, wenn es sich bei dem Swap weder um einen Zins- noch einen Währungsswap handelt. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
CREL164	Rechtsträgerkennung des anderen Swap-Anbieters	Angabe der Rechtsträgerkennung des Anbieters „anderer“ Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
CREL165	Pflicht des Schuldners zur Zahlung von Vertragsauflösungskosten auf Swap	Umfang, bis zu dem der Schuldner Vertragsauflösungskosten an den Anbieter des Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss. Bei mehreren Swaps ist der am besten geeignete Wert anzugeben. Vollentschädigung vom Schuldner (TOTL) Teilentuschädigung vom Schuldner (PINO) Keine Entschädigung vom Schuldner (NOPE)	JA	NEIN
CREL166	Vollständige oder teilweise Kündigung des Swaps für aktuelle Periode	Angabe der Gründe für eine Kündigung des Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition zwischen dem letzten Datenstichtag und dem Datenstichtag für die Übermittlung dieser Daten. Bei mehreren Swaps ist der am besten geeignete Wert anzugeben. Kündigung des Swaps wegen Herabstufung im Rating des Swap-Anbieters (RTDW) Kündigung des Swaps wegen Zahlungsausfall des Swap-Anbieters (PYMD) Kündigung des Swaps wegen anderer Art von Ausfall der Swap-Gegenpartei (CNTD) Kündigung des Swaps wegen vollständiger oder teilweiser vorzeitiger Rückzahlung durch den Schuldner (PRPY) Kündigung des Swaps wegen anderer Art von Ausfall des Schuldners (OBDG) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CREL167	Periodische Nettzahlung des Swap-Anbieters	Nettobetrag der von der Gegenpartei des Swaps für die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition geleisteten Zahlung am Zahlungsdatum gemäß Swap-Vertrag. Dies schließt keine Vertragsauflösungs- oder Kündigungszahlungen ein. Bei mehreren Swaps ist die Summe für sämtliche Swaps anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL168	An den Anbieter des Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition zu zahlende Vertragsauflösungskosten	Höhe der fälligen Zahlung vom Schuldner an die Swap-Gegenpartei im Falle der teilweisen oder vollständigen Kündigung des Swaps. Bei mehreren Swaps ist der am besten geeignete Wert anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL169	Minderzahlung bei Vertragsauflösungskosten auf Swap	Höhe einer eventuellen Minderzahlung von Vertragsauflösungskosten aufgrund der teilweisen oder vollständigen Kündigung des Swaps; gezahlt vom Schuldner. Bei mehreren Swaps ist die Summe für sämtliche Swaps anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREL170	Von der Swap-Gegenpartei zu zahlende Vertragsauflösungskosten	Höhe von eventuellen Gewinnen, die von der Swap-Gegenpartei bei der teilweisen oder vollständigen Kündigung des Swaps an den Schuldner gezahlt werden. Bei mehreren Swaps ist der am besten geeignete Wert anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREL171	Datum der nächsten Anpassung des Swaps	Datum der nächsten Anpassung des Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition. Bei mehreren Swaps ist der am besten geeignete Wert anzugeben.	NEIN	JA
CREL172	Sponsor	Bezeichnung des Sponsors der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CREL173	Rechtsträgerkennung der Korrespondenzbank der Syndizierung	Angabe der Rechtsträgerkennung (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)) der Korrespondenzbank der Syndizierung, d. h. des Instituts, das als Schnittstelle zwischen Schuldner und kreditgebenden Parteien der syndizierten zugrunde liegenden Risikoposition agiert.	NEIN	JA
CREL174	Rechtsträgerkennung des Servicers	Angabe der Rechtsträgerkennung des Servicers der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
CREL175	Name des Servicers	Vollständige juristische Bezeichnung des Servicers der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
CREL176	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
CREL177	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
CREL178	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN
CREL179	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
CREL180	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
CREL181	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
-----------	-----------------------	--------------------	-------------------	---------------

## Angaben zu Sicherheiten

CREC1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld CREL1.	NEIN	NEIN
CREC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Angabe muss der Kennung in Feld CREL5 entsprechen. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die der Sicherheit zugewiesen wurde. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREC4	Neue Kennung der Sicherheit	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CREC3 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CREC3. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CREC5	Art der Sicherheit	(Wertmäßig) primäre Art von Vermögenswert, durch den die Schuld besichert wird. Ist eine Garantie durch eine Sachsicherheit oder finanzielle Sicherheit unterlegt, Durchschau der Garantie im Hinblick auf jede etwaige Unterlegungssicherheit. Automobil (CARX) Industriefahrzeug (INDV) Lkw-Nutzfahrzeug (CMTR) Schienenfahrzeug (RALV) Nautisches Nutzfahrzeug (NACM) Nautisches Freizeitfahrzeug (NALV) Flugzeug (AERO) Werkzeugmaschine (MCHT) Industrierausrüstung (INDE) Büroausstattung (OFEQ) IT-Ausrüstung (ITEQ) Medizinische Ausrüstung (MDEQ) Energiebezogene Ausrüstung (ENEQ) Gewerbliches Gebäude (CBLD) Wohngebäude (RBLD) Industriegebäude (IBLD) Sonstiges Fahrzeug (OTHV) Sonstige Ausrüstung (OTHE) Sonstige Immobilien (OTRE) Sonstige Güter oder Bestände (OTGI) Wertpapiere (SECU) Garantie (GUAR) Sonstiger finanzieller Vermögenswert (OTFA) Gemischte Kategorien — Sicherheiten für alle Vermögenswerte des Schuldners (MIXD) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
CREC6	Name der Immobilie	Name der Immobilie, die als Sicherheit für die zugrunde liegende Risikoposition dient. Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREC7	Adresse der Immobilie	Adresse der Immobilie, die als Sicherheit für die zugrunde liegende Risikoposition dient. Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	NEIN	JA
CREC8	Geografische Region — Sicherheit	Geografische Region (NUTS3-Klassifizierung), in der eine Sachsicherheit belegen ist. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
CREC9	Postleitzahl der Immobilie	Vollständige primäre Postleitzahl der Immobilie. Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	NEIN	JA
CREC10	Sicherungsrechte	Höchstrangige Sicherungsrechte, die der Originator in Bezug auf die Sicherheit hält.	JA	JA
CREC11	Immobilienstatus	Status der Immobilie: Langfristige Vollmacht (LPOA) Zwangsverwaltung (RCVR) Zwangsvollstreckung (FCLS) Eigentümer der Immobilie (REOW) Entschuldung (Defeasence) (DFSD) Teilfreigabe (PRLS) Freigabe (RLSD) Wie bei Verbriefungsdatum (SCDT) In Special Servicing (SSRV) Sonstige (OTHR) Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.	NEIN	JA
CREC12	Immobilienart	Art der Immobilie: Campinganlagen (CRVP) Parkhaus (CARP) Gesundheitswesen (HEAL) Gastgewerbe oder Hotel (HOTL) Industrieimmobilie (IDSR) Nur Grundstück (LAND) Freizeit (LEIS) Mehrfamilienhaus (MULF) Gemischter Verwendungszweck (MIXD) Büro (OFFC) Kneipe (PUBX) Privatimmobilie (RETL)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Selbstlagerung (SSTR)</p> <p>Lagerhalle (WARE)</p> <p>Verschiedene (VARI)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.</p>		
CREC13	Form des Eigentumstitels	<p>Jeweiliger Eigentumstitel der Immobilie. Nur Verpachtung, wobei der Schuldner gewöhnlich ein Gebäude besitzt oder bauen muss, wie im Pachtvertrag angegeben. Inhalt solcher Verträge sind in der Regel langfristige Nettomieten; die Rechte und Pflichten des Schuldners bestehen so lange fort, bis der Mietvertrag ausläuft oder wegen Ausfall gekündigt wird:</p> <p>Pacht (LESH)</p> <p>Eigentum (FREE)</p> <p>Gemischt (MIXD)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Handelt es sich bei den gemeldeten Sicherheiten nicht um Immobiliensicherheiten, so ist ND5 einzutragen.</p>	NEIN	JA
CREC14	Aktuelles Bewertungsdatum	Datum der letzten Bewertung.	JA	JA
CREC15	Aktueller Bewertungsbetrag	<p>Letzte Bewertung der Immobilie durch einen unabhängigen externen oder internen Gutachter. Ist eine solche Bewertung nicht verfügbar, kann der aktuelle Wert anhand eines Immobilienwertindex geschätzt werden, der im Hinblick auf die geografische Lage und die Art der Immobilie hinreichend granular ist. Ist auch ein solcher Immobilienwertindex nicht verfügbar, kann ein Immobilienpreisindex verwendet werden, der im Hinblick auf die geografische Lage und die Art der Immobilie hinreichend granular ist, nachdem ein geeigneter Abschlag zur Berücksichtigung der Abschreibung auf die Immobilie vorgenommen wurde.</p> <p>Handelt es sich bei der gemeldeten Sicherheit nicht um eine Immobiliensicherheit, so ist die letzte Bewertung der Sicherheit durch einen unabhängigen externen oder internen Gutachter oder, falls nicht verfügbar, durch den Originator anzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
CREC16	Aktuelle Bewertungsmethode	<p>Aktuelle Methode zur Berechnung des in Feld CREC15 gemeldeten Werts der Sicherheit.</p> <p>Vollständige, interne und externe Inspektion (FALL)</p> <p>Vollständige, ausschließlich externe Inspektion (FEXT)</p> <p>Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB)</p> <p>Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM)</p> <p>Indexiert (IDXN)</p> <p>Desktop (DKTP)</p> <p>Sachbearbeiter/Immobilienmakler (MAEA)</p> <p>Steuerbehörde (TXAT)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREC17	Aktuelle Bewertungsbasis	Letzte Bewertungsbasis: Offener Markt (OPEN) Leer stehend (VCNT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CREC18	Ursprüngliche Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des Werts der Sicherheit bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Vollständige, interne und externe Inspektion (FALL) Vollständige, ausschließlich externe Inspektion (FEXT) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM) Indexiert (IDX) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter/Immobilienmakler (MAEA) Steuerbehörde (TXAT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CREC19	Verbriefungsdatum	Datum, an dem die Immobilie/Sicherheit zur Besicherung der zugrunde liegenden Risikoposition hinzugefügt wurde. Falls die Immobilie/Sicherheit substituiert wurde, ist das Datum der Substitution anzugeben. Falls die Immobilie/Sicherheit Teil der ursprünglichen Verbriefung war, ist dies das Verbriefungsdatum.	JA	NEIN
CREC20	Zugewiesener Prozentsatz der zugrunde liegenden Risikoposition am Verbriefungsdatum	Anteil der zugrunde liegenden Risikoposition (in %), der der Immobilie/Sicherheit am Verbriefungsdatum zuzurechnen ist, wenn die zugrunde liegende Risikoposition durch mehr als eine Immobilie/Sicherheit besichert wird. Dies kann in der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition festgelegt sein, ansonsten Bestimmung nach Bewertung oder Nettobetriebseinkommen.	JA	JA
CREC21	Aktueller zugewiesener Anteil der zugrunde liegenden Risikoposition	Anteil der zugrunde liegenden Risikoposition (%), der der Sicherheit am Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition zuzurechnen ist. Gibt es mehr als eine Sicherheit zur Besicherung der zugrunde liegenden Risikoposition, muss die Summe aller Anteile 100 % betragen. Dies kann in der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition festgelegt sein, ansonsten Bestimmung nach Bewertung (Nettobetriebseinkommen).	NEIN	JA
CREC22	Bewertung bei Verbriefung	Bewertung der Immobilie/Sicherheit zur Besicherung der zugrunde liegenden Risikoposition am Verbriefungsdatum, wie im Prospekt beschrieben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREC23	Name des Gutachters bei Verbriefung	Name des Sachverständigenbüros, das die Bewertung der Immobilie/Sicherheit am Datum der Verbriefung durchgeführt hat.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREC24	Datum der Bewertung bei Verbriefung	Datum, an dem die Bewertung für die im Prospekt angegebenen Werte erstellt wurde.	NEIN	JA
CREC25	Baujahr	Baujahr der Immobilie gemäß Bewertungsbericht oder Unterlagen der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
CREC26	Jahr der letzten Renovierung	Jahr, in dem die letzte größere Renovierung bzw. der letzte Neubau an der Immobilie fertiggestellt wurde, gemäß Bewertungsbericht oder Unterlagen der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
CREC27	Anzahl der Einheiten	Für eine Immobilie des Typs „Mehrfamilienhaus“ ist die Anzahl der Einheiten, für Gastgewerbe-/Hotel-/Gesundheitsimmobilien die Anzahl der Betten, für Campinganlagen die Anzahl der Einheiten, für Mietwohnungen die Anzahl der Räume und für Selbstlagerzentren die Anzahl der Einheiten anzugeben.	NEIN	JA
CREC28	Nettoquadratmeter	Vermietbare Nettogesamtfläche in Quadratmetern der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, gemäß aktuellem Bewertungsbericht.	NEIN	JA
CREC29	Gewerbliche Fläche	Gewerblich vermietbare Nettogesamtfläche in Quadratmetern der Immobilien, die als Sicherheit für den Kredit dienen, gemäß aktuellem Bewertungsbericht.	NEIN	JA
CREC30	Wohnfläche	Vermietbare Nettogesamtwohnfläche in Quadratmetern der Immobilie, die als Sicherheit für den Kredit dient, gemäß aktuellem Bewertungsbericht	NEIN	JA
CREC31	Validierung der Nettowohnfläche	Hat der Gutachter (der jüngsten Bewertung) die Nettowohnfläche der Immobilie überprüft?	JA	JA
CREC32	Aktueller Stand der Nutzung	Datum der letzten erhaltenen Mieterliste. Bei Gastgewerbe-(Hotels) und Gesundheitsimmobilien Angabe der durchschnittlichen Nutzung für die Periode, für die die Ergebnisse gemeldet werden.	NEIN	JA
CREC33	Wirtschaftlicher Vermietungsgrad bei Verbriefung	Vermietungsgrad mit unterzeichneten Mietverträgen am Verbriefungsdatum, sofern im Prospekt angegeben (Mieter nutzen das Objekt eventuell nicht, zahlen aber Miete).	NEIN	JA
CREC34	Physische Nutzung bei Verbriefung	Verfügbarer Prozentsatz der vermietbaren Fläche, die bei Verbriefung tatsächlich belegt ist, d. h. von Mietern genutzt wird und nicht geräumt ist, sofern im Prospekt offengelegt. Sollte aus einer Mieterliste oder einem anderen Dokument abgeleitet werden, woraus die Nutzung in Übereinstimmung mit den letzten Geschäftsjahresdaten hervorgeht.	NEIN	JA
CREC35	Wert der leer stehenden Immobilie am Verbriefungsdatum	Wert der leer stehenden Immobilie am Verbriefungsdatum. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREC36	Datum der Finanzdaten bei Verbriefung	Enddatum der Finanzdaten für die im Prospekt verwendeten Informationen (z. B. Jahresbeginn bis dato, jährlich, vierteljährlich oder vorangegangene 12 Monate)	JA	JA
CREC37	Nettobetriebsergebnis bei Verbriefung	Einnahmen abzüglich Betriebskosten am Verbriefungsdatum. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CREC38	Letzte Finanzdaten zum Startdatum	Erster Tag der Periode, die durch die letzte verfügbare Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate).	JA	JA
CREC39	Letzte Finanzdaten zum Enddatum	Enddatum der Finanzdaten, die für die letzte Ergebnisrechnung verwendet wurden (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate).	JA	JA
CREC40	Letzte Einnahmen	Summe der Einnahmen für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate), für die betreffende Immobilie. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CREC41	Letzte Betriebskosten	Summe der Betriebskosten für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate), für alle Immobilien. Diese können Grundsteuern, Versicherung, Verwaltung, Betriebsstoffe, Instandhaltung und Reparaturen sowie unmittelbare Liegenschaftskosten für den Hausbesitzer umfassen; Investitionsaufwand und Vermietungsprovisionen sind ausgeschlossen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CREC42	Letzter Investitionsaufwand	Gesamtinvestitionsaufwand (im Gegensatz zu Reparaturen und Instandhaltung) für die Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (z. B. monatlich, vierteljährlich, Jahresbeginn bis dato oder vorangegangene 12 Monate), für die betreffende Immobilie. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CREC43	Zahlbare Grundstückspacht	Ist die Immobilie gemietet, ist die aktuelle Jahresmiete anzugeben, die an den Vermieter zu zahlen ist. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREC44	Gewichtete durchschnittliche Mietdauer	Gewichtete durchschnittliche Mietdauer in Jahren, wobei als Gewicht der letzte verfügbare ausstehende Mietwert zu verwenden ist.	NEIN	JA
CREC45	Ablauf der Grundstückspacht	Angabe des frühesten Datums, an dem der Pachtzins abläuft.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CREC46	Vertragliche Jahresmieteinnahmen	Vertragliche Jahresmieteinnahmen, abgeleitet aus der letzten Mieterliste des Schuldners. Angabe der Wahrung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CREC47	Einnahmen mit Ablauf in 1-12 Monaten	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 1 bis 12 Monaten.	JA	JA
CREC48	Einnahmen mit Ablauf in 13-24 Monaten	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 13 bis 24 Monaten..	JA	JA
CREC49	Einnahmen mit Ablauf in 25-36 Monaten	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 25 bis 36 Monaten.	JA	JA
CREC50	Einnahmen mit Ablauf in 37-48 Monaten	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 37 bis 48 Monaten.	JA	JA
CREC51	Einnahmen mit Ablauf in 49 oder mehr Monaten	Prozentsatz der Einnahmen mit Ablauf in 49 oder mehr Monaten.	JA	JA

## Angaben zum Mieter

CRET1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld CREL1.	NEIN	NEIN
CRET2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Angabe muss der Kennung in Feld CREL5 entsprechen. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht andern.	NEIN	NEIN
CRET3	Kennung der Sicherheit	Eindeutige Kennung der Sicherheit. Dieses Feld muss der Angabe in CREC4 entsprechen, um eine Zuordnung zu ermoglichen.	NEIN	NEIN
CRET4	Kennung des Mieters	Eindeutige Kennung des Mieters. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymitat des Schuldners zu gewahrleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht andern.	NEIN	NEIN
CRET5	Name des Mieters	Name des derzeitigen Mieters. Handelt es sich beim Mieter um eine naturliche Person, so muss hier die gleiche Eingabe erfolgen wie in Feld CRET4.	JA	NEIN
CRET6	NACE-Branchencode	NACE-Branchencode des Mieters gema der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europaischen Parlaments und des Rates. (1)	JA	JA
CRET7	Datum des Mietauslaufs	Datum des Mietauslaufs des derzeitigen Mieters.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRET8	Zahlbare Miete	Jahresmiete, die vom derzeitigen Mieter zu zahlen ist. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRET9	Währung der Miete	Währung, in der die Miete gezahlt wird.	NEIN	JA

(<sup>1</sup>) Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Dezember 2006 zur Aufstellung der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige NACE Revision 2 und zur Änderung der Verordnung (EWG) Nr. 3037/90 des Rates sowie einiger Verordnungen der EG über bestimmte Bereiche der Statistik (ABl. L 393 vom 30.12.2006, S. 1).

## ANHANG IV

## ANGABEN ZU DEN ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — UNTERNEHMEN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
CRPL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
CRPL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CRPL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CRPL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CRPL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CRPL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
CRPL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft (SPV) transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbiefung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CRPL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
CRPL9	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL10	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN
CRPL11	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
CRPL12	Schuldner mit beeinträchtiger Bonität	<p>Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldnern oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers</p> <p>a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn</p> <p>i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und</p> <p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p>	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktbewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
CRPL13	Kundentyp	<p>Kundentyp bei Originierung:</p> <p>Neuer Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CNEO)</p> <p>Neuer Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CEMO)</p> <p>Neuer Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (CNRO)</p> <p>Bestehender Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (ENEO)</p> <p>Bestehender Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (EEMO)</p> <p>Bestehender Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (ENRO)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
CRPL14	NACE-Branchencode	NACE-Branchencode des Schuldners gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006.	JA	JA
CRPL15	Basel III-Segment des Schuldners	<p>Basel III-Segment des Schuldners:</p> <p>Unternehmen (CORP)</p> <p>Als Unternehmen behandelte kleine und mittlere Unternehmen (SMEX)</p> <p>Retail (RETL)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	JA
CRPL16	Unternehmensgröße	<p>Einstufung der Unternehmen nach Größe gemäß dem Anhang der Empfehlung 2003/361/EG der Kommission:</p> <p>Kleinstunternehmen (MICE): Unternehmen, das weniger als 10 Personen beschäftigt und dessen Jahresumsatz bzw. Jahresbilanz 2 Mio. EUR nicht überschreitet.</p> <p>Kleines Unternehmen (SMAE): Unternehmen, das weniger als 50 Personen beschäftigt und dessen Jahresumsatz bzw. Jahresbilanz 10 Mio. EUR nicht übersteigt.</p> <p>Mittleres Unternehmen (MEDE): Unternehmen, das weniger als 250 Personen beschäftigt und das entweder einen Jahresumsatz von höchstens 50 Mio. EUR erzielt bzw. dessen Jahresbilanzsumme sich auf höchstens 43 Mio. EUR beläuft.</p>	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Großes Unternehmen (LARE): Unternehmen, bei dem es sich weder um ein Kleinstunternehmen noch um ein kleines oder mittleres Unternehmen handelt. Natürliche Person (NATP) Sonstige (OTHR)		
CRPL17	Einnahmen	Um Abschläge und Umsatzsteuern bereinigte jährliche Verkaufsmenge des Schuldners gemäß der Empfehlung 2003/361/EG. Entspricht dem Konzept des „Gesamtjahresumsatzes“ im Sinne von Artikel 153 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CRPL18	Gesamtschulden	Gesamte Bruttoverbindlichkeiten des Schuldners, einschließlich der in der zugrunde liegenden Risikoposition enthaltenen Finanzierung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CRPL19	EBITDA	Wiederkehrende Erträge aus dem laufenden Geschäft zuzüglich Zinsen, Steuern, Abschreibung und Amortisierung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CRPL20	Unternehmenswert	Unternehmenswert, d. h. Marktkapitalisierung zuzüglich Schulden, Minderheitsbeteiligungen und Vorzugsaktien, abzüglich sämtlicher Barmittel und Barmitteläquivalente. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CRPL21	Freier Cashflow	Nettoeinkommen zuzüglich unbarer Aufwendungen, Zinsen x (1 – Steuersatz) und langfristiger Investitionen abzüglich Investitionen in Geschäftskapital. Unbare Aufwendungen umfassen Abschreibungen, Amortisation, Aufzehrung, Entschädigungen auf der Grundlage von Beteiligungskapital und die Wertminderung von Vermögenswerten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
CRPL22	Datum der Finanzdaten	Datum der Finanzinformationen (z. B. EBITDA) über den Schuldner dieser zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
CRPL23	Währung des Abschlusses	Meldewährung der Abschlüsse.	JA	NEIN
CRPL24	Art der Schuld	Art der Schuld: Darlehen oder Leasing (LOLE) Garantie (DGAR) Eigenwechsel (PRMS) Gewinnbeteiligungsrechte (PRTR) Überziehung (ODFT)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Kreditbrief (LCRE) Betriebsmittelfazilität (WCFC) Beteiligungen (EQUI) Sonstige (OTHR)		
CRPL25	Verbriefte Forderungen	Forderungen im Zusammenhang mit dieser zugrunde liegenden Risikoposition, die verbrieft wurden: Kapital und Zinsen (PRIN) Nur Kapital (PRPL) Nur Zinsen (INTR) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
CRPL26	Internationale Wertpapierkennnummer	Gegebenenfalls ISIN-Code dieser zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CRPL27	Rang	Rang des Schuldinstruments: Vorrangig (SNDB) Mezzanine-Finanzierung (MZZD) Nachrangig (Junior) (JUND) Nachrangig (Subordinated) (SBOD) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CRPL28	Syndizierung	Ist die zugrunde liegende Risikoposition syndiziert?	JA	NEIN
CRPL29	Fremdfinanzierte Transaktion	Handelt es sich bei der zugrunde liegenden Risikoposition um eine fremdfinanzierte Transaktion im Sinne von <a href="https://www.bankingsupervision.europa.eu/ecb/pub/pdf/ssm.leverage-d_transactions_guidance_201705.en.pdf">https://www.bankingsupervision.europa.eu/ecb/pub/pdf/ssm.leverage-d_transactions_guidance_201705.en.pdf</a> ?	NEIN	NEIN
CRPL30	CLO-Verwaltung	Wird die zugrunde liegende Risikoposition auch vom CLO-Manager verwaltet?	NEIN	JA
CRPL31	Zahlung in Sachleistungen	Zahlungen aus der zugrunde liegenden Risikoposition in Form von Sachleistungen (d. h. Zinszahlungen in Form eines kapitalisierten Kapitalbetrags)?	JA	NEIN
CRPL32	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
CRPL33	Datum der Originierung	Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
CRPL34	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	NEIN	JA
CRPL35	Originierungskanal	Kanal der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Büro- oder Zweigstellennetz (BRAN)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Vermittler (BROK) Internet (WEBI) Sonstige (OTHR)		
CRPL36	Zweck	Zweck der zugrunde liegenden Risikoposition: Überziehung oder Betriebskapital (OVRD) Neue Investitionen in Anlagen und Ausrüstungen (EQPI) Neue Investitionen in Informationstechnologie (INFT) Modernisierung bestehender Anlagen, Ausrüstungen oder Technologien (RFBR) Fusion und Übernahme (MGAQ) Anderer expansiver Zweck (OEXP) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CRPL37	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
CRPL38	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich Gebühren). Auszuweisen ist der Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datum ihrer Originierung und nicht zum Datum des Verkaufs der zugrunde liegenden Risikoposition an die Verbriefungszweckgesellschaft oder zum Datum des Abschlusses der Verbriefung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CRPL39	Aktueller Kapitalsaldo	Ausstehender Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die bei der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL40	Vorrangige Kapitalsalden	Gesamtbetrag der Salden mit höherem Rang als diese zugrunde liegende Risikoposition (einschließlich Salden mit anderen Kreditgebern). Gibt es keine vorrangigen Salden, so ist der Wert 0 einzutragen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CRPL41	Marktwert	Bei durch besicherte Kredite unterlegten Verbriefungen ist der Marktwert der Sicherheit anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL42	Gesamtkreditlimit	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit flexiblen Neuziehungsfazilitäten (einschließlich Revolvierungseigenschaften) oder bei nicht vollständigem Abruf des Höchstbetrags der zugrunde liegenden Risikoposition — der maximale Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition, der potenziell ausstehend sein könnte. Dieses Feld ist nur für zugrunde liegende Risikopositionen mit flexiblen oder sonstigen Zeichnungseigenschaften auszufüllen. Dieses Feld dient nicht der Erfassung von Fällen, in denen der Schuldner einen erhöhten Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition neu verhandeln kann, sondern von Fällen, in denen aktuell die vertragliche Möglichkeit besteht, dass der Schuldner dies tut und der Kreditgeber die zusätzlichen Mittel zur Verfügung stellt. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL43	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
CRPL44	Kündigungstermin	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition die Möglichkeit des Rückverkaufs, so ist das Datum anzugeben, an dem die Option ausgeübt werden kann. Ist das Datum nicht bekannt (z. B. bei amerikanischer Option), so ist der 31. Dezember 2099 anzugeben.	NEIN	JA
CRPL45	Verkaufsoption	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition die Möglichkeit des Rückverkaufs, so ist der Ausübungspreis anzugeben. Bei einem nicht festen Ausübungspreis (z. B. bei Lookback-Option) ist der beste Schätzwert des Ausübungspreises anzugeben (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL46	Tilgungsart	Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen). Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX) Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX) Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE) Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CRPL47	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	JA	JA
CRPL48	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)		
CRPL49	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CRPL50	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL51	Schlussrate	Gesamtbetrag der (verbrieften) Kapitalrückzahlungen zum Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CRPL52	Zinssatzart	Art des Zinssatzes: Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition (bis Ende der Laufzeit) (FLIF) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition, die an einen Index gebunden ist und in Zukunft an einen anderen Index gebunden wird (FINX) Fest verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition (FXRL) Fest verzinslich mit künftigen regelmäßigen Anpassungen (FXPR) Fester Zinssatz der zugrunde liegenden Risikoposition mit verpflichtender Umstellung auf einen variablen Satz (FLCF) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Untergrenze (FLFL) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Obergrenze (CAPP) Variabel verzinsliche zugrunde liegende Risikoposition mit Unter- und Obergrenze (FLCA) Diskontsatz (DISC) Switch-Optionalität (SWIC) Tausch des Schuldners (OBLS) Modular (MODE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL53	Aktueller Zinssatz	Jährlicher Bruttosatz zur Berechnung der für die aktuelle Periode vorgesehenen Zinszahlungen auf die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition. Für einzelne Perioden berechnete Sätze müssen annualisiert werden.	NEIN	JA
CRPL54	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CRPL55	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	Laufzeit des aktuellen Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)		
CRPL56	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb des Indexsatzes (falls unterhalb des Satzes, Eingabe eines negativen Wertes).	NEIN	JA
CRPL57	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CRPL58	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
CRPL59	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
CRPL60	Revisionsmarge 1	Marge für die zugrunde liegende Risikoposition am ersten Revisionsdatum. Dies bezieht sich nur auf vertragliche Änderungen hinsichtlich der Marge (z. B. von +50 auf +100 Basispunkte) oder des für die Zinsberechnung herangezogenen zugrunde liegenden Indexes (z. B. von 3M EURIBOR auf 1M EURIBOR). Dieses Feld bezieht sich nicht auf das Datum, an dem der Index periodisch angepasst wird (z. B. monatliche Zurücksetzung des 1M EURIBOR). In diesem Feld ist die vollständig korrigierte Marge anzugeben, nicht die Änderung der Marge.	JA	JA
CRPL61	Zinsrevisionsdatum 1	Datum der nächsten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte zugrunde liegende Risikopositionen usw. Dies ist nicht das nächste LIBOR/EURIBOR/Index-Anpassungsdatum).	JA	JA
CRPL62	Revisionsmarge 2	Marge für die zugrunde liegende Risikoposition am zweiten Revisionsdatum. Dies bezieht sich nur auf vertragliche Änderungen hinsichtlich der Marge (z. B. von +50 auf +100 Basispunkte) oder des für die Zinsberechnung herangezogenen zugrunde liegenden Indexes (z. B. von 3M EURIBOR auf 1M EURIBOR). Dieses Feld bezieht sich nicht auf das Datum, an dem der Index periodisch angepasst wird (z. B. monatliche Zurücksetzung des 1M EURIBOR).	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		In diesem Feld ist die vollständig korrigierte Marge anzugeben, nicht die <i>Änderung</i> der Marge.		
CRPL63	Zinsrevisionsdatum 2	Datum der zweiten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte zugrunde liegende Risikopositionen usw.; dies ist nicht das nächste LIBOR/EURIBOR/Index-Anpassungsdatum).	JA	JA
CRPL64	Revisionsmarge 3	Marge für die zugrunde liegende Risikoposition am dritten Revisionsdatum. Dies bezieht sich nur auf vertragliche Änderungen hinsichtlich der Marge (z. B. von +50 auf +100 Basispunkte) oder des für die Zinsberechnung herangezogenen zugrunde liegenden Indexes (z. B. von 3M EURIBOR auf 1M EURIBOR). Dieses Feld bezieht sich nicht auf das Datum, an dem der Index periodisch angepasst wird (z. B. monatliche Zurücksetzung des 1M EURIBOR). In diesem Feld ist die vollständig korrigierte Marge anzugeben, nicht die <i>Änderung</i> der Marge.	JA	JA
CRPL65	Zinsrevisionsdatum 3	Datum der dritten Zinssatzänderung (z. B. Änderungen der Diskontierungsmarge, Ende festgelegter Perioden, neu festgelegte zugrunde liegende Risikopositionen usw. Dies ist nicht das nächste LIBOR/EURIBOR/Index-Anpassungsdatum).	JA	JA
CRPL66	Revidierter Zinsindex	Nächster Zinsindex. MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL67	Laufzeit des revidierten Zinsindexes	Laufzeit des revidierten Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	JA	JA
CRPL68	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN
CRPL69	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	Prozentualer Anteil der im Rahmen des Produkts zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr. Dies betrifft zugrunde liegende Risikopositionen, die vorzeitige Rückzahlungen bis zu einer bestimmten Schwelle (d. h. 10 %) zulassen, ehe Gebühren anfallen.	JA	JA
CRPL70	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegenden Risikoposition erlaubt.	JA	JA
CRPL71	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition entrichtet werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL72	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA
CRPL73	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung eingegangen ist.	JA	JA
CRPL74	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	Gesamtbetrag der seit Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition eingegangenen vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. außerplanmäßige Kapitalrückzahlungen) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL75	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA
CRPL76	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem der Schuldner zuletzt in Rückstand war.	JA	JA
CRPL77	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CRPL78	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	NEIN	NEIN
CRPL79	Kontostatus	Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition: Vertragsgemäß bedient (PERF) Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR) Umstrukturiert — Rückstände (RARR) Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT) Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR) Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB) Rückstände (ARRE) Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR) Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF) Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE) Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT) Zurückgezahlt (RDMD) Sonstige (OTHR) Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.		
CRPL80	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	Angabe des Grundes für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)	JA	JA
CRPL81	Ausfallbetrag	Bruttogesamtausfallbetrag vor Veräußerungserlösen und Rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL82	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA
CRPL83	Zugewiesene Verluste	Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Veräußerungserlösen (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. unter Berücksichtigung von Rückflüssen und Abwicklungsprozess. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL84	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL85	Quelle von Rückzahlungen	Die Quelle rückgezahlter Beträge: Liquidation von Sicherheiten (LCOL) Vollstreckung von Garantien (EGAR) Zusätzliche Kredite (ALEN) Barrückzahlungen (CASR) Gemischt (MIXD) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CRPL86	Rückgriff	Besteht über die Erlöse aus Sicherheiten für diese zugrunde liegende Risikoposition hinaus ein (vollständiger oder begrenzter) Rückgriff auf Vermögenswerte des Schuldners?	JA	JA
CRPL87	Einlagenbetrag	Summe aller vom Originator oder Verkäufer gehaltenen Schuldnerbeträge, die potenziell vom Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition abgezogen werden können, ohne Beträge unter nationalen Einlegerentschädigungssystemen. Zur Vermeidung einer Doppelzählung ist eine Obergrenze auf den niedrigeren Wert (1) des Einlagenbetrags und (2) des maximalen innerhalb des Pools potenziell in Abzug zu bringenden Betrags auf Ebene des Schuldners (d. h. nicht auf Ebene der zugrunde liegenden Risikoposition) anzuwenden. Angabe in der gleichen Währung wie bei der zugrunde liegenden Risikoposition. Hat ein Schuldner mehr als eine zugrunde liegende Risikoposition im Pool, so ist dieses Feld für jede zugrunde liegende Risikoposition auszufüllen und liegt es im Ermessen der meldenden Stelle, über die Zuweisung des Einlagenbetrags auf die einzelnen zugrunde liegenden Risikopositionen zu entscheiden, wobei die oben genannte Obergrenze zu beachten ist und die Summe der Einträge in diesem Feld für die verschiedenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum korrekten Betrag führen muss. Beispiel: Schuldner A weist einen Einlagensaldo von 100 EUR auf, und von zwei ausstehenden zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool beläuft sich die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR. In diesem Feld könnten entweder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 40 EUR oder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 25 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 75 EUR ausgewiesen werden (d. h. die relativen Einträge in diesem Feld sind für die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und für die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR beschränkt, und die Summe der Werte für die zugrunde liegende Risikoposition 1 und die zugrunde liegende Risikoposition 2 muss 100 EUR ergeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL88	Nominalbetrag des Zinsswaps	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Zinsswap, so ist hier der Nominalbetrag anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL89	Rechtsträgerkennung des Zinsswap-Anbieters	Angabe der Rechtsträgerkennung des Anbieters des Zinsswaps für die zugrunde liegende Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
CRPL90	Zinsswap-Anbieter	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Zinsswap, so ist hier der Zinsswap-Anbieter mit vollständiger juristischer Bezeichnung anzugeben. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
CRPL91	Fälligkeit des Zinsswaps	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Zinsswap, so ist hier der Fälligkeitstermin des Swaps anzugeben.	NEIN	JA
CRPL92	Nominalbetrag des Währungsswaps	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Währungsswap, so ist hier der Nominalbetrag anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPL93	Rechtsträgerkennung des Währungsswap-Anbieters	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Währungsswap, so ist hier die Rechtsträgerkennung des Anbieters des Swaps (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)) anzugeben.	NEIN	JA
CRPL94	Währungsswap-Anbieter	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Devisenswap, so ist hier der Devisenswap-Anbieter mit vollständiger juristischer Bezeichnung anzugeben. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
CRPL95	Fälligkeit des Währungsswaps	Gibt es für die zugrunde liegende Risikoposition einen Devisenswap, so ist hier der Fälligkeitstermin des Swaps anzugeben.	NEIN	JA
CRPL96	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
CRPL97	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
CRPL98	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA
CRPL99	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
CRPL100	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPL101	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN

## Angaben zu Sicherheiten

CRPC1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld CRPL1.	NEIN	NEIN
CRPC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Angabe muss der Kennung in Feld CRPL3 entsprechen. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die der Sicherheit oder Garantie zugewiesen wurde. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPC4	Neue Kennung der Sicherheit	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CRPC3 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in Feld CRPC3. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CRPC5	Geografische Region — Sicherheit	Geografische Region (NUTS3-Klassifizierung), in der die Sicherheit belegen ist. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
CRPC6	Art der Sicherung	Art der Sicherung: Sicherheit (COLL) Durch weitere Sicherheiten unterlegte Garantie (GCOL) Nicht durch weitere Sicherheiten unterlegte Garantie (GNCO) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
CRPC7	Art der Belastung	Angabe des Sicherungsrechts auf die Sicherheit. Bei Garantien ist in diesem Feld jedes Sicherungsrecht auf Sicherheiten zur Unterlegung dieser Garantie anzugeben. „Keine Belastung, aber unwiderrufliche Vollmacht oder Ähnliches“ beschreibt die Situation, dass der Originator oder ursprüngliche Kreditgeber unwiderruflich und bedingungslos dazu befugt ist, die Sicherheit in Zukunft einseitig zu belasten, ohne dafür die Zustimmung des Schuldners oder Garantiegebers einholen zu müssen: Feste Belastung (FXCH) Variable Belastung (FLCH) Keine Belastung (NOCG) Keine Belastung, aber unwiderrufliche Vollmacht oder Ähnliches (ATRN) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPC8	Sicherungsrechte	Höchstrangige Sicherungsrechte, die der Originator in Bezug auf die Sicherheit hält.	JA	JA
CRPC9	Art der Sicherheit	(Wertmäßig) primäre Art von Vermögenswert, durch den die Schuld besichert wird. Ist eine Garantie durch eine Sachsicherheit oder finanzielle Sicherheit unterlegt, Durchschau der Garantie im Hinblick auf jede etwaige Unterlegungssicherheit. Automobil (CARX) Industriefahrzeug (INDV) Lkw-Nutzfahrzeug (CMTR) Schienenfahrzeug (RALV) Nautisches Nutzfahrzeug (NACM) Nautisches Freizeitfahrzeug (NALV) Flugzeug (AERO) Werkzeugmaschine (MCHT) Industrierausrüstung (INDE) Büroausrüstung (OFEQ) IT-Ausrüstung (ITEQ) Medizinische Ausrüstung (MDEQ) Energiebezogene Ausrüstung (ENEQ) Gewerbliches Gebäude (CBLD) Wohngebäude (RBLD) Industriegebäude (IBLD) Sonstiges Fahrzeug (OTHV) Sonstige Ausrüstung (OTHE) Sonstige Immobilien (OTRE) Sonstige Güter oder Bestände (OTGI) Wertpapiere (SECU) Garantie (GUAR) Sonstiger finanzieller Vermögenswert (OTFA) Gemischte Kategorien — Sicherheiten für alle Vermögenswerte des Schuldners (MIXD) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
CRPC10	Aktueller Bewertungsbetrag	Letzte Bewertung der Sicherheit. Ist eine Garantie durch eine Sachsicherheit oder finanzielle Sicherheit unterlegt, Durchschau der Garantie im Hinblick auf jede Unterlegungssicherheit. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CRPC11	Aktuelle Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des aktuellen Werts der Sicherheit gemäß Angabe in Feld CRPC10: Vollständige Bewertung (FAPR) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM) Indexiert (IDXN) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA) Kaufpreis (PPRI) Haircut (HCUT) Marktbewertung (MTTM) Bewertung des Schuldners (OBLV) Sonstige (OTHR)	JA	JA
CRPC12	Aktuelles Bewertungsdatum	Datum der aktuellsten Bewertung der Sicherheit gemäß Angabe in Feld CRPC10.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CRPC13	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	Ursprüngliche Bewertung der Sicherheit zum Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CRPC14	Ursprüngliche Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des Werts der Sicherheit bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition gemäß Angabe in Feld CRPC13. Vollständige Bewertung (FAPR) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM) Indexiert (IDX) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA) Kaufpreis (PPRI) Haircut (HCUT) Marktbewertung (MTM) Bewertung des Schuldners (OBLV) Sonstige (OTHR)	JA	JA
CRPC15	Ursprüngliches Bewertungsdatum	Datum der ursprünglichen Bewertung der Sachsicherheit oder finanziellen Sicherheit gemäß Angabe in Feld CRPC13.	JA	JA
CRPC16	Verkaufsdatum	Datum des Verkaufs der Sicherheit.	NEIN	JA
CRPC17	Verkaufspreis	Preis, der bei der Veräußerung von Sicherheiten im Falle einer Zwangsvollstreckung erzielt wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CRPC18	Währung der Sicherheit	Währung, auf die der in CRPC10 angegebene Bewertungsbetrag lautet.	NEIN	JA
CRPC19	Land des Garantiegebers	Staat, in dem der Garantiegeber niedergelassen ist.	NEIN	JA
CRPC20	ESVG-Teilsektor des Garantiegebers	ESVG 2010-Klassifizierung des Garantiegebers gemäß der Verordnung (EG) Nr. 549/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates („ESVG 2010“) <sup>(1)</sup> . Dieser Eintrag muss auf der Ebene der Teilsektoren erfolgen. Dabei ist einer der in Tabelle 1 des Anhangs I angegebenen Werte zu verwenden.	NEIN	JA

<sup>(1)</sup> Verordnung (EU) Nr. 549/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 21. Mai 2013 zum Europäischen System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen auf nationaler und regionaler Ebene in der Europäischen Union (ABl. L 174 vom 26.6.2013, S. 1).

## ANHANG V

## ANGABEN ZU DEN ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — KRAFTFAHRZEUGE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
AUTL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
AUTL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
AUTL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes AUTL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in AUTL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
AUTL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
AUTL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes AUTL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in AUTL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
AUTL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
AUTL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbrieftung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
AUTL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
AUTL9	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA
AUTL10	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL11	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
AUTL12	Beschäftigungsstatus	Beschäftigungsstatus des Hauptschuldners: Beschäftigt — Privatsektor (EMRS) Beschäftigt — öffentlicher Sektor (EMBL) Beschäftigt — Sektor nicht bekannt (EMUK) Arbeitslos (UNEM) Selbständig (SFEM) Keine Beschäftigung, Schuldner ist juristische Person (NOEM) Student (STNT) Rentner (PNNR) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
AUTL13	Schuldner mit beeinträchtiger Bonität	Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldner oder Garantiegebern mit beeinträchtiger Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p> <p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktbewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
AUTL14	Rechtsform des Schuldners	Rechtsform des Kunden: Öffentliches Unternehmen (PUBL) Gesellschaft mit beschränkter Haftung (LLCO) Partnerschaft (PNTR) Einzelperson (INDV) Staatliche Stelle (GOVT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
AUTL15	Kudentyp	Kudentyp bei Originierung: Neuer Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CNEO) Neuer Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CEMO) Neuer Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (CNRO) Bestehender Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (ENEO) Bestehender Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (EEMO) Bestehender Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (ENRO) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL16	Primäreinkommen	Jährliches, für die Zeichnung der zugrunde liegenden Risikoposition zugrunde gelegtes Einkommen des Hauptschuldners zum Zeitpunkt der Originierung. Ist der Hauptschuldner eine juristische Person/ein Unternehmen, so sind die jährlichen Einkünfte dieses Schuldners anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL17	Art des Primäreinkommens	Art des in AUTL16 angegebenen Einkommens: Bruttjahreseinkommen (GRAN) Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (NITS) Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (NITX) Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (NITN) Geschätztes Nettjahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (ENIS) Geschätztes Nettjahreseinkommen (ohne Steuern) (EITX) Geschätztes Nettjahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (EISS) Verfügbares Einkommen (DSPL) Kreditnehmer ist juristische Person (CORP) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
AUTL18	Währung des Primäreinkommens	Währung, in der das Einkommen des Primärschuldners gezahlt wird. Ist der Hauptschuldner eine juristische Person/ein Unternehmen, so ist hier die Währung der in Feld AUTL20 gemeldeten Einnahmen anzugeben.	JA	JA
AUTL19	Überprüfung des Primäreinkommens	Überprüfung des Primäreinkommens: Eigenerklärung ohne weitere Prüfung (SCRT) Eigenerklärung mit Erschwinglichkeitsbestätigung (SCNF) Überprüft (VRFD) Keine Überprüfung des Einkommens oder Schnellprüfung („Fast Track“) (NVRF) Informationen von Kreditauskunfteien oder Scoring (SCRG) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
AUTL20	Einnahmen	Um Abschläge und Umsatzsteuern bereinigte jährliche Verkaufsmenge des Schuldners gemäß der Empfehlung 2003/361/EG. Entspricht dem Konzept des „Gesamtjahresumsatzes“ im Sinne von Artikel 153 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL21	Währung des Abschlusses	Meldewährung der Abschlüsse.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL22	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
AUTL23	Art des Produkts	Einstufung des Leasings gemäß den Festlegungen des Leasinggebers: (Persönlicher) Kaufvertrag (PPUR) (Persönlicher) Mietvertrag (PHIR) Mietkauf (HIRP) Leasing-Kauf (LEAP) Finanzierungsleasing (FNLS) Betriebsleasing (OPLS) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
AUTL24	Datum der Originierung	Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
AUTL25	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	NEIN	JA
AUTL26	Ursprüngliche Laufzeit	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate) zum Zeitpunkt der Originierung.	JA	JA
AUTL27	Originierungskanal	Kanal der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Automobilhändler (ADLR) Vermittler (BROK) Direkt (DIRE) Indirekt (IDRT) Sonstige (OTHR)	JA	JA
AUTL28	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
AUTL29	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ausstehender Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition des Schuldners oder diskontierter Leasingsaldo (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Vergabe. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL30	Aktueller Kapitalsaldo	Ausstehender Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition (oder diskontierter Saldo des Leasings) des Schuldners zum Datenstichtag. Dies umfasst sämtliche Beträge, die gegen das Fahrzeug besichert sind. Wenn dem Saldo beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL31	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
AUTL32	Tilgungsart	Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen). Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX) Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX) Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE) Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
AUTL33	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	NEIN	JA
AUTL34	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
AUTL35	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
AUTL36	Zahlungsmethode	Übliche Zahlungsmethode (kann auf der letzten eingegangenen Zahlung basieren): Lastschriftverfahren (CDTX) Dauerauftrag (SORD) Scheck (CHKX) Bar (CASH) Banküberweisung (weder Lastschrift noch Dauerauftrag) (BTRA) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL37	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL38	Schlussrate	Gesamtbetrag der (verbriefen) Kapitalrückzahlungen zum Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL39	Anzahlungsbetrag	Höhe der Anzahlung bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich des Werts von in Zahlung genommenen Fahrzeugen usw.) Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL40	Aktueller Zinssatz	Gesamtbetrag des laufenden Bruttozins- oder Diskontierungszinssatzes für die zugrunde liegende Risikoposition. Für einzelne Perioden berechnete Sätze müssen annualisiert werden.	NEIN	JA
AUTL41	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
AUTL42	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
AUTL43	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb des Indexsatzes (falls unterhalb des Satzes, Eingabe eines negativen Wertes).	NEIN	JA
AUTL44	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
AUTL45	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
AUTL46	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
AUTL47	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL48	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	Prozentualer Anteil der im Rahmen des Produkts zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr. Dies betrifft zugrunde liegende Risikopositionen, die vorzeitige Rückzahlungen bis zu einer bestimmten Schwelle (d. h. 10 %) zulassen, ehe Gebühren anfallen.	JA	JA
AUTL49	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition entrichtet werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL50	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA
AUTL51	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung eingegangen ist.	JA	JA
AUTL52	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	Gesamtbetrag der seit Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition eingegangenen vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. außerplanmäßige Kapitalrückzahlungen) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL53	Hersteller	Markenname des Fahrzeugherstellers z. B. „Skoda“, nicht „Volkswagen“.	JA	NEIN
AUTL54	Modell	Name des Fahrzeugmodells.	JA	NEIN
AUTL55	Jahr der Zulassung	Jahr, in dem das Auto zugelassen wurde.	JA	JA
AUTL56	Neu oder gebraucht	Zustand des Fahrzeugs bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition Neu (NEWX) Gebraucht (USED) Vorfürswagen (DEMO) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
AUTL57	Energieeffizienzausweis	Ausweis über die Gesamtenergieeffizienz der Sicherheit zum Zeitpunkt der Originierung: A (EPCA) B (EPCB) C (EPCC) D (EPCD) E (EPCE)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		F (EPCF) G (EPCG) Sonstige (OTHR)		
AUTL58	Aussteller des Energieeffizienzausweises	Vollständige juristische Bezeichnung des Ausstellers des Energieeffizienzausweises. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
AUTL59	Ursprüngliche Beleihungsquote	Verhältnis zwischen dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition bei Originierung und dem Fahrzeugwert bei Originierung.	JA	NEIN
AUTL60	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	Listenpreis des Fahrzeugs zum Datum der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition. Bei Fahrzeugen, die nicht neu sind, Angabe von Handelswert oder Verkaufspreis des Fahrzeugs. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
AUTL61	Ursprünglicher Restwert des Fahrzeugs	Geschätzter Restwert des Vermögenswerts am Datum der Leasingvergabe. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL62	Preis bei Kaufoption	Betrag, den der Schuldner am Leasingende oder bei Ende der zugrunde liegenden Risikoposition zahlen muss, um Eigentümer des Fahrzeugs zu werden, wenn dieser Betrag von dem in Feld AUTL63 angegebenen Betrag abweicht. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL63	Verbriefter Restwert	Restwert, der lediglich verbrieft wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL64	Aktualisierter Restwert des Fahrzeugs	Wenn der Restwert verbrieft wurde, ist der letzte geschätzte Restwert des Fahrzeugs bei Vertragsende anzugeben. Falls keine Aktualisierung erfolgt ist, ist der ursprünglich geschätzte Restwert anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL65	Datum der aktualisierten Restwertbestimmung des Fahrzeugs	Falls der Restwert verbrieft wurde, ist das Datum anzugeben, an dem die letzte aktualisierte Berechnung des Restwerts des Fahrzeugs vorgenommen wurde. Falls keine Aktualisierung erfolgt ist, ist das Datum der ursprünglichen Bewertung anzugeben.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL66	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA
AUTL67	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem der Schuldner zuletzt in Rückstand war.	JA	JA
AUTL68	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
AUTL69	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	NEIN	NEIN
AUTL70	Kontostatus	Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition: Vertragsgemäß bedient (PERF) Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR) Umstrukturiert — Rückstände (RARR) Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT) Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR) Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB) Rückstände (ARRE) Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR) Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF) Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE) Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT) Zurückgezahlt (RDMD) Sonstige (OTHR) Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.		
AUTL71	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)	JA	JA
AUTL72	Ausfallbetrag	Bruttogesamtausfallbetrag vor Veräußerungserlösen und Rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL73	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA
AUTL74	Zugewiesene Verluste	Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Veräußerungserlösen (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. unter Berücksichtigung von Rückflüssen und Abwicklungsprozess. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL75	Restwertverluste	Restwertverlust bei Rückgabe des Fahrzeugs. Falls der Restwert nicht verbrieft wurde, ist hier ND5 einzutragen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
AUTL76	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.		
AUTL77	Verkaufspreis	Preis, der bei Verkauf des Fahrzeugs im Falle einer Zwangsvollstreckung erzielt wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL78	Einlagenbetrag	Summe aller vom Originator oder Verkäufer gehaltenen Schuldnerbeträge, die potenziell vom Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition abgezogen werden können, ohne Beträge unter nationalen Einlegerentschädigungssystemen. Zur Vermeidung einer Doppelzählung ist eine Obergrenze auf den niedrigeren Wert (1) des Einlagenbetrags und (2) des maximalen innerhalb des Pools potenziell in Abzug zu bringenden Betrags auf Ebene des Schuldners (d. h. nicht auf Ebene der zugrunde liegenden Risikoposition) anzuwenden. Angabe in der gleichen Währung wie bei der zugrunde liegenden Risikoposition. Hat ein Schuldner mehr als eine zugrunde liegende Risikoposition im Pool, so ist dieses Feld für jede zugrunde liegende Risikoposition auszufüllen und liegt es im Ermessen der meldenden Stelle, über die Zuweisung des Einlagenbetrags auf die einzelnen zugrunde liegenden Risikopositionen zu entscheiden, wobei die oben genannte Obergrenze zu beachten ist und die Summe der Einträge in diesem Feld für die verschiedenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum korrekten Betrag führen muss. Beispiel: Schuldner A weist einen Einlagensaldo von 100 EUR auf, und von zwei ausstehenden zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool beläuft sich die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR. In diesem Feld könnten entweder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 40 EUR oder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 25 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 75 EUR ausgewiesen werden (d. h. die relativen Einträge in diesem Feld sind für die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und für die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR beschränkt, und die Summe der Werte für die zugrunde liegende Risikoposition 1 und die zugrunde liegende Risikoposition 2 muss 100 EUR ergeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
AUTL79	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
AUTL80	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
AUTL81	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
AUTL82	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
AUTL83	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
AUTL84	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN

## ANHANG VI

## ANGABEN ZU DEN ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — VERBRAUCHER

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
CMRL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
CMRL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CMRL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CMRL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CMRL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CMRL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CMRL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CMRL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CMRL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CMRL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
CMRL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbiefung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CMRL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
CMRL9	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA
CMRL10	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CMRL11	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
CMRL12	Beschäftigungsstatus	Beschäftigungsstatus des Hauptschuldners: Beschäftigt — Privatsektor (EMRS) Beschäftigt — öffentlicher Sektor (EMBL) Beschäftigt — Sektor nicht bekannt (EMUK) Arbeitslos (UNEM) Selbständig (SFEM) Keine Beschäftigung, Schuldner ist juristische Person (NOEM) Student (STNT) Rentner (PNNR) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CMRL13	Schuldner mit beeinträchtiger Bonität	Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldner oder Garantiegebern mit beeinträchtiger Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p> <p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktbewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
CMRL14	Kundentyp	<p>Kundentyp bei Originierung:</p> <p>Neuer Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CNEO)</p> <p>Neuer Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CEMO)</p> <p>Neuer Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (CNRO)</p> <p>Bestehender Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (ENEO)</p> <p>Bestehender Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (EEMO)</p> <p>Bestehender Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (ENRO)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
CMRL15	Primäreinkommen	<p>Jährliches, für die Zeichnung der zugrunde liegenden Risikoposition zugrunde gelegtes Einkommen des Hauptschuldners zum Zeitpunkt der Originierung. Ist der Hauptschuldner eine juristische Person/ein Unternehmen, so sind die jährlichen Einkünfte dieses Schuldners anzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	NEIN
CMRL16	Art des Primäreinkommens	<p>Art des in CMRL15 angegebenen Einkommens:</p> <p>Bruttojahreseinkommen (GRAN)</p> <p>Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (NITS)</p>	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (NITX) Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (NITN) Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (ENIS) Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (EITX) Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (EISS) Verfügbares Einkommen (DSPL) Kreditnehmer ist juristische Person (CORP) Sonstige (OTHR)		
CMRL17	Währung des Primäreinkommens	Währung, in der das Einkommen bzw. die Einkünfte des Schuldners gezahlt werden.	JA	NEIN
CMRL18	Überprüfung des Primäreinkommens	Überprüfung des Primäreinkommens: Eigenerklärung ohne weitere Prüfung (SCRT) Eigenerklärung mit Erschwinglichkeitsbestätigung (SCNF) Überprüft (VRFD) Keine Überprüfung des Einkommens oder Schnellprüfung („Fast Track“) (NVRF) Informationen von Kreditauskunfteien oder Scoring (SCRG) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CMRL19	Durch Lohn-/Pensionsabtretung besichert	Fällt die persönliche zugrunde liegende Risikoposition unter die Kategorie der pensions-/lohnbesicherten zugrunde liegenden Risikopositionen (d. h. cessione del quinto)?	JA	NEIN
CMRL20	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
CMRL21	Datum der Originierung	Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	NEIN
CMRL22	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	NEIN	JA
CMRL23	Ursprüngliche Laufzeit	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate) zum Zeitpunkt der Originierung.	JA	JA
CMRL24	Originierungskanal	Originierungskanal: Internet (WEBI) Zweigstelle (BRCH) Telefonverkauf (TSL) Stand (STND) Post (POST) „White-Label“ (WLBL)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Magazin (MGZN) Automobilhändler (ADLR) Sonstige (OTHR)		
CMRL25	Zweck	Zweck des Kredits: Ausbildung (TUIT) Lebenshaltungskosten (LEXP) Medizinische Versorgung (MDCL) Verbesserung des Wohnraums (HIMP) Gerät oder Möbel (APFR) Reise (TRVL) Schuldenkonsolidierung (DCON) Neues Fahrzeug (NCAR) Gebrauchtes Fahrzeug (UCAR) Sonstiges Fahrzeug (OTHV) Ausrüstung (EQU) Immobilie (PROP) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CMRL26	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
CMRL27	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Kapitalsaldo der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Originierung. Auszuweisen ist der Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datum ihrer Originierung und nicht zum Datum des Verkaufs der zugrunde liegenden Risikoposition an die Verbriefungszweckgesellschaft oder zum Datum des Abschlusses der Verbriefung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CMRL28	Aktueller Kapitalsaldo	Ausstehender Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die bei der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CMRL29	Gesamtkreditlimit	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit flexiblen Neuziehungsfazilitäten (einschließlich Revolvierungseigenschaften) oder bei nicht vollständigem Abruf des Höchstbetrags der zugrunde liegenden Risikoposition — der maximale Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition, der potenziell ausstehend sein könnte.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Dieses Feld ist nur für zugrunde liegende Risikopositionen mit flexiblen oder sonstigen Zeichnungseigenschaften auszufüllen. Dieses Feld dient nicht der Erfassung von Fällen, in denen der Schuldner einen erhöhten Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition neu verhandeln kann, sondern von Fällen, in denen aktuell die vertragliche Möglichkeit besteht, dass der Schuldner dies tut und der Kreditgeber die zusätzlichen Mittel zur Verfügung stellt. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.		
CMRL30	Revolvierendes Enddatum	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit flexiblen Neuzeichnungs-/Revolvierungseigenschaften Angabe des Datums, an dem die flexiblen Eigenschaften voraussichtlich auslaufen, d. h. wann die revolvierende Periode endet	NEIN	JA
CMRL31	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
CMRL32	Tilgungsart	Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen). Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX) Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX) Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE) Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CMRL33	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	NEIN	JA
CMRL34	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CMRL35	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CMRL36	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CMRL37	Aktueller Zinssatz	Jährlicher Bruttosatz zur Berechnung der für die aktuelle Periode vorgesehenen Zinszahlungen auf die verbrieft zugrunde liegende Risikoposition. Für einzelne Perioden berechnete Sätze müssen annualisiert werden.	NEIN	JA
CMRL38	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CMRL39	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	Laufzeit des aktuellen Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CMRL40	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb des Indexsatzes (falls unterhalb des Satzes, Eingabe eines negativen Wertes).	NEIN	JA
CMRL41	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CMRL42	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
CMRL43	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
CMRL44	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN
CMRL45	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	Prozentualer Anteil der im Rahmen des Produkts zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr. Dies betrifft zugrunde liegende Risikopositionen, die vorzeitige Rückzahlungen bis zu einer bestimmten Schwelle (d. h. 10 %) zulassen, ehe Gebühren anfallen.	JA	JA
CMRL46	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegenden Risikoposition erlaubt.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CMRL47	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition entrichtet werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CMRL48	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA
CMRL49	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung eingegangen ist.	JA	JA
CMRL50	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	Gesamtbetrag der seit Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition eingegangenen vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. außerplanmäßige Kapitalrückzahlungen) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
CMRL51	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA
CMRL52	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem der Schuldner zuletzt in Rückstand war.	JA	JA
CMRL53	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CMRL54	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	NEIN	NEIN
CMRL55	Kontostatus	Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition: Vertragsgemäß bedient (PERF)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR)</p> <p>Umstrukturiert — Rückstände (RARR)</p> <p>Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen</p> <p>Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT)</p> <p>Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR)</p> <p>Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB)</p> <p>Rückstände (ARRE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT)</p> <p>Zurückgezahlt (RDMD)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
CMRL56	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	<p>Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)</p>	JA	JA
CMRL57	Ausfallbetrag	<p>Bruttogesamtausfallbetrag vor Veräußerungserlösen und Rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
CMRL58	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CMRL59	Zugewiesene Verluste	Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Veräußerungserlösen (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. unter Berücksichtigung von Rückflüssen und Abwicklungsprozess. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CMRL60	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CMRL61	Einlagenbetrag	Summe aller vom Originator oder Verkäufer gehaltenen Schuldnerbeträge, die potenziell vom Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition abgezogen werden können, ohne Beträge unter nationalen Einlegerentschädigungssystemen. Zur Vermeidung einer Doppelzählung ist eine Obergrenze auf den niedrigeren Wert (1) des Einlagenbetrags und (2) des maximalen innerhalb des Pools potenziell in Abzug zu bringenden Betrags auf Ebene des Schuldners (d. h. nicht auf Ebene der zugrunde liegenden Risikoposition) anzuwenden. Angabe in der gleichen Währung wie bei der zugrunde liegenden Risikoposition. Hat ein Schuldner mehr als eine zugrunde liegende Risikoposition im Pool, so ist dieses Feld für jede zugrunde liegende Risikoposition auszufüllen und liegt es im Ermessen der meldenden Stelle, über die Zuweisung des Einlagenbetrags auf die einzelnen zugrunde liegenden Risikopositionen zu entscheiden, wobei die oben genannte Obergrenze zu beachten ist und die Summe der Einträge in diesem Feld für die verschiedenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum korrekten Betrag führen muss. Beispiel: Schuldner A weist einen Einlagensaldo von 100 EUR auf, und von zwei ausstehenden zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool beläuft sich die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR. In diesem Feld könnten entweder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 40 EUR oder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 25 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 75 EUR ausgewiesen werden (d. h. die relativen Einträge in diesem Feld sind für die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und für die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR beschränkt, und die Summe der Werte für die zugrunde liegende Risikoposition 1 und die zugrunde liegende Risikoposition 2 muss 100 EUR ergeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CMRL62	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CMRL63	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
CMRL64	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA
CMRL65	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
CMRL66	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
CMRL67	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN
CMRL68	Energieeffizienzausweis	Ausweis über die Gesamtenergieeffizienz der Sicherheit zum Zeitpunkt der Originierung: A (EPCA) B (EPCB) C (EPCC) D (EPCD) E (EPCE) F (EPCF) G (EPCG) Sonstige (OTHR)	JA	JA
CMRL69	Aussteller des Energieeffizienzausweises	Vollständige juristische Bezeichnung des Ausstellers des Energieeffizienzausweises. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA

## ANHANG VII

## ANGABEN ZU DEN ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — KREDITKARTE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
CCDL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
CCDL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CCDL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CCDL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CCDL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CCDL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CCDL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes CCDL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in CCDL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
CCDL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
CCDL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbrieftung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
CCDL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
CCDL9	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CCDL10	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
CCDL11	Beschäftigungsstatus	Beschäftigungsstatus des Hauptschuldners: Beschäftigt — Privatsektor (EMRS) Beschäftigt — öffentlicher Sektor (EMBL) Beschäftigt — Sektor nicht bekannt (EMUK) Arbeitslos (UNEM) Selbständig (SFEM) Keine Beschäftigung, Schuldner ist juristische Person (NOEM) Student (STNT) Rentner (PNNR) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CCDL12	Schuldner mit beeinträchtiger Bonität	Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldner oder Garantiegebern mit beeinträchtiger Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p> <p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktbewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
CCDL13	Kundentyp	<p>Kundentyp bei Originierung:</p> <p>Neuer Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CNEO)</p> <p>Neuer Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CEMO)</p> <p>Neuer Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (CNRO)</p> <p>Bestehender Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (ENEO)</p> <p>Bestehender Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (EEMO)</p> <p>Bestehender Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (ENRO)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
CCDL14	Primäreinkommen	<p>Jährliches, für die Zeichnung der zugrunde liegenden Risikoposition zugrunde gelegtes Einkommen des Hauptschuldners zum Zeitpunkt der Originierung. Ist der Hauptschuldner eine juristische Person/ein Unternehmen, so sind die jährlichen Einkünfte dieses Schuldners anzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	NEIN
CCDL15	Art des Primäreinkommens	<p>Art des in CCDL14 angegebenen Einkommens:</p> <p>Bruttojahreseinkommen (GRAN)</p> <p>Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (NITS)</p>	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (NITX) Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (NITN) Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (ENIS) Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (EITX) Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (EISS) Verfügbares Einkommen (DSPL) Kreditnehmer ist juristische Person (CORP) Sonstige (OTHR)		
CCDL16	Währung des Primäreinkommens	Währung, in der das Einkommen bzw. die Einkünfte des Primärschuldners gezahlt werden.	JA	NEIN
CCDL17	Überprüfung des Primäreinkommens	Überprüfung des Primäreinkommens: Eigenerklärung ohne weitere Prüfung (SCRT) Eigenerklärung mit Erschwinglichkeitsbestätigung (SCNF) Überprüft (VRFD) Keine Überprüfung des Einkommens oder Schnellprüfung („Fast Track“) (NVRF) Informationen von Kreditauskunfteien oder Scoring (SCRG) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
CCDL18	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
CCDL19	Datum der Originierung	Datum, an dem das Konto eröffnet wurde.	JA	NEIN
CCDL20	Originierungskanal	Originierungskanal: Internet (WEBI) Zweigstelle (BRCH) Telefonverkauf (TSL) Stand (STND) Post (POST) „White-Label“ (WLBL) Magazin (MGZN) Sonstige (OTHR)	JA	JA
CCDL21	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
CCDL22	Aktueller Kapitalsaldo	Angabe des aktuellen Gesamtbetrags, den der Schuldner bei dem Konto schuldet (einschließlich aller Gebühren und Zinsen). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CCDL23	Gesamtkreditlimit	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit flexiblen Neuziehungsfazilitäten (einschließlich Revolvierungseigenschaften) oder bei nicht vollständigem Abruf des Höchstbetrags der zugrunde liegenden Risikoposition — der maximale Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition, der potenziell ausstehend sein könnte. Dieses Feld ist nur für zugrunde liegende Risikopositionen mit flexiblen oder sonstigen Zeichnungseigenschaften auszufüllen. Dieses Feld dient nicht der Erfassung von Fällen, in denen der Schuldner einen erhöhten Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition neu verhandeln kann, sondern von Fällen, in denen aktuell die vertragliche Möglichkeit besteht, dass der Schuldner dies tut und der Kreditgeber die zusätzlichen Mittel zur Verfügung stellt. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CCDL24	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
CCDL25	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	NEIN	JA
CCDL26	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CCDL27	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CCDL28	Zahlungsfälligkeit	Nächste planmäßige Mindestzahlung, die vom Schuldner zu leisten ist Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
CCDL29	Aktueller Zinssatz	Gewichteter durchschnittlicher annualisierter Gesamtertrag, einschließlich aller anwendbaren Gebühren am letzten Rechnungsdatum (d. h. in Rechnung gestellt, nicht Barrendite).	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CCDL30	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
CCDL31	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)		
CCDL32	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN
CCDL33	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA
CCDL34	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem das Konto zuletzt einen Rückstand aufwies.	JA	JA
CCDL35	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, mit denen das Konto zum Datenstichtag im Rückstand ist. Gibt es keinen Rückstand, ist der Wert 0 einzugeben.	NEIN	NEIN
CCDL36	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
CCDL37	Kontostatus	Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition: Vertragsgemäß bedient (PERF) Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR) Umstrukturiert — Rückstände (RARR) Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR)</p> <p>Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB)</p> <p>Rückstände (ARRE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT)</p> <p>Zurückgezahlt (RDMD)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
CCDL38	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	<p>Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)</p>	JA	JA
CCDL39	Ausfallbetrag	<p>Bruttogesamtausfallbetrag vor Veräußerungserlösen und Rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
CCDL40	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA
CCDL41	Kumulierte Rückflüsse	<p>Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
CCDL42	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
CCDL43	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
CCDL44	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA
CCDL45	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
CCDL46	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
CCDL47	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN

## ANHANG VIII

## ANGABEN ZU DEN ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — LEASING

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
LESL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
LESL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
LESL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes LESL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in LESL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
LESL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
LESL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes LESL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in LESL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
LESL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
LESL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbiefung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
LESL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
LESL9	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL10	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	NEIN
LESL11	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	NEIN
LESL12	Schuldner mit beeinträchtiger Bonität	<p>Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldnern oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers</p> <p>a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn</p> <p>i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und</p> <p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p>	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktbewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
LESL13	Basel III-Segment des Schuldners	<p>Basel III-Segment des Schuldners:</p> <p>Unternehmen (CORP)</p> <p>Als Unternehmen behandelte kleine und mittlere Unternehmen (SMEX)</p> <p>Retail (RETL)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	JA
LESL14	Kundentyp	<p>Kundentyp bei Originierung:</p> <p>Neuer Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CNEO)</p> <p>Neuer Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (CEMO)</p> <p>Neuer Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (CNRO)</p> <p>Bestehender Kunde, der nicht Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (ENEO)</p> <p>Bestehender Kunde, der Angestellter/Zugehöriger der Gruppe des Originators ist (EEMO)</p> <p>Bestehender Kunde, Angestellten-/Zugehörigkeitsstatus nicht erfasst (ENRO)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN
LESL15	NACE-Branchencode	NACE-Branchencode des Leasingnehmers gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006.	JA	JA
LESL16	Unternehmensgröße	<p>Einstufung der Unternehmen nach Größe gemäß dem Anhang der Empfehlung 2003/361/EG der Kommission:</p> <p>Kleinstunternehmen (MICE): Unternehmen, das weniger als 10 Personen beschäftigt und dessen Jahresumsatz bzw. Jahresbilanz 2 Mio. EUR nicht überschreitet.</p> <p>Kleines Unternehmen (SMAE): Unternehmen, das weniger als 50 Personen beschäftigt und dessen Jahresumsatz bzw. Jahresbilanz 10 Mio. EUR nicht übersteigt.</p> <p>Mittleres Unternehmen (MEDE): Unternehmen, das weniger als 250 Personen beschäftigt und das entweder einen Jahresumsatz von höchstens 50 Mio. EUR erzielt bzw. dessen Jahresbilanzsumme sich auf höchstens 43 Mio. EUR beläuft.</p>	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Großes Unternehmen (LARE): Unternehmen, bei dem es sich weder um ein Kleinstunternehmen noch um ein kleines oder mittleres Unternehmen handelt. Natürliche Person (NATP) Sonstige (OTHR)		
LESL17	Einnahmen	Um Abschläge und Umsatzsteuern bereinigte jährliche Verkaufsmenge des Schuldners gemäß der Empfehlung 2003/361/EG. Entspricht dem Konzept des „Gesamtjahresumsatzes“ im Sinne von Artikel 153 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL18	Währung des Abschlusses	Meldewährung der Abschlüsse.	JA	JA
LESL19	Art des Produkts	Einstufung der zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Festlegungen des Leasinggebers: (Persönlicher) Kaufvertrag (PPUR) (Persönlicher) Mietvertrag (PHIR) Mietkauf (HIRP) Leasing-Kauf (LEAP) Finanzierungsleasing (FNLS) Betriebsleasing (OPLS) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
LESL20	Syndizierung	Ist die zugrunde liegende Risikoposition syndiziert?	JA	NEIN
LESL21	Sonderregelungen	Wenn für die zugrunde liegende Risikoposition eine Sonderregelung des öffentlichen Sektors gilt, ist hier die vollständige Bezeichnung (ohne Abkürzungen) der Regelung anzugeben.	JA	JA
LESL22	Datum der Originierung	Datum des ursprünglichen Leasingabschlusses.	JA	NEIN
LESL23	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	NEIN	JA
LESL24	Ursprüngliche Laufzeit	Ursprüngliche vertragliche Laufzeit (Anzahl der Monate) zum Zeitpunkt der Originierung.	JA	JA
LESL25	Originierungskanal	Kanal der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Büro- oder Zweigstellennetz (BRAN) Vermittler (BROK) Internet (WEBI) Sonstige (OTHR)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL26	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	NEIN
LESL27	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Kapital- (oder diskontierter) Saldo des Leasings (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Vergabe. Auszuweisen ist der Saldo des Leasings zum Datum des Abschlusses, d. h. nicht zum Datum des Verkaufs der zugrunde liegenden Risikoposition an die Verbriefungszweckgesellschaft oder des Abschlusses der Verbriefung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL28	Aktueller Kapitalsaldo	Ausstehender Saldo oder diskontierter Saldo des Leasings des Schuldners zum Datenstichtag. Dies umfasst sämtliche Beträge, die gegen den Vermögenswert besichert sind. Wenn dem Saldo beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL29	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
LESL30	Verbrieft Restwert	Restwert, der lediglich verbrieft wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL31	Tilgungsart	Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen). Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX) Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX) Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE) Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
LESL32	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	NEIN	JA
LESL33	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL34	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
LESL35	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL36	Aktueller Zinssatz	Gesamtbetrag des laufenden Bruttozins- oder Diskontierungszinssatzes für die zugrunde liegende Risikoposition. Für einzelne Perioden berechnete Sätze müssen annualisiert werden.	NEIN	JA
LESL37	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
LESL38	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	Laufzeit des aktuellen Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
LESL39	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb des Indexsatzes (falls unterhalb des Satzes, Eingabe eines negativen Wertes).	NEIN	JA
LESL40	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
LESL41	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einem Leasing mit variabler Verzinsung gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	NEIN	JA
LESL42	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einem Leasing mit variabler Verzinsung gemäß den Bedingungen der Leasing-Vereinbarung zahlen muss.	NEIN	JA
LESL43	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	NEIN
LESL44	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	Prozentualer Anteil der im Rahmen des Produkts zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr. Dies betrifft zugrunde liegende Risikopositionen, die vorzeitige Rückzahlungen bis zu einer bestimmten Schwelle (d. h. 10 %) zulassen, ehe Gebühren anfallen.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL45	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegenden Risikoposition erlaubt.	JA	JA
LESL46	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ zur Entschädigung für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum des Leasings entrichtet werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL47	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA
LESL48	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung eingegangen ist.	JA	JA
LESL49	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	Gesamtbetrag der seit Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition eingegangenen vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. außerplanmäßige Kapitalrückzahlungen) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL50	Preis bei Kaufoption	Betrag, den der Leasingnehmer bei Leasingende zahlen muss, um Eigentümer des Vermögenswerts zu werden, wenn dieser Betrag von dem in Feld LESL30 angegebenen Betrag abweicht. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL51	Anzahlungsbetrag	Höhe der Anzahlung bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich des Werts von in Zahlung genommener Ausrüstung usw.) Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL52	Aktueller Restwert des Vermögenswerts	Letzter prognostizierter Restwert des Vermögenswerts am Ende der Leasinglaufzeit. Falls keine Aktualisierung erfolgt ist, ist der ursprünglich geschätzte Restwert anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL53	Datum der Umstrukturierung	Angabe des Datums, an dem die zugrunde liegende Risikoposition umstrukturiert wurde. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Im Falle von Mehrfachdaten sind alle Daten im XML-Schema zu liefern.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL54	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem der Schuldner zuletzt in Rückstand war.	JA	JA
LESL55	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
LESL56	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	NEIN	NEIN
LESL57	Kontostatus	Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition: Vertragsgemäß bedient (PERF) Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR) Umstrukturiert — Rückstände (RARR) Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT) Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR) Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB) Rückstände (ARRE) Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR) Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF) Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE) Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS) Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT) Zurückgezahlt (RDMD) Sonstige (OTHR) Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL58	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)  Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)	JA	JA
LESL59	Ausfallbetrag	Bruttogesamtausfallbetrag vor Veräußerungserlösen und Rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL60	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	NEIN	JA
LESL61	Zugewiesene Verluste	Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Veräußerungserlösen (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. unter Berücksichtigung von Rückflüssen und Abwicklungsprozess. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL62	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
LESL63	Quelle von Rückzahlungen	Die Quelle rückgezahlter Beträge: Liquidation von Sicherheiten (LCOL) Vollstreckung von Garantien (EGAR) Zusätzliche Kredite (ALEN) Barrückzahlungen (CASR) Gemischt (MIXD) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL64	Einlagenbetrag	<p>Summe aller vom Originator oder Verkäufer gehaltenen Schuldnerbeträge, die potenziell vom Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition abgezogen werden können, ohne Beträge unter nationalen Einlegerentschädigungssystemen. Zur Vermeidung einer Doppelzählung ist eine Obergrenze auf den niedrigeren Wert (1) des Einlagenbetrags und (2) des maximalen innerhalb des Pools potenziell in Abzug zu bringenden Betrags auf Ebene des Schuldners (d. h. nicht auf Ebene der zugrunde liegenden Risikoposition) anzuwenden.</p> <p>Angabe in der gleichen Währung wie bei der zugrunde liegenden Risikoposition.</p> <p>Hat ein Schuldner mehr als eine zugrunde liegende Risikoposition im Pool, so ist dieses Feld für jede zugrunde liegende Risikoposition auszufüllen und liegt es im Ermessen der meldenden Stelle, über die Zuweisung des Einlagenbetrags auf die einzelnen zugrunde liegenden Risikopositionen zu entscheiden, wobei die oben genannte Obergrenze zu beachten ist und die Summe der Einträge in diesem Feld für die verschiedenen zugrunde liegenden Risikopositionen zum korrekten Betrag führen muss. Beispiel: Schuldner A weist einen Einlagensaldo von 100 EUR auf, und von zwei ausstehenden zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool beläuft sich die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR. In diesem Feld könnten entweder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 60 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 40 EUR oder die zugrunde liegende Risikoposition 1 mit 25 EUR und die zugrunde liegende Risikoposition 2 mit 75 EUR ausgewiesen werden (d. h. die relativen Einträge in diesem Feld sind für die zugrunde liegende Risikoposition 1 auf 60 EUR und für die zugrunde liegende Risikoposition 2 auf 75 EUR beschränkt, und die Summe der Werte für die zugrunde liegende Risikoposition 1 und die zugrunde liegende Risikoposition 2 muss 100 EUR ergeben.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	NEIN	JA
LESL65	Geografische Region — Sicherheit	Geografische Region (NUTS3-Klassifizierung), in der der Vermögenswert belegen ist. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
LESL66	Hersteller	Name des Herstellers des Vermögenswerts.	JA	NEIN
LESL67	Modell	Name des Vermögenswerts/Modells.	JA	NEIN
LESL68	Herstellungs-/Baujahr	Jahr der Herstellung.	JA	JA
LESL69	Neu oder gebraucht	<p>Zustand des Vermögenswertes bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition:</p> <p>Neu (NEWX)</p> <p>Gebraucht (USED)</p> <p>Vorfürswagen (DEMO)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL70	Ursprünglicher Restwert des Vermögenswerts	Geschätzter Restwert des Vermögenswerts am Datum der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL71	Art der Sicherheit	(Wertmäßig) primäre Art von Vermögenswert, durch den die zugrunde liegende Risikoposition besichert wird: Automobil (CARX) Industriefahrzeug (INDV) Lkw-Nutzfahrzeug (CMTR) Schienenfahrzeug (RALV) Nautisches Nutzfahrzeug (NACM) Nautisches Freizeitfahrzeug (NALV) Flugzeug (AERO) Werkzeugmaschine (MCHT) Industrierausrüstung (INDE) Büroausrüstung (OFEQ) Medizinische Ausrüstung (MDEQ) Energiebezogene Ausrüstung (ENEQ) Gewerbliches Gebäude (CBLD) Wohngebäude (RBLD) Industriegebäude (IBLD) Sonstiges Fahrzeug (OTHV) Sonstige Ausrüstung (OTHE) Sonstige Immobilien (OTRE) Sonstige Güter oder Bestände (OTGI) Wertpapier (SECU) Garantie (GUAR) Sonstiger finanzieller Vermögenswert (OTFA) IT-Ausrüstung (ITEQ) Gemischte Kategorien — Sicherheiten für alle Vermögenswerte des Schuldners (MIXD) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
LESL72	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	Bewertung des Vermögenswertes bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	NEIN
LESL73	Ursprüngliche Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des Werts des Vermögenswerts bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Vollständige Bewertung (FAPR) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVVM)	JA	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Indexiert (IDX) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA) Kaufpreis (PPRI) Haircut (HCUT) Sonstige (OTHR)		
LESL74	Ursprüngliches Bewertungsdatum	Datum der Bewertung des Vermögenswerts bei Originierung.	JA	NEIN
LESL75	Aktueller Bewertungsbetrag	Letzte Bewertung des Vermögenswerts. Falls seit der Originierung keine erneute Bewertung erfolgt ist, ist die ursprüngliche Bewertung anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
LESL76	Aktuelle Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des aktuellen Werts des Vermögenswerts. Falls seit der Originierung keine erneute Bewertung erfolgt ist, ist die Art der ursprünglichen Bewertung anzugeben: Vollständige Bewertung (FAPR) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM) Indexiert (IDX) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA) Kaufpreis (PPRI) Haircut (HCUT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
LESL77	Aktuelles Bewertungsdatum	Datum der letzten Bewertung des Vermögenswerts. Falls seit der Originierung keine erneute Bewertung erfolgt ist, ist das ursprüngliche Bewertungsdatum anzugeben.	JA	JA
LESL78	Zahl der Leasing-Objekte	Anzahl der einzelnen Vermögenswerte, die unter diese zugrunde liegende Risikoposition fallen.	JA	NEIN
LESL79	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
LESL80	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
LESL81	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
LESL82	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
LESL83	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
LESL84	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN

## ANHANG IX

## ANGABEN ZU DEN ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — „ESOTERIC“

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
ESTL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
ESTL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes ESTL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in ESTL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes ESTL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in ESTL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
ESTL7	Pool-Transferdatum	Datum, an dem die Risikopositionen an die Zweckgesellschaft transferiert wurden. Falls diese Information nicht verfügbar ist, ist in der ersten Meldung an das Verbriefungsregister für alle zugrunde liegenden Risikopositionen im Pool das jeweils spätere der beiden folgenden Daten anzugeben: (i) Abschluss der Verbriefung und (ii) Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
ESTL8	Rückkaufsdatum	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition vom Pool zurückgekauft wurde.	NEIN	JA
ESTL9	Rückzahlungsdatum	Datum der Rückzahlung oder (bei Ausfall der zugrunde liegenden Risikopositionen) Datum des Abschlusses des Einziehungsverfahrens.	NEIN	JA
ESTL10	Beschreibung	Kurze Beschreibung der zugrunde liegenden Risikoposition (z. B. „Stromtarifforderungen“, „Künftige Flüsse“). Bei zugrunde liegenden Risikopositionen dieser Art ist bei der Datenübermittlung durchgängig dieselbe Sprache zu verwenden.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTL11	Geografische Region — Schuldner	Geografische Region (NUTS-3-Klassifizierung), in der sich der Schuldner befindet. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
ESTL12	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	JA
ESTL13	Beschäftigungsstatus	Beschäftigungsstatus des Hauptschuldners: Beschäftigt — Privatsektor (EMRS) Beschäftigt — öffentlicher Sektor (EMBL) Beschäftigt — Sektor nicht bekannt (EMUK) Arbeitslos (UNEM) Selbständig (SFEM) Keine Beschäftigung, Schuldner ist juristische Person (NOEM) Student (STNT) Rentner (PNNR) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTL14	Schuldner mit beeinträchtiger Bonität	Bestätigung, dass die Risikoposition im Einklang mit Artikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 zum Zeitpunkt der Auswahl für die Übertragung auf die Verbriefungszweckgesellschaft weder im Sinne des Artikels 178 Absatz 1 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen ist noch eine Risikoposition gegenüber Schuldnern oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität ist, die nach bestem Wissen des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers a) für zahlungsunfähig erklärt wurden, oder deren Gläubigern ein Gericht innerhalb von drei Jahren vor der Originierung einen endgültigen und unanfechtbaren Vollstreckungsanspruch oder Schadenersatz aufgrund eines Zahlungsausfalls zugesprochen hat, oder die innerhalb von drei Jahren vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft ein Umschuldungsverfahren hinsichtlich ihrer notleidenden Risikopositionen durchlaufen haben, außer wenn i) eine umstrukturierte zugrunde liegende Risikoposition seit der Umstrukturierung, die mindestens ein Jahr vor der Übertragung oder Abtretung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf bzw. an die Verbriefungszweckgesellschaft stattgefunden haben muss, keine neuen Zahlungsrückstände aufgewiesen hat, und	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>ii) in den vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft nach Artikel 7 Absatz 1 Unterabsatz 1 Buchstabe a und Buchstabe e Ziffer i übermittelten Informationen der Anteil der umstrukturierten zugrunde liegenden Risikopositionen, der Zeitpunkt und die Einzelheiten ihrer Umstrukturierung sowie ihre Wertentwicklung seit der Umstrukturierung explizit dargelegt sind;</p> <p>b) zum Zeitpunkt der Originierung gegebenenfalls in einem öffentlichen Kreditregister von Personen mit negativer Bonitätsgeschichte oder — sofern es kein solches öffentliches Kreditregister gibt — in einem anderen Kreditregister, das für den Originator oder den ursprünglichen Kreditgeber zugänglich ist, eingetragen waren; oder</p> <p>c) eine Bonitätsbeurteilung oder eine Kreditpunktbewertung erhalten haben, der zufolge gegenüber vergleichbaren, nicht verbrieften Risikopositionen, die vom Originator gehalten werden, ein wesentlich höheres Risiko besteht, dass vertraglich vereinbarte Zahlungen nicht geleistet werden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>		
ESTL15	Rechtsform des Schuldners	Rechtsform des Kunden: Öffentliches Unternehmen (PUBL) Gesellschaft mit beschränkter Haftung (LLCO) Partnerschaft (PNTR) Einzelperson (INDV) Staatliche Stelle (GOVT) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTL16	NACE-Branchencode	NACE-Branchencode des Schuldners gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006.	JA	JA
ESTL17	Primäreinkommen	Jährliches, für die Zeichnung der zugrunde liegenden Risikoposition zugrunde gelegtes Einkommen des Hauptschuldners zum Zeitpunkt der Originierung. Ist der Hauptschuldner eine juristische Person/ein Unternehmen, so sind die jährlichen Einkünfte dieses Schuldners anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL18	Art des Primäreinkommens	Art des in ESTL17 angegebenen Einkommens: Bruttojahreseinkommen (GRAN) Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (NITS) Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (NITX) Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (NITN)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern und Sozialversicherung) (ENIS)</p> <p>Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Steuern) (EITX)</p> <p>Geschätztes Nettojahreseinkommen (ohne Sozialversicherung) (EISS)</p> <p>Verfügbares Einkommen (DSPL)</p> <p>Kreditnehmer ist juristische Person (CORP)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>		
ESTL19	Währung des Primäreinkommens	Währung, in der das Einkommen bzw. die Einkünfte des Primärschuldners gezahlt werden.	JA	JA
ESTL20	Überprüfung des Primäreinkommens	<p>Überprüfung des Primäreinkommens:</p> <p>Eigenerklärung ohne weitere Prüfung (SCRT)</p> <p>Eigenerklärung mit Erschwinglichkeitsbestätigung (SCNF)</p> <p>Überprüft (VRFD)</p> <p>Keine Überprüfung des Einkommens oder Schnellprüfung („Fast Track“) (NVRF)</p> <p>Informationen von Kreditauskunfteien oder Scoring (SCRG)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	JA	JA
ESTL21	Einnahmen	Um Abschläge und Umsatzsteuern bereinigte jährliche Verkaufsmenge des Schuldners gemäß der Empfehlung 2003/361/EG. Entspricht dem Konzept des „Gesamtjahresumsatzes“ im Sinne von Artikel 153 Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL22	Währung des Abschlusses	Meldewährung der Abschlüsse.	JA	JA
ESTL23	Internationale Wertpapierkennnummer	Gegebenenfalls ISIN-Code dieser zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
ESTL24	Datum der Originierung	Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
ESTL25	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition oder Ablaufdatum des Leasings.	JA	JA
ESTL26	Währung	Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.	NEIN	JA
ESTL27	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Kapitalsaldo der zugrunde liegenden Risikoposition (einschließlich kapitalisierter Gebühren) bei Originierung. Auszuweisen ist der Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datum ihrer Originierung und nicht zum Datum des Verkaufs der zugrunde liegenden Risikoposition an die Verbriefungszweckgesellschaft oder des Abschlusses der Verbriefung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTL28	Aktueller Kapitalsaldo	Ausstehender Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die bei der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL29	Gesamtkreditlimit	Bei zugrunde liegenden Risikopositionen mit flexiblen Neuziehungsfazilitäten (einschließlich Revolvierungseigenschaften) oder bei nicht vollständigem Abruf des Höchstbetrags der zugrunde liegenden Risikoposition — der maximale Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition, der potenziell ausstehend sein könnte. Dieses Feld ist nur für zugrunde liegende Risikopositionen mit flexiblen oder sonstigen Zeichnungseigenschaften auszufüllen. Dieses Feld dient nicht der Erfassung von Fällen, in denen der Schuldner einen erhöhten Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition neu verhandeln kann, sondern von Fällen, in denen aktuell die vertragliche Möglichkeit besteht, dass der Schuldner dies tut und der Kreditgeber die zusätzlichen Mittel zur Verfügung stellt. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL30	Kaufpreis	Angabe des Preises zum Nennwert, zu dem die zugrunde liegende Risikoposition von der Verbriefungszweckgesellschaft gekauft wurde. Wenn keine Abschläge vorgenommen wurden, ist der Wert 100 anzugeben.	NEIN	JA
ESTL31	Tilgungsart	Art der Tilgung der zugrunde liegenden Risikoposition (Kapital und Zinsen). Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbetrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt. (FRXX) Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen). (DEXX) Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt. (FIXE) Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt. (BLLT) Sonstige (OTHR)	JA	NEIN
ESTL32	Ende der tilgungsfreien Periode	Angabe des Enddatums der tilgungsfreien Periode, falls zum Datenstichtag anwendbar.	JA	JA
ESTL33	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTL34	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	Häufigkeit der Zinszahlungen, d. h. Zeitraum zwischen Zahlungen Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTL35	Zahlungsfälligkeit	Nächste vertragliche Zahlungsfälligkeit des Schuldners gemäß Zahlungshäufigkeit der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL36	Verhältnis zwischen Schulden und Einkommen	Schulden als ausstehender Betrag der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag, einschließlich sämtlicher Beträge, die durch die Hypothek besichert sind und in der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Einkommen gemäß Definition in Feld ESTL17 plus sonstiges relevantes Einkommen (z. B. Sekundäreinkommen).	JA	JA
ESTL37	Schlussrate	Gesamtbetrag der (verbrieften) Kapitalrückzahlungen zum Fälligkeitstermin der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL38	Zinsanpassungsintervall	Anzahl der Monate zwischen den einzelnen Zinsanpassungen bei der zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
ESTL39	Aktueller Zinssatz	Aktueller Zinssatz.	JA	JA
ESTL40	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH)	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
ESTL41	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTL42	Aktuelle Zinsmarge	Aktuelle Zinsmarge der variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition oberhalb des Indexsatzes (falls unterhalb des Satzes, Eingabe eines negativen Wertes).	JA	JA
ESTL43	Zinsobergrenze	Höchstzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegenden Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTL44	Zinsuntergrenze	Mindestzins, den der Schuldner bei einer variabel verzinslichen zugrunde liegende Risikoposition gemäß den Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition zahlen muss.	JA	JA
ESTL45	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	Anzahl der Zahlungen, die vor Übertragung der Risikoposition auf die Verbriefung getätigt wurden.	JA	JA
ESTL46	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	Prozentualer Anteil der im Rahmen des Produkts zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr. Dies betrifft zugrunde liegende Risikopositionen, die vorzeitige Rückzahlungen bis zu einer bestimmten Schwelle (d. h. 10 %) zulassen, ehe Gebühren anfallen.	JA	JA
ESTL47	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegenden Risikoposition erlaubt.	JA	JA
ESTL48	Vorfälligkeitsgebühr	Vom Schuldner als Gebühr/Strafe für vorzeitige Rückzahlungen gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition erhobener Betrag. Dabei werden keine Beträge erfasst, die als „Vertragsbruchkosten“ für Zinszahlungen bis zum Zahlungsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition entrichtet werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL49	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	Datum, nach dem der Kreditgeber die vorzeitige Rückzahlung der zugrunde liegende Risikoposition erlaubt, ohne dass eine Vorfälligkeitsgebühr fällig wird.	JA	JA
ESTL50	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	Letztes Datum, an dem eine außerplanmäßige Kapitalrückzahlung eingegangen ist.	JA	JA
ESTL51	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	Gesamtbetrag der seit Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition eingegangenen vorzeitigen Rückzahlungen (d. h. außerplanmäßige Kapitalrückzahlungen) (Stand Datenstichtag). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL52	Datum des letzten Rückstands	Datum, an dem der Schuldner zuletzt in Rückstand war.	JA	JA
ESTL53	Rückstandssaldo	Aktueller Saldo der Zahlungsrückstände, definiert als: Bis dato fällige Zahlungen insgesamt zuzüglich kapitalisierter Beträge zuzüglich für das Konto geltender Gebühren abzüglich bis dato eingegangener Zahlungen insgesamt. Wenn keine Rückstände bestehen, ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTL54	Rückstand in Tagen	Anzahl der Tage, an denen bei dieser zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag Rückstände bestehen (Zinsen oder Kapital, bei Differenz Angabe der höheren Zahl).	JA	JA
ESTL55	Kontostatus	<p>Aktueller Status der verbrieften zugrunde liegenden Risikoposition:</p> <p>Vertragsgemäß bedient (PERF)</p> <p>Umstrukturiert — keine Rückstände (RNAR)</p> <p>Umstrukturiert — Rückstände (RARR)</p> <p>Im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen</p> <p>Nicht im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgefallen, aber aufgrund einer anderen Ausfalldefinition als ausgefallen eingestuft (NDFT)</p> <p>Sowohl im Sinne des Artikels 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 als auch im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DTCR)</p> <p>Nur im Sinne einer anderen Ausfalldefinition ausgefallen (DADB)</p> <p>Rückstände (ARRE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Verstoß gegen Zusicherungen und Gewährleistungen (REBR)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — ausgefallen (REDF)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — umstrukturiert (RERE)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — Special Servicing (RESS)</p> <p>Vom Verkäufer zurückgekauft — sonstige Gründe (REOT)</p> <p>Zurückgezahlt (RDMD)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>	NEIN	NEIN
ESTL56	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	<p>Angabe des Grunds für den Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013:</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird. (UPXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (PDXX)</p> <p>Ausfall im Sinne von Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, weil es als unwahrscheinlich gilt, dass der Schuldner zahlen wird, und weil eine Verbindlichkeit mehr als 90/180 Tage überfällig ist. (UPPD)</p>	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTL57	Ausfallbetrag	Bruttogesamtausfallbetrag vor Veräußerungserlösen und Rückflüssen. Bei nicht ausgefallenen Positionen ist der Wert 0 einzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL58	Ausfalldatum	Datum des Ausfalls.	JA	JA
ESTL59	Zugewiesene Verluste	Bis dato zugewiesene Verluste ohne Gebühren, aufgelaufene Zinsen usw. nach Veräußerungserlösen (ohne Vorfälligkeitsentschädigung, falls Kapitalrückflüssen nachgeordnet) Etwaige Veräußerungsgewinne sind als negative Zahl auszuweisen. Die Angabe sollte die aktuelle Situation (Stand Datenstichtag) widerspiegeln, d. h. unter Berücksichtigung von Rückflüssen und Abwicklungsprozess. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL60	Kumulierte Rückflüsse	Gesamtrückflüsse (unabhängig von ihrer Quelle) auf die (ausgefallenen/ausgebuchten usw.) Verbindlichkeiten, abzüglich Kosten. Angabe aller Rückflussquellen, nicht nur Erlöse aus der Veräußerung von Sicherheiten. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTL61	Name des Originators	Vollständige juristische Bezeichnung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
ESTL62	Rechtsträgerkennung des Originators	Angabe der Rechtsträgerkennung des Originators der zugrunde liegenden Risikoposition (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
ESTL63	Land der Niederlassung des Originators	Land, in dem der Originator niedergelassen ist.	NEIN	NEIN
ESTL64	Name des ursprünglichen Kreditgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des ursprünglichen Kreditgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	JA	JA
ESTL65	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Ist keine Rechtsträgerkennung verfügbar, so ist ND5 einzutragen.	JA	JA
ESTL66	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	Land, in dem der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist.	JA	JA

## Angaben zu Sicherheiten

ESTC1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld ESTL1.	NEIN	NEIN
-------	--------------------	--	------	------

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Angabe muss der Kennung in Feld ESTL3 entsprechen. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die der Sicherheit oder Garantie zugewiesen wurde. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTC4	Neue Kennung der Sicherheit	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes ESTC3 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in ESTC3. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
ESTC5	Geografische Region — Sicherheit	Geografische Region (NUTS3-Klassifizierung), in der die Sicherheit belegen ist. Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
ESTC6	Art der Sicherung	Art der Sicherung: Sicherheit (COLL) Durch weitere Sicherheiten unterlegte Garantie (GCOL) Nicht durch weitere Sicherheiten unterlegte Garantie (GNCO) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
ESTC7	Art der Belastung	Angabe des Sicherungsrechts auf die Sicherheit. Bei Garantien ist in diesem Feld jedes Sicherungsrecht auf Sicherheiten zur Unterlegung dieser Garantie anzugeben. „Keine Belastung, aber unwiderrufliche Vollmacht oder Ähnliches“ beschreibt die Situation, dass der Originator oder ursprüngliche Kreditgeber unwiderruflich und bedingungslos dazu befugt ist, die Sicherheit in Zukunft einseitig zu belasten, ohne dafür die Zustimmung des Schuldners oder Garantiegebers einholen zu müssen: Feste Belastung (FXCH) Variable Belastung (FLCH) Keine Belastung (NOCG) Keine Belastung, aber unwiderrufliche Vollmacht oder Ähnliches (ATRN) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTC8	Sicherungsrechte	Höchstrangige Sicherungsrechte, die der Originator in Bezug auf die Sicherheit hält.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTC9	Art der Sicherheit	(Wertmäßig) primäre Art von Vermögenswert, durch den die Schuld besichert wird. Ist eine Garantie durch eine Sachsicherheit oder finanzielle Sicherheit unterlegt, Durchschau der Garantie im Hinblick auf jede etwaige Unterlegungssicherheit. Automobil (CARX) Industriefahrzeug (INDV) Lkw-Nutzfahrzeug (CMTR) Schienenfahrzeug (RALV) Nautisches Nutzfahrzeug (NACM) Nautisches Freizeitfahrzeug (NALV) Flugzeug (AERO) Werkzeugmaschine (MCHT) Industrierausrüstung (INDE) Büroausstattung (OFEQ) IT-Ausrüstung (ITEQ) Medizinische Ausrüstung (MDEQ) Energiebezogene Ausrüstung (ENEQ) Gewerbliches Gebäude (CBLD) Wohngebäude (RBLD) Industriegebäude (IBLD) Sonstiges Fahrzeug (OTHV) Sonstige Ausrüstung (OTHE) Sonstige Immobilien (OTRE) Sonstige Güter oder Bestände (OTGI) Wertpapiere (SECU) Garantie (GUAR) Sonstiger finanzieller Vermögenswert (OTFA) Gemischte Kategorien — Sicherheiten für alle Vermögenswerte des Schuldners (MIXD) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
ESTC10	Aktueller Bewertungsbetrag	Letzte Bewertung der Sicherheit. Ist eine Garantie durch eine Sachsicherheit oder finanzielle Sicherheit unterlegt, Durchschau der Garantie im Hinblick auf jede Unterlegungssicherheit. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTC11	Aktuelle Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des aktuellen Werts der Sicherheit gemäß Angabe in Feld ESTC10: Vollständige Bewertung (FAPR) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVB) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVM) Indexiert (IDXN) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA) Kaufpreis (PPRI) Haircut (HCUT) Marktbewertung (MTTM) Bewertung des Schuldners (OBLV) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTC12	Aktuelles Bewertungsdatum	Datum der aktuellsten Bewertung der Sicherheit gemäß Angabe in Feld ESTC10.	JA	JA
ESTC13	Aktuelle Beleihungsquote	Aktuelle Beleihungsquote (LTV). Bei nicht erstrangigen Sicherungsrechten ist dies die kombinierte oder Gesamt-LTV. Bei aktuell negativem Kreditsaldo ist 0 anzugeben.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
ESTC14	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	Ursprüngliche Bewertung der Sicherheit zum Datum der ursprünglichen Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
ESTC15	Ursprüngliche Bewertungsmethode	Methode zur Berechnung des Werts der in Feld ESTC14 gemeldeten Sicherheit bei Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition: Vollständige Bewertung (FAPR) Fernabschätzung („Drive-by“) (DRVb) Automatisiertes Bewertungsmodell (AUVm) Indexiert (IDXd) Desktop (DKTP) Sachbearbeiter oder Immobilienmakler (MAEA) Kaufpreis (PPRI) Haircut (HCUT) Marktbewertung (MTM) Bewertung des Schuldners (OBLV) Sonstige (OTHR)	JA	JA
ESTC16	Ursprüngliches Bewertungsdatum	Datum der ursprünglichen Bewertung der Sachsicherheit oder finanziellen Sicherheit gemäß Angabe in Feld ESTC14.	JA	JA
ESTC17	Ursprüngliche Beleihungsquote	Ursprüngliche übernommene Beleihungsquote (LTV) des Originators. Bei nicht erstrangigen Sicherungsrechten ist dies die kombinierte oder Gesamt-LTV.	JA	JA
ESTC18	Verkaufsdatum	Datum des Verkaufs der Sicherheit.	NEIN	JA
ESTC19	Verkaufspreis	Preis, der bei der Veräußerung von Sicherheiten im Falle einer Zwangsvollstreckung erzielt wurde. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
ESTC20	Währung der Sicherheit	Währung, auf die der in ESTC10 angegebene Bewertungsbetrag lautet.	NEIN	JA

## ANHANG X

## ANGABEN ZU ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — AUFSCHLAG FÜR NOTLEIDENDE RISIKOPOSITIONEN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
NPEL1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung. Dieser Eintrag muss dem Eintrag im Feld der eindeutigen Kennung im begleitenden Meldebogen für diese betreffende zugrunde liegende Risikoposition entsprechen.	NEIN	NEIN
NPEL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern. Dieser Eintrag muss dem Eintrag im Feld „Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition“ im begleitenden Meldebogen für die zugrunde liegende Risikoposition (Anhänge II bis IX) entsprechen.	NEIN	NEIN
NPEL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes NPEL2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. (Diese neue Kennung muss dem Eintrag im Feld „Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition“ im begleitenden Meldebogen für die zugrunde liegende Risikoposition (Anhänge II bis IX) entsprechen. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in NPEL2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
NPEL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Schuldners. Die Kennung darf nicht mit jeglichen externen Kennnummern identisch sein, um die Anonymität des Schuldners zu gewährleisten. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern. Dieser Eintrag muss dem Eintrag im Feld „Ursprüngliche Kennung des Schuldners“ im begleitenden Meldebogen für die zugrunde liegende Risikoposition (Anhänge II bis IX) entsprechen.	NEIN	NEIN
NPEL5	Neue Kennung des Schuldners	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes NPEL4 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. (Diese neue Kennung muss dem Eintrag im Feld „Neue Kennung des Schuldners“ im begleitenden Meldebogen für die zugrunde liegende Risikoposition (Anhänge II bis IX) entsprechen. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in NPEL4. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
NPEL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
NPEL7	Unter Zwangsverwaltung	Angabe, ob der Schuldner unter Zwangsverwaltung steht.	JA	JA
NPEL8	Datum des letzten Kontakts	Datum des letzten direkten Kontakts mit dem Schuldner.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEL9	Verstorben	Angabe, ob der Schuldner verstorben ist.	JA	JA
NPEL10	Rechtsform	Rechtsform des Schuldners. Börsennotierte Unternehmen sind Unternehmen, deren Aktien an einer Börse notiert sind und gehandelt werden (LCRP). Nicht börsennotierte Unternehmen sind Unternehmen, deren Aktien nicht an einer Börse notiert sind und gehandelt werden; nicht börsennotierte Unternehmen können jedoch eine unbegrenzte Anzahl von Aktionären/Anteilseignern haben, um Kapital für kommerzielle Vorhaben zu beschaffen (UCRP). Börsennotierte Fonds sind Fonds, deren Anteile an einer Börse notiert sind und gehandelt werden (LFND). Nicht börsennotierte Fonds sind Fonds, deren Anteile nicht an einer Börse notiert sind und gehandelt werden (UFND). In Partnerschaften handelt es beim Sponsor um eine Gruppe von Einzelpersonen, die eine rechtliche Partnerschaft bilden, in der Gewinne und Verbindlichkeiten geteilt werden (PSHP). Privatperson (INDV)	JA	JA
NPEL11	Art des rechtlichen Verfahrens	Art des Insolvenzverfahrens, in dem sich der Schuldner derzeit befindet: Unternehmensumstrukturierung, einschließlich Fonds (CPRR) Insolvenzverfahren, einschließlich Fonds (CPRI) Privatschuldner-Schuldenvergleich (PRCM) Privatschuldner-Insolvenzverfahren (PRIP) Umstrukturierung von Partnerschaften (PRTR) Insolvenz von Partnerschaften (PRTR) Sonstige (OTHR)	JA	JA
NPEL12	Bezeichnung des rechtlichen Verfahrens	Bezeichnung des rechtlichen Verfahrens, die Aufschluss darüber gibt, wie weit das entsprechende Verfahren fortgeschritten ist, je nach Land, in dem sich der Schuldner befindet.	JA	JA
NPEL13	Abgeschlossene rechtliche Verfahren	Beschreibung der für den Schuldner abgeschlossenen rechtlichen Verfahren.	JA	JA
NPEL14	Datum der Einleitung des aktuellen rechtlichen Verfahrens	Datum, an dem der Schuldner in das aktuelle rechtliche Verfahren eingetreten ist.	JA	JA
NPEL15	Datum der Bestellung des Insolvenzverwalters	Datum, an dem der Insolvenzverwalter bestellt wurde.	JA	JA
NPEL16	Zahl der derzeitigen Urteile	Zahl der ausstehenden gerichtlichen Vollstreckungsmaßnahmen gegen den Schuldner.	JA	JA
NPEL17	Zahl der vollstreckten Urteile	Zahl der abgeschlossenen gerichtlichen Vollstreckungsmaßnahmen gegen den Schuldner.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEL18	Datum der externen Zahlungsaufforderung	Datum des Versands einer Zahlungsaufforderung durch einen im Namen des Instituts handelnden Anwalt.	JA	JA
NPEL19	Datum des Schreibens über den Rechtsvorbehalt	Datum des Schreibens über den Rechtsvorbehalt des Instituts	JA	JA
NPEL20	Gerichtliche Zuständigkeit	Sitz des Gerichts, bei dem der Fall verhandelt wird.	JA	JA
NPEL21	Datum des Erhalts des Räumungsbescheids	Datum der Erteilung des Räumungsbescheids durch das Gericht	JA	JA
NPEL22	Anmerkungen zu anderen Verfahren im Zusammenhang mit Rechtsstreitigkeiten	Weitere Anmerkungen/Einzelheiten, sofern es weitere Rechtsverfahren gibt.	JA	JA
NPEL23	Anwendbares Recht	Recht des Landes, dem die Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition unterliegt. Dies muss nicht notwendigerweise das Land der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition sein.	JA	JA
NPEL24	Beschreibung der Rückzahlung	Beschreibung des spezifischen Rückzahlungsprofils, wenn im Feld „Tilgungsart“ die Angabe „Sonstige“ erfolgte.	JA	JA
NPEL25	Beginn des tilgungsfreien Zeitraums	Startdatum des Zeitraums, in dem nur laufende Zinsen gezahlt werden.	JA	JA
NPEL26	Ende des tilgungsfreien Zeitraums	Enddatum des Zeitraums, in dem nur Zinsen gezahlt werden.	JA	JA
NPEL27	Beginn der Periode mit fester Verzinsung	Startdatum der Periode mit fester Verzinsung.	JA	JA
NPEL28	Ende der Periode mit fester Verzinsung	Enddatum der Periode mit fester Verzinsung.	JA	JA
NPEL29	Aktueller Zinsumwandlungssatz	Aktueller Zinsumwandlungssatz gemäß der Vereinbarung über die zugrunde liegenden Risikopositionen.	JA	JA
NPEL30	Letztes Zahlungsdatum	Datum, an dem die letzte Zahlung geleistet wurde.	JA	JA
NPEL31	Syndizierter Anteil	Prozentsatz des vom Institut gehaltenen Anteils, für den im Feld „Syndiziert“ im entsprechenden Anhang für die notleidende Risikoposition „Ja“ angegeben wird.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEL32	Beginn des MARP-Prozesses	Datum, an dem die zugrunde liegende Risikoposition in den aktuellen MARP-Status eingetreten ist.	JA	JA
NPEL33	MARP-Status	Status des derzeitigen Verfahrens zum Abbau im Rückstand befindlicher Hypothekenzahlungen (MARP): Nicht in MARP (NMRP) MARP abgeschlossen (EMRP) Provision 23, 31 Tage im Rückstand (MP23) Provision 24, finanzielle Schwierigkeiten (MP24) Provision 28, nicht kooperierend — Warnung (MP28) Provision 29, nicht kooperierend (MP29) Provision 42, Umstrukturierung — Angebot (MP42) Provision 45, Umstrukturierung — vom Verkäufer abgelehnt (MP45) Provision 47, Umstrukturierung — vom Kreditnehmer abgelehnt (MP47) Selbstabhilfe (MPSC) Alternative Rückzahlungsvereinbarung (MPAR) Sonstige (OTHR)	JA	JA
NPEL34	Externe Einziehungen	Indikator für die Vorbereitung externer Einziehungen auf Ebene des Schuldners oder auf Ebene einer zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
NPEL35	Rückzahlungsplan	Indikator für die Vereinbarung eines Rückzahlungsplans mit der externen Inkassoagentur.	JA	JA
NPEL36	Stundung	Indikator für die Vorbereitung von Stundungen auf Ebene des Schuldners oder auf Ebene einer zugrunde liegenden Risikoposition.	JA	JA
NPEL37	Datum der ersten Stundung	Datum, an dem die erste Stundung erfolgte.	JA	JA
NPEL38	Zahl bisheriger Stundungen	Zahl in der Vergangenheit erfolgter Stundungen	JA	JA
NPEL39	Kapitalverzicht	Höhe des im Rahmen der laufenden Stundung erlassenen Kapitals, einschließlich eines von externen Inkassoagenturen vereinbarten Kapitalverzichts. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEL40	Datum des Kapitalverzichts	Datum des Kapitalverzichts.	JA	JA
NPEL41	Enddatum der Stundung	Datum, an dem die derzeitige Stundungsvereinbarung endet.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEL42	Unter die Stundung fallender Rückzahlungsbetrag	Höhe der periodischen Rückzahlung, die das Institut und der Schuldner in den derzeitigen Stundungsmodalitäten vereinbart haben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

## Angaben zu Sicherheiten

NPEC1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld NPEL1.	NEIN	NEIN
NPEC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Angabe muss der Kennung in Feld NPEL3 entsprechen. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
NPEC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die der Sicherheit oder Garantie zugewiesen wurde. Sind aufgrund der Art der zugrunde liegenden Risikoposition die Anhänge II, III, IV oder IX auszufüllen, muss die Eingabe in diesem Feld der Eingabe im Feld „Ursprüngliche Kennung der Sicherheit“ im Meldebogen für diese spezifische Sicherheit entsprechen (d. h. dieses Feld muss mit der Angabe in den Feldern RREC3, CREC3, CRPC3 bzw. ESTC3 Kennung übereinstimmen). Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
NPEC4	Neue Kennung der Sicherheit	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes NPEC3 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Sind aufgrund der Art der zugrunde liegenden Risikoposition die Anhänge II, III, IV oder IX auszufüllen, muss diese neue Kennung der Eingabe im Feld „Neue Kennung der Sicherheit“ im Meldebogen für diese spezifische Sicherheit entsprechen (d. h. dieses Feld muss mit der Angabe in den Feldern RREC4, CREC4, CRPC4 bzw. ESTC4 Kennung übereinstimmen). Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in NPEC3. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
NPEC5	Höhe der Mehrwertsteuer	Betrag der bei der Veräußerung dieses Postens zu zahlenden Mehrwertsteuer.	JA	JA
NPEC6	Fortschritt der Arbeiten	Prozentualer Anteil der seit Baubeginn abgeschlossenen Arbeiten.	JA	JA
NPEC7	Status der Vollstreckung	Stand des Vollstreckungsverfahrens, in dem sich die Sicherheit zum Stichtag befindet (z. B. bei Zwangsverwaltung).	JA	JA
NPEC8	Status der Vollstreckung durch Dritte	Haben andere gesicherte Gläubiger Schritte unternommen, um Ansprüche auf die Sicherheit durchzusetzen?	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEC9	Zugewiesener Hypothekenbetrag	Gesamtbetrag der Immobiliensicherheiten zugewiesenen Hypothek. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC10	Höherrangige zugrunde liegende Risikopositionen	Anzahl höherrangiger Rechte auf zugrunde liegende Risikopositionen, die durch die Sicherheit unterlegt sind, die nicht durch das Institut gehalten wird und nicht Bestandteil des Portfolios ist. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC11	Beschreibung der Vollstreckung	Anmerkungen oder Beschreibung des Status der Vollstreckung	JA	JA
NPEC12	Gerichtlich festgestellter Betrag	Durch gerichtliche Prüfung festgestellter Betrag der Immobilie/der Sicherheit. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC13	Datum der gerichtlichen Prüfung	Datum der gerichtlichen Prüfung.	JA	JA
NPEC14	Marktpreis	Preis der Immobilie/Sicherheit auf dem Markt. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC15	Angebotspreis	Höchstes Preisangebot potenzieller Käufer. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC16	Datum, an dem die Immobilie für den Verkauf vorbereitet wird	Datum, an dem die Immobilie/Sicherheit für den Verkauf vorbereitet wird.	JA	JA
NPEC17	Datum, an dem der Verkauf der Immobilie angekündigt wird	Datum, an dem die Sicherheit auf dem Markt beworben wird.	JA	JA
NPEC18	Datum, ab dem die Immobilie zum Verkauf angeboten wird	Datum des Verkaufsangebots auf dem Markt.	JA	JA
NPEC19	Vereinbartes Verkaufsdatum	Vereinbartes Verkaufsdatum.	JA	JA
NPEC20	Vertragsdatum	Vertragsdatum.	JA	JA
NPEC21	Erstes Auktionsdatum	Datum der ersten Auktion zum Verkauf der Immobilie/Sicherheit.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEC22	Gerichtlich festgelegter Mindestpreis für die erste Auktion	Gerichtlich festgelegter Mindestpreis für die erste Auktion, d. h. gerichtlich verlangter Mindestpreis. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC23	Nächstes Auktionsdatum	Datum der planmäßig nächsten Auktion zum Verkauf der Immobilie/Sicherheit.	JA	JA
NPEC24	Gerichtlich festgelegter Mindestpreis für die nächste Auktion	Gerichtlich festgelegter Mindestpreis für die nächste Auktion, d. h. gerichtlich verlangter Mindestpreis. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC25	Letztes Auktionsdatum	Datum der letzten Auktion zum Verkauf der Immobilie/Sicherheit.	JA	JA
NPEC26	Gerichtlich festgelegter Mindestpreis für die letzte Auktion	Gerichtlich festgelegter Mindestpreis für die letzte Auktion, d. h. gerichtlich verlangter Mindestpreis. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEC27	Zahl ergebnisloser Auktionen	Anzahl bisheriger ergebnisloser Auktionen für die Immobilie/Sicherheit.	JA	JA

## Angaben zu bisherigen Einziehungen

NPEH1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld NPEL1.	NEIN	NEIN
NPEH2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition Die Angabe muss der Kennung in Feld NPEL3 entsprechen. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
NPEH [3-38]	Negativsaldo im Monat n	Aufstellung nicht gezahlter Gesamtbeträge in den 36 Monaten vor dem Datenstichtag mit Meldung jedes monatlichen Betrags in einem getrennten Feld, beginnend mit dem jüngsten Monat in Feld NPEH3 und endend mit dem am längsten verstrichenen Monat in Feld NPEH38. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEH [39-74]	Aufstellung der überfälligen Salden im Monat n	Aufstellung überfälliger Gesamtbeträge in den 36 Monaten vor dem Datenstichtag mit Meldung jedes monatlichen Betrags in einem getrennten Feld, beginnend mit dem jüngsten Monat in Feld NPEH39 und endend mit dem am längsten verstrichenen Monat in Feld NPEH74. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
NPEH [75-110]	Aufstellung der nicht aus dem Verkauf von Sicherheiten stammenden Rückzahlungen im Monat n	Rückzahlungen des Schuldners in den 36 Monaten vor dem Datenstichtag ohne Berücksichtigung des Verkaufs von Sicherheiten, aber einschließlich Einziehungen durch externe Inkassoagenturen, mit Meldung jedes monatlichen Betrags in einem getrennten Feld, beginnend mit dem jüngsten Monat in Feld NPEH75 und endend mit dem am längsten verstrichenen Monat in Feld NPEH110. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
NPEH [111-146]	Aufstellung der Rückzahlungen aus dem Verkauf von Sicherheiten im Monat n	Rückzahlungen aus dem Verkauf von Sicherheiten in den 36 Monaten vor dem Datenstichtag, mit Meldung jedes monatlichen Betrags in einem getrennten Feld, beginnend mit dem jüngsten Monat in Feld NPEH111 und endend mit dem am längsten verstrichenen Monat in Feld NPEH146. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

## ANHANG XI

ANGABEN ZU ZUGRUNDE LIEGENDEN RISIKOPOSITIONEN — FORDERUNGSGEDECKTE  
GELDMARKTPAPIERE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1- ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen				
IVAL1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 diesem ABCP-Programm zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
IVAL2	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 dieser ABCP-Transaktion zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
IVAL3	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Eindeutige Kennung der Art der zugrunde liegenden Risikoposition. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVAL4	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes IVAL3 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in IVAL3. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVAL5	Art der zugrunde liegenden Risikoposition	Wählen Sie die Art der zugrunde liegenden Risikoposition aus, die Teil dieser Transaktion ist: Forderungen aus Lieferungen und Leistungen (TREC) Kfz-Kredite oder -Leasing (ALOL) Verbraucherkredite (CONL) Ausrüstungsleasing (EQPL) Lagerfinanzierungskredit (FLRF) Versicherungsprämien (INSU) Kreditkartenforderungen (CCRR) Hypotheken auf Wohnimmobilien (RMRT) Hypotheken auf Gewerbeimmobilien (CMRT) Kredite an kleine und mittlere Unternehmen (SMEL) Kredite an Nicht-KMU-Unternehmen (NSML) Künftige Flüsse (FUTR) Hebelfinanzierung (LVRG) Durch einen Anleihe-Pool besicherte Wertpapiere (CBOB) Durch ein Kreditportfolio besicherte Wertpapiere (CLOB) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
IVAL6	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAL7	Geografische Region — höchste Expositions-konzentration 1	Geografische Region, in der der höchste Betrag der zugrunde liegenden Risikopositionen dieser Art belegen ist (Wiederbeschaffungswert der Risikopositionen zum Datenstichtag). Anzugeben ist entweder der Verwahrort der Sicherheit (bei besicherten zugrunde liegenden Risikopositionen) oder der Aufenthaltsort des Schuldners (bei unbesicherten zugrunde liegenden Risikopositionen). Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
IVAL8	Geografische Region — höchste Expositions-konzentration 2	Geografische Region, in der der zweithöchste Betrag der zugrunde liegenden Risikopositionen dieser Art belegen ist (Wiederbeschaffungswert der Risikopositionen zum Datenstichtag). Anzugeben ist entweder der Verwahrort der Sicherheit (bei besicherten zugrunde liegenden Risikopositionen) oder der Aufenthaltsort des Schuldners (bei unbesicherten zugrunde liegenden Risikopositionen). Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
IVAL9	Geografische Region — höchste Expositions-konzentration 3	Geografische Region, in der der dritthöchste Betrag der zugrunde liegenden Risikopositionen dieser Art belegen ist (Wiederbeschaffungswert der Risikopositionen zum Datenstichtag). Anzugeben ist entweder der Verwahrort der Sicherheit (bei besicherten zugrunde liegenden Risikopositionen) oder der Aufenthaltsort des Schuldners (bei unbesicherten zugrunde liegenden Risikopositionen). Gibt es keine NUTS-3-Klassifizierung von Eurostat (z. B. in einem Nicht-EU-Land), so ist der zweistellige Ländercode im Format {COUNTRYCODE_2} anzugeben, gefolgt von „ZZZ“.	JA	JA
IVAL10	Klassifizierung der geografischen Region	Angabe des Jahres der in den Feldern der geografischen Region angegebenen NUTS-3-Klassifizierung, z. B. 2013 für NUTS-3 2013. Bei der Datenmeldung muss in allen Feldern der geografischen Region für jede zugrunde liegende Risikoposition und über alle zugrunde liegenden Risikopositionen hinweg durchgängig die gleiche Klassifizierung verwendet werden. So ist es beispielsweise nicht zulässig, bei der Meldung in einigen Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegenden Risikopositionen NUTS-3 2006 und bei der Meldung in anderen Feldern, die sich auf dieselbe Risikoposition beziehen, NUTS-3 2013 zu verwenden. Genauso wenig ist es zulässig, bei der gleichen Datenmeldung in Feldern der geografischen Region für bestimmte zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2006 und für andere zugrunde liegende Risikopositionen NUTS-3 2013 zu verwenden.	JA	JA
IVAL11	Aktueller Kapitalsaldo	Gesamtbetrag der ausstehenden Kapitalbilanz zum Datenstichtag für diese Art von Risikopositionen. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die bei der Verbriefung als Kapital eingestuft werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAL12	Anzahl der zugrunde liegenden Risikopositionen	Anzahl der verbrieften zugrunde liegenden Risikopositionen dieser Art.	JA	NEIN
IVAL13	Risikopositionen in EUR	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für auf EUR lautende Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL14	Risikopositionen in GBP	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für auf GBP lautende Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL15	Risikopositionen in USD	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für auf USD lautende Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL16	Sonstige Risikopositionen	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für nicht auf EUR, GBP oder USD lautende Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL17	Maximale Restlaufzeit	Längste Restlaufzeit in Monaten für alle Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag.	JA	JA
IVAL18	Durchschnittliche Restlaufzeit	Durchschnittliche Restlaufzeit in Monaten zum Datenstichtag, gewichtet nach dem aktuellen Saldo zum Datenstichtag, für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL19	Aktuelle Beleihungsquote	Auf der Grundlage der aktuellen Salden aller Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag gewichtete durchschnittliche Beleihungsquote (LTV). Bei nicht erstrangigen Sicherungsrechten ist dies die kombinierte oder Gesamt-LTV.	JA	JA
IVAL20	Verhältnis zwischen Schulden und Einkommen	Auf der Grundlage der aktuellen Salden aller Risikopositionen dieser Art zum Datenstichtag gewichtetes durchschnittliches Schulden-Einkommen-Verhältnis des Schuldners. Schulden werden definiert als ausstehender Gesamtkapitalsaldo der ausstehenden zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag. Dies schließt sämtliche Beträge ein, die bei der Verbriefung als Kapital klassifiziert werden. Wenn dem Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition beispielsweise Gebühren hinzugefügt wurden und diese Teil des Kapitals in der Verbriefung sind, müssen diese hinzugerechnet werden. Ausgenommen sind Zinsrückstände oder Strafsummen. Einkommen wird definiert als kombiniertes Einkommen, d. h. Summe aus Primär- und (falls zutreffend) Sekundäreinkommen.	JA	JA
IVAL21	Tilgungsart	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für Risikopositionen dieser Art mit endfälliger Tilgung, Schlussraten-Tilgung oder einer anderen Tilgungsvereinbarung, die nicht Französisch, Deutsch oder ein fester Tilgungsplan ist. Für die Zwecke dieses Felds gelten folgende Definitionen: — Französisch: Mit jeder Tranche wird der gleiche Gesamtbeitrag (Kapital plus Zinsen) zurückgezahlt;	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<ul style="list-style-type: none"> <li>— Deutsch: Mit der ersten Tranche werden nur Zinsen gezahlt; die restlichen Tranchen erfolgen in stets gleicher Höhe (Kapital plus Zinsen).</li> <li>— Fester Tilgungsplan: Mit jeder Tranche wird der gleiche Kapitalbetrag zurückgezahlt.</li> <li>— Endfällig: Der vollständige Kapitalbetrag wird in der letzten Tranche zurückgezahlt.</li> <li>— Schlussratentilgung: Kapitalteilrückzahlung, gefolgt von einer höheren abschließenden Kapitalrückzahlung.</li> <li>— Andere Tilgungsarten: Alle anderen Arten der Tilgung, die nicht durch eine der oben genannten Kategorien fallen.</li> </ul> Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.		
IVAL22	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen in Abständen von mehr als einem Monat	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für Risikopositionen dieser Art, bei denen der Zeitraum zwischen fälligen Kapitalrückzahlungen mehr als einen Monat beträgt (z. B. vierteljährlich, halbjährlich, jährlich, endfällig, Null-Kupon, Sonstige). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL23	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen in Abständen von mehr als einem Monat	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für Risikopositionen dieser Art, bei denen der Zeitraum zwischen fälligen Zinszahlungen mehr als einen Monat beträgt (z. B. vierteljährlich, halbjährlich, jährlich, endfällig, Null-Kupon, Sonstige). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL24	Forderungen mit variabler Verzinsung	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für Risikopositionen dieser Art mit variablem Zinssatz zum Datenstichtag. „Variabel“ bezeichnet einen Satz, der an einen der folgenden Werte gebunden ist: LIBOR (jede Währung und Laufzeit), EURIBOR (jede Währung und Laufzeit), Basissatz einer Zentralbank (BoE, EZB usw.), variabler Standardsatz des Originator oder ähnliche Vereinbarungen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL25	Finanzierter Betrag	Betrag zugrunde liegender Risikopositionen, die zwischen dem letzten Datenstichtag und dem Stichtag für die Übermittlung dieser Daten bei dieser Transaktion vom Originator gekauft und durch Geldmarktpapiere finanziert wurden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL26	Verwässerungen	Gesamtkapitalminderungen bei zugrunde liegenden Risikopositionen dieser Art in der Periode. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL27	Zurückgekaufte Risikopositionen	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo für Risikopositionen dieser Art, die zwischen dem unmittelbar vorhergehenden Datenstichtag und dem aktuellen Datenstichtag vom Originator/Sponsor zurückgekauft (und dadurch aus dem Pool der zugrunde liegenden Risikopositionen herausgenommen) wurden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAL28	Bei Verbriefung ausgefallene Risikopositionen oder bonitätsbeeinträchtigte Risikopositionen	Gemäß Artikel 24 Absatz 9 der Verordnung (EU) 2017/2402 Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die zum Zeitpunkt der Verbriefung entweder ausgefallene Risikopositionen oder Risikopositionen gegenüber Schuldner oder Garantiegebern mit beeinträchtigter Bonität im Sinne des genannten Artikels waren. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL29	Ausgefallene Risikopositionen	Zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalsaldo ausgefallener Risikopositionen auf der Grundlage der in den Verbriefungsunterlagen enthaltenen Ausfalldefinition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL30	Ausgefallene Risikopositionen im Sinne der Eigenmittelverordnung	Zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalsaldo ausgefallener Risikopositionen auf der Grundlage der in Artikel 178 der Verordnung (EU) 575/2013 enthaltenen Ausfalldefinition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL31	Bruttoausbuchungen in der Periode	Nennwert der Bruttoausbuchungen (d. h. vor Rückflüssen) für die Periode. Ausbuchung gemäß Festlegung in der Verbriefung oder alternativ gemäß üblicher Praxis des Kreditgebers. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAL32	Rückstände 1-29 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 1 und 29 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL33	Rückstände 30-59 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 30 und 59 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL34	Rückstände 60-89 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 60 und 89 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAL35	Rückstände 90-119 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 90 und 119 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL36	Rückstände 120-149 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 120 und 149 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL37	Rückstände 150-179 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 150 und 179 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL38	Rückstände 180+ Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum von 180 Tagen und mehr fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	JA	JA
IVAL39	Umstrukturierte Risikopositionen	Anteil der Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurden. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Berechnung des Anteils als aktueller Gesamtsaldo dieser Risikopositionen, dividiert durch den aktuellen Gesamtsaldo von Risikopositionen dieser Art, zum Datenstichtag.	JA	JA
IVAL40	Umstrukturierte Risikopositionen (0 bis 1 Jahr vor Übertragung)	Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt im letzten Jahr vor dem Datum der Übertragung auf oder Abtretung an die Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurden.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>		
IVAL41	Umstrukturierte Risikopositionen (1 bis 3 Jahre vor Übertragung)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt in den letzten drei Jahren, nicht aber im letzten Jahr vor dem Datum der Übertragung auf oder Abtretung an die Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
IVAL42	Umstrukturierte Risikopositionen (mehr als 3 Jahre vor Übertragung)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt vor mehr als drei Jahren vor dem Datum der Übertragung auf oder Abtretung an die Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurden.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
IVAL43	Umstrukturierte Risikopositionen (Zinssatz)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, deren Zinssatz vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurde.</p> <p>Als Umstrukturierung des Zinssatzes gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren und Vertragsstrafen, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte, zinsrelevante Umstrukturierungsmaßnahmen.</p>	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.		
IVAL44	Umstrukturierte Risikopositionen (Rückzahlungsplan)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, deren Rückzahlungsplan vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurde.</p> <p>Als Umstrukturierung des Rückzahlungsplans gelten jegliche stundungsbedingte, für den Rückzahlungsplan relevante Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen und den Zeitpunkt der Rückzahlung, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte, für den Rückzahlungsplan relevante Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
IVAL45	Umstrukturierte Risikopositionen (Fälligkeit)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, deren Fälligkeitsprofil vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurde.</p> <p>Als Umstrukturierung des Fälligkeitsprofils gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich der Verlängerung der Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte, für die Fälligkeit relevante Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
IVAL46	Umstrukturierte Risikopositionen (0 bis 1 Jahr vor Übertragung und keine neuen Rückstände)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor im letzten Jahr vor dem Datum der Übertragung auf oder Abtretung an die Verbriefungszweckgesellschaft umstrukturiert wurden UND im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 seit dem Datum der Umstrukturierung zu keinem Zeitpunkt Zahlungsrückstände (im Hinblick auf Kapital- oder Zinszahlungen) aufgewiesen haben.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAL47	Umstrukturierte Risikopositionen (keine neuen Rückstände)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt umstrukturiert wurden UND im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 seit dem Datum der Umstrukturierung zu keinem Zeitpunkt Zahlungsrückstände (im Hinblick auf Kapital- oder Zinszahlungen) aufgewiesen haben.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
IVAL48	Umstrukturierte Risikopositionen (neue Rückstände)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor zu einem beliebigen Zeitpunkt umstrukturiert wurden UND im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 seit dem Datum der Umstrukturierung zu einem beliebigen Zeitpunkt Zahlungsrückstände (im Hinblick auf Kapital- oder Zinszahlungen) aufgewiesen haben.</p> <p>Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA
IVAL49	Umstrukturierte Risikopositionen (Sonstige)	<p>Angabe des ausstehenden Gesamtkapitalsaldos für Risikopositionen dieser Art, die vom Originator/Sponsor im Sinne von Artikel 24 Absatz 9 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 umstrukturiert wurden, außer Umstrukturierungen, die bereits in den Feldern IVAL43, IVAL44 und IVAL45 erfasst wurden.</p> <p>Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.</p>	JA	JA

## ANHANG XII

INFORMATIONEN FÜR DEN ANLEGER — VERBRIEFUNG NICHT FORDERUNGSGEDECKTER  
GELDMARKTPAPIERE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu Verbriefungen				
IVSS1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
IVSS2	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung. Die Angabe muss mit dem Datenstichtag in den Meldebögen über die zugrunde liegende Risikoposition übereinstimmen.	NEIN	NEIN
IVSS3	Bezeichnung der Verbriefung	Angabe der Bezeichnung der Verbriefung.	NEIN	NEIN
IVSS4	Bezeichnung der meldenden Stelle	Vollständige juristische Bezeichnung der gemäß Artikel 7 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 benannten Einrichtung; diese Bezeichnung muss mit der Bezeichnung übereinstimmen, die für diese Einrichtung in Feld SESP3 (Abschnitt „Angaben zur Gegenpartei“) gemeldet wurde. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
IVSS5	Kontaktperson der meldenden Stelle	Vor- und Nachname der Kontaktpersonen, die für die Vorbereitung der Meldung dieser Verbriefungsdaten zuständig sind und an die Fragen zu dieser Datenmeldung zu richten sind.	NEIN	NEIN
IVSS6	Kontaktperson der meldenden Stelle — Telefonnummer	Telefonnummer (Durchwahl) der Kontaktpersonen, die für die Vorbereitung der Meldung dieser Verbriefungsdaten zuständig sind und an die Fragen zu dieser Datenmeldung zu richten sind.	NEIN	NEIN
IVSS7	Kontaktperson der meldenden Stelle — E-Mail	Direkte E-Mailadresse der Kontaktpersonen, die für die Vorbereitung der Meldung dieser Verbriefungsdaten zuständig sind und an die Fragen zu dieser Datenmeldung zu richten sind.	NEIN	NEIN
IVSS8	Verfahren des Risikselbstbehalts	Strategie zur Erfüllung der Anforderungen hinsichtlich des Risikselbstbehalts in der EU (z. B. Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 oder — bis zum Inkrafttreten — Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013): Vertikaler Anteil — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe a (VSLC) Anteil des Verkäufers — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe b (SLLS) Nach dem Zufallsprinzip ausgewählte Risikopositionen bleiben in der Bilanz — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe c (RSEX) Erstverlusttranche — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe d (FLTR) Erstverlusttranche in jedem Vermögenswert — d. h. Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe e (FLEX) Keine Einhaltung der Anforderungen hinsichtlich des Risikselbstbehalts (NCOM) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSS9	Träger des Risiko-selbstbehalts	Welche Stelle behält den materiellen Nettoanteil gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 oder — bis zum Inkrafttreten — Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013): Originator (ORIG) Sponsor (SPON) Ursprünglicher Kreditgeber (OLND) Verkäufer (SELL) Keine Einhaltung der Anforderungen hinsichtlich des Risiko-selbstbehalts (NCOM) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
IVSS10	Art der zugrunde liegenden Risikoposition	Angabe der Art der zugrunde liegenden Risikoposition der Verbriefung. Wenn mehrere Arten der nachstehenden Liste vorhanden sind, ist „Gemischt“ anzugeben (mit Ausnahme von Verbriefungen, deren zugrunde liegende Risikopositionen ausschließlich aus einer Kombination von Verbraucherkrediten und Kfz-Krediten oder Kfz-Leasing bestehen, für die „Verbraucherkredite“ anzugeben ist): Kfz-Kredite oder -Leasing (ALOL) Verbraucherkredite (CONL) Hypotheken auf Gewerbeimmobilien (CMRT) Kreditkartenforderungen (CCRR) Leasing (LEAS) Hypotheken auf Wohnimmobilien (RMRT) Gemischt (MIXD) Kredite an kleine und mittlere Unternehmen (SMEL) Kredite an Nicht-KMU-Unternehmen (NSML) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
IVSS11	Verfahren der Risikoübertragung	Im Hinblick auf die Risikoübertragung handelt es sich um eine „traditionelle Verbriefung“ im Sinne von Artikel 242 Nummern 13 und 14 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 („True-Sale“-Verbriefung).	NEIN	NEIN
IVSS12	Trigger-Bewertungen/Quoten	Ist im Zusammenhang mit der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag ein Trigger-Ereignis eingetreten (z. B. Zahlungsverzögerungen, Verwässerung, Ausfall, Verlust, Nicht-Substitution, Nicht-Revolveren oder ähnliche Ereignisse im Zusammenhang mit der Risikoposition, die sich auf die Verbriefung auswirken)? Darunter fallen auch PDL-Sollsalden (Principal Deficiency Ledger) oder Vermögenswert-Defizite.	NEIN	NEIN
IVSS13	Ende der revolving-Perioden/Anlaufphase	Angabe des Datums, an dem die revolving-Periode oder Anlaufphase der Verbriefung planmäßig endet. Bei revolving-Periode ohne planmäßiges Enddatum ist der Fälligkeitstermin der Verbriefung anzugeben.	NEIN	JA
IVSS14	Kapitalrückflüsse in der Periode	Während der Periode eingegangene Bruttokapitalrückflüsse. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSS15	Zinsrückflüsse in der Periode	Während der Periode eingegangene Bruttozinsrückflüsse. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
IVSS16	Kapitaleingänge in der Periode	Eingänge in der Periode, die als Kapital behandelt werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
IVSS17	Zinseingänge in der Periode	Eingänge in der Periode, die als Einnahmen behandelt werden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
IVSS18	Ziehungen im Rahmen der Liquiditätsfazilität	Wenn die Verbriefung mit einer Liquiditätsfazilität verbunden ist, Bestätigung, ob in dem Zeitraum, der am letzten Zinszahlungsdatum endet, eine Ziehung unter der Liquiditätsfazilität stattgefunden hat oder nicht.	NEIN	JA
IVSS19	Überschussmarge der Verbriefung	Angabe des Betrags der nach Anwendung aller derzeit geltenden Wasserfallphasen verbleibenden Mittel (sogenannte „Überschussmarge“). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
IVSS20	„Trapping“-Mechanismus für die Überschussmarge	Die Überschussmarge bleibt in der Verbriefung „gefangen“ (z. B. in einem gesonderten Rücklagenkonto).	NEIN	NEIN
IVSS21	Aktuelle Übersicherung	Aktuelle Übersicherung der Verbriefung, berechnet als Verhältnis zwischen (der Summe des zum Datenstichtag ausstehenden Kapitalsaldos aller zugrunde liegenden Risikopositionen ohne als ausgefallen eingestufte Risikopositionen) und (der Summe des zum Datenstichtag ausstehenden Kapitalsaldos aller Tranchen/Anleihen).	NEIN	NEIN
IVSS22	Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsrate	Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsquote (CPR) der zugrunde liegenden Risikopositionen basierend auf der letzten periodischen CPR. Die periodische CPR entspricht [(Summe der außerplanmäßigen Kapitalrückzahlungen bei Ende der letzten Einziehungsperiode)/(Gesamtkapitalsaldo bei Beginn der Einziehungsperiode)]. Die periodische CPR wird wie folgt annualisiert: $100 * (1 - ((1 - \text{Periodische CPR})^{\text{Anzahl der Einziehungsperioden in einem Jahr}}))$ „Periodische CPR“ bezeichnet die CPR in der letzten Einziehungsperiode, d. h. bei Verbriefungen mit vierteljährlicher Zahlung wird dies in der Regel die vorausgegangene Dreimonatsperiode sein.	NEIN	NEIN
IVSS23	Verwässerungen	Gesamtkapitalminderungen bei Risikopositionen in der Periode. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSS24	Bruttoausbuchungen in der Periode	Gesamtbetrag der Bruttoausbuchungen (d. h. vor Rückflüssen) für die Periode. Ausbuchung gemäß Festlegung in der Verbriefung oder alternativ gemäß üblicher Praxis des Kreditgebers. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
IVSS25	Zurückgekaufte Risikopositionen	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, die vom Originator/Sponsor zwischen dem unmittelbar vorhergehenden Datenstichtag und dem aktuellen Datenstichtag zurückgekauft wurden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVSS26	Umstrukturierte Risikopositionen	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, die vom Originator/Sponsor zwischen dem unmittelbar vorhergehenden Datenstichtag und dem aktuellen Datenstichtag umstrukturiert wurden. Als Umstrukturierung gelten jegliche stundungsbedingte Änderungen der vertraglichen Bedingungen der Vereinbarung über die zugrunde liegende Risikoposition, einschließlich Änderungen in Bezug auf Zahlungsunterbrechungen, die Kapitalisierung von Rückständen, Zinssatzbasis oder Zinsmargen, Gebühren, Vertragsstrafen und Fälligkeit, und/oder andere allgemein anerkannte stundungsbedingte Umstrukturierungsmaßnahmen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
IVSS27	Annualisierte konstante Ausfallquote	Annualisierte konstante Ausfallquote (CDR) der zugrunde liegenden Risikopositionen, basierend auf der letzten periodischen CDR. Die periodische CDR entspricht [(aktueller Gesamtsaldo der in der Periode als ausgefallen eingestuft zugrunde liegenden Risikopositionen)/(aktueller Gesamtsaldo der bei Beginn der Periode nicht ausgefallenen zugrunde liegenden Risikopositionen)]. Dieser Wert wird wie folgt annualisiert: $100 * (1 - ((1 - \text{Periodische CDR})^{\text{Anzahl der Einziehungsperioden in einem Jahr}}))$ „Periodische CDR“ bezeichnet die CDR in der letzten Einziehungsperiode, d. h. bei Verbriefungen mit vierteljährlicher Zahlung wird dies in der Regel die vorausgegangene Dreimonatsperiode sein.	NEIN	NEIN
IVSS28	Ausgefallene Risikopositionen	Zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag der zum Datenstichtag ausgefallenen Risikopositionen auf der Grundlage der in den Verbriefungsunterlagen enthaltenen Ausfalldefinition. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
IVSS29	Ausgefallene Risikopositionen im Sinne der Eigenmittelverordnung	Zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag der zum Datenstichtag ausgefallenen Risikopositionen auf der Grundlage der Ausfalldefinition gemäß Artikel 178 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSS30	Risikogewichtungsansatz	Angabe des vom Originator verwendeten Risikogewichtungsansatzes zur Ermittlung des Risikogewichts der zugrunde liegenden Risikopositionen gemäß der Verordnung (EU) Nr. 575/2013: Standardansatz (STND) Basis-IRB-Ansatz (FIRB) Fortgeschrittener IRB-Ansatz (ADIR)	NEIN	JA
IVSS31	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [0,00 %,0,10 %)	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, deren Ausfallwahrscheinlichkeit für das Folgejahr in einem Größenbereich von $0,00 \% \leq x < 0,10 \%$ veranschlagt wird. Diese Schätzung kann vom Originator oder der zuständigen nationalen Zentralbank vorgenommen werden. Ist die Berechnung der Ausfallwahrscheinlichkeit nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
IVSS32	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [0,10 %,0,25 %)	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, deren Ausfallwahrscheinlichkeit für das Folgejahr in einem Größenbereich von $0,10 \% \leq x < 0,25 \%$ veranschlagt wird. Diese Schätzung kann vom Originator oder der zuständigen nationalen Zentralbank vorgenommen werden. Ist die Berechnung der Ausfallwahrscheinlichkeit nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
IVSS33	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [0,25 %,1,00 %)	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, deren Ausfallwahrscheinlichkeit für das Folgejahr in einem Größenbereich von $0,25 \% \leq x < 1,00 \%$ veranschlagt wird. Diese Schätzung kann vom Originator oder der zuständigen nationalen Zentralbank vorgenommen werden. Ist die Berechnung der Ausfallwahrscheinlichkeit nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
IVSS34	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [1,00 %,7,50 %)	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, deren Ausfallwahrscheinlichkeit für das Folgejahr in einem Größenbereich von $1,00 \% \leq x < 7,50 \%$ veranschlagt wird. Diese Schätzung kann vom Originator oder der zuständigen nationalen Zentralbank vorgenommen werden. Ist die Berechnung der Ausfallwahrscheinlichkeit nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
IVSS35	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [7,50 %,20,00 %)	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, deren Ausfallwahrscheinlichkeit für das Folgejahr in einem Größenbereich von $7,50 \% \leq x < 20,00 \%$ veranschlagt wird. Diese Schätzung kann vom Originator oder der zuständigen nationalen Zentralbank vorgenommen werden. Ist die Berechnung der Ausfallwahrscheinlichkeit nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
IVSS36	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [20,00 %,100,00 %]	Ausstehender Gesamtkapitalbetrag zugrunde liegender Risikopositionen, deren Ausfallwahrscheinlichkeit für das Folgejahr in einem Größenbereich von $20,00 \% \leq x < 100,00 \%$ veranschlagt wird. Diese Schätzung kann vom Originator oder der zuständigen nationalen Zentralbank vorgenommen werden. Ist die Berechnung der Ausfallwahrscheinlichkeit nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSS37	Intern geschätzte Verlustquote bei Ausfall	Letzte vom Originator für die zugrunde liegende Risikoposition vorgenommene Schätzung der Verlustquote bei Ausfall in einem Abschwungsszenario, gewichtet anhand des zum Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalsaldos der ausstehenden zugrunde liegenden Risikopositionen. Ist die Berechnung der Verlustquote bei Ausfall nicht gesetzlich vorgeschrieben, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
IVSS38	Rückstände 1-29 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen dieser Art, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 1 und 29 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen dieser Art in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen dieser Art.	NEIN	NEIN
IVSS39	Rückstände 30-59 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 30 und 59 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen.	NEIN	NEIN
IVSS40	Rückstände 60-89 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 60 und 89 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen.	NEIN	NEIN
IVSS41	Rückstände 90-119 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 90 und 119 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen.	NEIN	NEIN
IVSS42	Rückstände 120-149 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 120 und 149 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSS43	Rückstände 150-179 Tage	Prozentsatz der Risikopositionen, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in einem Zeitraum zwischen 150 und 179 Tagen (einschließlich) fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen.	NEIN	NEIN
IVSS44	Rückstände 180+ Tage	Prozentsatz der Risikopositionen, bei denen zum Datenstichtag Zahlungsrückstände bei Kapital- und/oder Zinszahlungen bestehen, die in 180 Tagen und mehr fällig werden. Der Prozentsatz errechnet sich als zum Datenstichtag ausstehender Gesamtkapitalbetrag für Risikopositionen in dieser Rückstände-Kategorie in Relation zu dem am Datenstichtag ausstehenden Gesamtkapitalbetrag für alle Risikopositionen.	NEIN	NEIN

## Angaben zu Test/Ereignis/Trigger

IVSR1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld IVSS1.	NEIN	NEIN
IVSR2	Ursprüngliche Kennung für Test/Ereignis/Trigger	Ursprüngliche Kennung für Test/Ereignis/Trigger. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVSR3	Neue Kennung für Test/Ereignis/Trigger	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes IVSR2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in IVSR2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVSR4	Beschreibung	Beschreibung von Test/Ereignis/Trigger, einschließlich jeglicher Formeln. Dies ist ein Freitextfeld. Die Beschreibung sollte jedoch alle Formeln und wichtigen Definitionen enthalten, die es einem Anleger/potenziellen Anleger ermöglichen, sich ein vernünftiges Bild von Test/Ereignis/Trigger sowie den damit verbundenen Bedingungen und Folgen zu machen.	NEIN	NEIN
IVSR5	Schwellenwert	Angabe des Werts, bei dem je nach Art des gemeldeten Tests/Ereignisses/Triggers der Test als erfüllt bzw. der Trigger als ausgelöst bzw. eine andere Maßnahme als eingetreten gilt. Bei nicht numerischem Test/Ereignis/Trigger ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
IVSR6	Tatsächlicher Wert	Angabe des tatsächlichen Werts des Maßes, an das der Schwellenwert angelegt wird. Bei nicht numerischem Test/Ereignis/Trigger ist ND5 anzugeben. Prozentsätze sind als Prozentpunkte anzugeben, z. B. 99,50 für 99,50 % oder 0,006 für 0,006 %.	NEIN	JA
IVSR7	Status	Befindet sich Test/Ereignis/Trigger zum Datenstichtag im Status „Verstoß“ (d. h. der Test bzw. die Trigger-Bedingungen wurden nicht erfüllt)?	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSR8	Abhilfefrist	Angabe der Höchstzahl von Tagen, die gewährt werden, um diesen Test/Ereignis/Trigger wieder in Konformität mit dem geforderten Wert zu bringen. Wenn kein solcher Zeitraum gewährt wird (d. h. wenn es keine Abhilfefrist gibt), ist 0 anzugeben.	NEIN	JA
IVSR9	Berechnungshäufigkeit	Angabe der Anzahl der Kalendertage zwischen den Berechnungen des Tests. Verwendung runder Zahlen, d. h. 7 für wöchentlich, 30 für monatlich, 90 für vierteljährlich und 365 für jährlich.	NEIN	JA
IVSR10	Folgen von Verstößen	Angabe der in den Verbriefungsunterlagen vorgesehenen Folgen bei Problemen im Hinblick auf diese Tests/Ereignisse/Trigger (d. h. Verstoß): Änderung der Zahlungsrangfolge (CHPP) Ersatz einer Gegenpartei (CHCP) Sowohl Änderung der Zahlungsrangfolge als auch Ersatz einer Gegenpartei (BOTH) Sonstige Folgen (OTHR)	NEIN	NEIN

## Angaben zum Cashflow

IVSF1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld IVSS1.	NEIN	NEIN
IVSF2	Ursprüngliche Kennung des Cashflow-Postens	Ursprüngliche eindeutige Kennung des Cashflow-Postens. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVSF3	Neue Kennung des Cashflow-Postens	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes IVSF2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in IVSF2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVSF4	Cashflow-Posten	Auflistung des Cashflow-Postens. Dieses Feld ist in der Zahlungsrangfolge für Ein- oder Ausgänge zum Datenstichtag auszufüllen. Das heißt, jede Quelle von Mittelzuflüssen ist der Reihe nach aufzulisten, danach werden die Quellen von Mittelabflüssen aufgelistet.	NEIN	NEIN
IVSF5	In der Periode gezahlter Betrag	Welche Mittel wurden gemäß Zahlungsrangfolge für diesen Posten ausgezahlt? Ausgezählte Mittel sind als negativer Wert, eingegangene Mittel als positiver Wert auszuweisen. Der in einer bestimmten Zeile (z. B. Zeile B) ausgewiesene „in der Periode gezahlte Betrag“ zuzüglich der in der vorhergehenden Zeile (z. B. Zeile A) ausgewiesenen „verfügbaren Mittel“ ergeben zusammen die in dieser Zeile (z. B. Zeile B) ausgewiesenen „verfügbaren Mittel“. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVSF6	Verfügbare Mittel	Welche Mittel stehen für die Zahlungsrangfolge nach Anwendung des Cashflow-Postens zur Verfügung? Der in einer bestimmten Zeile (z. B. Zeile B) ausgewiesene „in der Periode gezahlte Betrag“ zuzüglich der in der vorhergehenden Zeile (z. B. Zeile A) ausgewiesenen „verfügbaren Mittel“ ergeben zusammen die in dieser Zeile (z. B. Zeile B) ausgewiesenen „verfügbaren Mittel“. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN

## ANHANG XIII

## INFORMATIONEN FÜR DEN ANLEGER — VERBRIEFUNG FORDERUNGSGEDECKTER GELDMARKTPAPIERE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zum Programm				
IVAS1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 diesem ABCP-Programm zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
IVAS2	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung.	NEIN	NEIN
IVAS3	Bezeichnung der meldenden Stelle	Vollständige juristische Bezeichnung der gemäß Artikel 7 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 benannten Einrichtung; diese Bezeichnung muss mit der Bezeichnung übereinstimmen, die für diese Einrichtung in Feld SEAP3 (Abschnitt „Angaben zur Gegenpartei“) gemeldet wurde. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
IVAS4	Kontaktperson der meldenden Stelle	Vor- und Nachname der Kontaktpersonen, die für die Vorbereitung der Meldung dieser Verbriefungsdaten zuständig sind und an die Fragen zu dieser Datenmeldung zu richten sind.	NEIN	NEIN
IVAS5	Kontaktperson der meldenden Stelle — Telefonnummer	Telefonnummer (Durchwahl) der Kontaktpersonen, die für die Vorbereitung der Meldung dieser Verbriefungsdaten zuständig sind und an die Fragen zu dieser Datenmeldung zu richten sind.	NEIN	NEIN
IVAS6	Kontaktperson der meldenden Stelle — E-Mail	Direkte E-Mailadresse der Kontaktpersonen, die für die Vorbereitung der Meldung dieser Verbriefungsdaten zuständig sind und an die Fragen zu dieser Datenmeldung zu richten sind.	NEIN	NEIN
IVAS7	Trigger-Bewertungen/Quoten	Ist im Zusammenhang mit der zugrunde liegenden Risikoposition zum Datenstichtag ein Trigger-Ereignis eingetreten (z. B. Zahlungsverzüge, Verwässerung, Ausfall, Verlust, Nicht-Substitution, Nicht-Revolvern oder ähnliche Ereignisse im Zusammenhang mit der Risikoposition, die sich auf die Verbriefung auswirken)? Darunter fallen auch PDL-Sollsalden (Principal Deficiency Ledger) oder Vermögenswert-Defizite.	NEIN	JA
IVAS8	Nicht konforme Risikopositionen	Gemäß Artikel 26 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 Angabe des Gesamtbetrags der Risikopositionen, ausgedrückt als aktueller Saldo zum Datenstichtag, die gegen die Anforderungen von Artikel 24 Absätze 9, 10 und 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 verstoßen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	JA	JA
IVAS9	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit	Angabe der gewichteten durchschnittlichen Restlaufzeit des diesem ABCP-Programm zugrunde liegenden Pools an Risikopositionen, ausgedrückt in Jahren.	JA	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAS10	Verfahren des Risiko-selbstbehalts	Strategie zur Erfüllung der Anforderungen hinsichtlich des Risiko-selbstbehalts in der EU (z. B. Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 oder — bis zum Inkrafttreten — Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013): Vertikaler Anteil — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe a (VSLC) Anteil des Verkäufers — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe b (SLLS) Nach dem Zufallsprinzip ausgewählte Risikopositionen bleiben in der Bilanz — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe c (RSEX) Erstverlusttranche — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe d (FLTR) Erstverlusttranche in jedem Vermögenswert — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe e (FLEX) Keine Einhaltung der Anforderungen hinsichtlich des Risiko-selbstbehalts (NCOM) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
IVAS11	Träger des Risiko-selbstbehalts	Welche Stelle behält den materiellen Nettoanteil gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 oder — bis zum Inkrafttreten — Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013): Originator (ORIG) Sponsor (SPON) Ursprünglicher Kreditgeber (OLND) Verkäufer (SELL) Keine Einhaltung der Anforderungen hinsichtlich des Risiko-selbstbehalts (NCOM) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

## Angaben zur Transaktion

IVAN1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung des ABCP-Programms wie in Feld IVAS1.	NEIN	NEIN
IVAN2	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 dieser ABCP-Transaktion zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
IVAN3	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung. Die Angabe muss mit dem Datenstichtag übereinstimmen, der in den Meldebögen gemäß Anhang XI für die zugrunde liegende Risikoposition angegeben wurde.	NEIN	NEIN
IVAN4	NACE-Branchencode	NACE-Branchencode des Originators gemäß der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006.	NEIN	JA
IVAN5	Verfahren des Risiko-selbstbehalts	Strategie zur Erfüllung der Anforderungen hinsichtlich des Risiko-selbstbehalts in der EU (z. B. Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 oder — bis zum Inkrafttreten — Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013): Vertikaler Anteil — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe a (VSLC)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Anteil des Verkäufers — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe b (SLLS)</p> <p>Nach dem Zufallsprinzip ausgewählte Risikopositionen bleiben in der Bilanz — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe c (RSEX)</p> <p>Erstverlusttranche — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe d (FLTR)</p> <p>Erstverlusttranche in jedem Vermögenswert — Artikel 6 Absatz 3 Buchstabe e (FLEX)</p> <p>Keine Einhaltung der Anforderungen hinsichtlich des Risikoseibstbehalts (NCOM)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>		
IVAN6	Träger des Risikoseibstbehalts	<p>Welche Stelle behält den materiellen Nettoanteil gemäß Artikel 6 der Verordnung (EU) 2017/2402 oder — bis zum Inkrafttreten — Artikel 405 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013):</p> <p>Originator (ORIG)</p> <p>Sponsor (SPON)</p> <p>Ursprünglicher Kreditgeber (OLND)</p> <p>Verkäufer (SELL)</p> <p>Keine Einhaltung der Anforderungen hinsichtlich des Risikoseibstbehalts (NCOM)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	JA
IVAN7	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit	Angabe der gewichteten durchschnittlichen Restlaufzeit des dieser Transaktion zugrunde liegenden Pools an Risikopositionen, ausgedrückt in Jahren.	JA	JA

## Angaben zu Test/Ereignis/Trigger

IVAR1	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung der Transaktion wie in Feld IVAN2.	NEIN	NEIN
IVAR2	Ursprüngliche Kennung für Test/Ereignis/Trigger	Ursprüngliche Kennung für Test/Ereignis/Trigger. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVAR3	Neue Kennung für Test/Ereignis/Trigger	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes IVAR2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in IVAR2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
IVAR4	Beschreibung	Beschreibung von Test/Ereignis/Trigger, einschließlich jeglicher Formeln. Dies ist ein Freitextfeld. Die Beschreibung sollte jedoch alle Formeln und wichtigen Definitionen enthalten, die es einem Anleger/potenziellen Anleger ermöglichen, sich ein vernünftiges Bild von Test/Ereignis/Trigger sowie den damit verbundenen Bedingungen und Folgen zu machen.	NEIN	NEIN
IVAR5	Status	Wurde der Test zum Datenstichtag erfüllt? Wurde ein Trigger ausgelöst?	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
IVAR6	Folgen von Verstößen	Angabe der in den Verbriefungsunterlagen vorgesehenen Folgen bei Problemen im Zusammenhang im Zusammenhang mit diesen Tests/Ereignissen/Triggern (d. h. Verstoß): Änderung der Zahlungsrangfolge (CHPP) Ersatz einer Gegenpartei (CHCP) Sowohl Änderung der Zahlungsrangfolge als auch Ersatz einer Gegenpartei (BOTH) Sonstige Folgen (OTHR)	NEIN	NEIN

## ANHANG XIV

## INSIDERINFORMATIONEN ODER ANGABEN ZU SIGNIFIKANTEN EREIGNISSEN — VERBRIEFUNG NICHT FORDERUNGSGEDECKTER GELDMARKTPAPIERE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zu Verbriefungen				
SESS1	Eindeutige Kennung	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
SESS2	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung. Wenn die Daten zusammen mit Daten über zugrunde liegende Risikopositionen und Anlegerberichte übermittelt werden, muss dieses Datum mit dem Datenstichtag übereinstimmen, der in den Meldebögen für die zugrunde liegende Risikoposition und den Anlegerbericht angegeben wurde.	NEIN	NEIN
SESS3	Nicht mehr STS	Erfüllt die Verbriefung nicht mehr die STS-Anforderungen? Wenn die Verbriefung nie STS-Status hatte, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SESS4	Abhilfemaßnahmen	Haben zuständige Behörden in Bezug auf diese Verbriefung Abhilfemaßnahmen ergriffen? Ist die Verbriefung keine STS-Verbriefung, so ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SESS5	Administrative Schritte	Haben zuständige Behörden administrative Schritte in Bezug auf diese Verbriefung unternommen? Ist die Verbriefung keine STS-Verbriefung, so ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SESS6	Wesentliche Änderung der Unterlagen der Transaktion.	Beschreibung wesentlicher Änderungen an den Transaktionsunterlagen, einschließlich Bezeichnung und Positionscode (gemäß Anhang I Tabelle 3), sowie ausführliche Beschreibung der Änderungen.	NEIN	JA
SESS7	Verkaufsabschluss	Ist die Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf die Verbriefungszweckgesellschaft im Sinne von Artikel 20 Absatz 5 der Verordnung (EU) 2017/2402 (d. h. Abschluss des Verkaufs) nach Abschlussdatum der Verbriefung erfolgt?	NEIN	JA
SESS8	Aktuelle Art des Wasserfalls	Wählen Sie aus der nachstehenden Liste die am besten zutreffende, derzeit auf die Verbriefung anwendbare Wasserfallregelung aus: Turbo-Wasserfall (TRWT) Sequentieller Wasserfall (SQWT) Pro-Rata-Wasserfall (PRWT) Derzeit sequentiell, mit Möglichkeit eines Übergangs auf Pro-Rata (SQPR) Derzeit Pro-Rata, mit Möglichkeit eines Übergangs auf sequentiell (PRSQ) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESS9	Art der Master-Trust-Struktur	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Auswahl der am besten zutreffenden Beschreibung:  Jede Verbriefungszweckgesellschaft entscheidet unabhängig von anderen Verbriefungszweckgesellschaften über Emissionen und Ausschüttungen („kapitalistische Struktur“) (CSTR).  Verluste werden auf alle Verbriefungszweckgesellschaften verteilt und einzelne Kategorien von Papieren werden unabhängig von der Emission vorrangigerer oder nachrangigerer Klassen emittiert („sozialistische Struktur“ oder „entkoppelter Master Trust“) (SSTR).  Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SESS10	Wert der Verbriefungszweckgesellschaft	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe des Nennwerts aller zugrunde liegenden Risikopositionen (Kapital und Belastungen), an denen der Trust oder die Verbriefungszweckgesellschaft am Datenstichtag Eigentumsansprüche haben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESS11	Kapitalwert der Verbriefungszweckgesellschaft	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe des Nennwerts aller zugrunde liegenden Risikopositionen (nur Kapital), an denen der Trust am Datenstichtag Eigentumsansprüche hat. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESS12	Verbriefungszweckgesellschaft — Anzahl der Konten	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe der Anzahl der Konten, an denen der Trust oder die Verbriefungszweckgesellschaft am Datenstichtag Eigentumsansprüche haben.	NEIN	JA
SESS13	Kapitalsaldo der Schuldtitel	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe des Nennwerts aller forderungsbesicherten Schuldtitel, die durch die zugrunde liegenden Risikopositionen im Trust abgesichert sind. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESS14	Anteil des Verkäufers	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe der Ansprüche des Originators, ausgedrückt als Prozentzahl. Im Falle mehrerer Originatoren ist die Summe der Ansprüche für sämtliche Originatoren anzugeben.	NEIN	JA
SESS15	Finanzierungsanteil	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe der Ansprüche der Verbriefungszweckgesellschaft an dieser Serie im Trust zur Datenstichtag, ausgedrückt als Prozentzahl.	NEIN	JA
SESS16	Dieser Serie zugewiesene Einnahmen	Bei Verbriefungen mit Master-Trust-Struktur Angabe der vom Trust dieser Serie zugewiesenen Einnahmen. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESS17	Referenzzinssatz des Zinsswaps	Beschreibung der Art des Referenzzinssatzes, an den die zahlende Komponente des Swaps gekoppelt ist:  MuniAAA (MAAA)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
SESS18	Fälligkeit des Zinsswaps	Fälligkeitstermin des Zinsswaps.	NEIN	JA
SESS19	Nominalbetrag des Zinsswaps	Nominalbetrag des Zinsswaps zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESS20	Währung der zahlenden Komponente des Währungsswaps	Angabe der von der zahlenden Komponente des Swaps genutzten Währung.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESS21	Währung der empfangenden Komponente des Währungsswaps	Angabe der von der empfangenden Komponente des Swaps genutzten Währung.	NEIN	JA
SESS22	Wechselkurs des Währungsswaps	Wechselkurs, der für einen Währungsswap festgelegt wurde	NEIN	JA
SESS23	Fälligkeit des Währungsswaps	Fälligkeitstermin des Währungsswaps.	NEIN	JA
SESS24	Nominalbetrag des Währungsswaps	Nominalbetrag des Währungsswaps zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

## Angaben zu Tranche/Anleihe

SEST1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
SEST2	Ursprüngliche Kennung der Tranche	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die dem Instrument zugewiesen wurde. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SEST3	Neue Kennung der Tranche	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes SEST2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in Feld SEST2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SEST4	Internationale Wertpapierkennnummer	Sofern anwendbar, ISIN-Code dieser Tranche.	NEIN	JA
SEST5	Bezeichnung der Tranche	Bezeichnung (üblicherweise ein Buchstabe und/oder eine Zahl) dieser Anleihe (oder Wertpapiergattung) mit den gleichen Rechten, Prioritäten und Eigenschaften wie im Prospekt festgelegt, d. h. Serie 1 Klasse A1 usw.	NEIN	JA
SEST6	Art der Tranche/Anleihe	Auswahl der am besten zutreffenden Beschreibung des Rückzahlungsprofils des Instruments: Hard bullet (d. h. fester Fälligkeitstermin) (HBUL) Soft bullet (d. h. geplanter Fälligkeitstermin kann bis zum gesetzlichen Fälligkeitstermin verlängert werden) (SBUL) Planmäßige Tilgung (d. h. Rückzahlung des Kapitalbetrags an planmäßigen Tilgungsdaten) (SAMO) Kontrollierte Tilgung (d. h. Kapitalrückzahlung ab einem spezifischen Zeitpunkt) (CMM) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SEST7	Währung	Währung, auf die das Instrument lautet.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEST8	Ursprünglicher Kapitalsaldo	Ursprünglicher Kapitalsaldo dieser Tranche bei Emission. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEST9	Aktueller Kapitalsaldo	Nennwert dieser Tranche nach dem aktuellen Kapitalrückzahlungsdatum Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEST10	Zinszahlungshäufigkeit	Häufigkeit, mit der bei diesem Instrument Zinsen fällig sind: Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SEST11	Zinszahlungsdatum	Erstes Datum nach Meldung des Datenstichtags, an dem die Ausschüttung von Zinszahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist.	NEIN	JA
SEST12	Kapitalrückzahlungsdatum	Erstes Datum nach Meldung des Datenstichtags, an dem die Ausschüttung von Kapitalrückzahlungen an Inhaber von Anleihen dieser Tranche geplant ist.	NEIN	JA
SEST13	Aktueller Kupon	Kupon des Instruments in Basispunkten.	NEIN	NEIN
SEST14	Aktuelle Zinsmarge/Kupon-Spread	Kupon-Spread auf den Referenzzinsindex gemäß der Festlegung in den Angebotsunterlagen für dieses spezifische Instrument in Basispunkten.	NEIN	JA
SEST15	Kupon-Untergrenze	Kupon-Untergrenze des Instruments.	NEIN	JA
SEST16	Kupon-Obergrenze	Kupon-Obergrenze des Instruments.	NEIN	JA
SEST17	Betrag des Step-Up/Step-Down-Kupons	Gegebenenfalls Angabe des Werts des „Step-Up/Step-Down“-Kupons gemäß den Modalitäten der Verbriefung/des Programms.	NEIN	JA
SEST18	Datum des Step-Up/Step-Down-Kupons	Gegebenenfalls Angabe des Datums, an dem sich der Kupon gemäß den Modalitäten der Verbriefung/des Programms ändert.	NEIN	JA
SEST19	Geschäftstagekonvention	Für die Berechnung der fälligen Zinsen verwendete Geschäftstagekonvention: Nächster Geschäftstag (FWNG) Nächster Geschäftstag — modifiziert (MODF) Nächstliegender Geschäftstag (NEAR) Vorausgegangener Geschäftstag (PREC) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEST20	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SEST21	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)		
SEST22	Emissionsdatum	Datum, an dem dieses Instrument emittiert wurde.	NEIN	NEIN
SEST23	Auszahlungsdatum	Angabe des ersten Tags, an dem der auf das Instrument zu zahlenden Zinsbetrag berechnet wird.	NEIN	JA
SEST24	Gesetzliche Fälligkeit	Datum, bis zu dem dieses Instrument zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten.	NEIN	JA
SEST25	Verlängerungsklausel	Auswahl der am besten zutreffenden Option zur Angabe der Partei, die gemäß den Bedingungen der Verbriefung/des Programms das Recht hat, die Laufzeit des Instruments zu verlängern: Nur Verbriefungszweckgesellschaft (ISUR) Investor (NHLI) Verbriefungszweckgesellschaft oder Investor (ISNH) Keine Option (NOPT)	NEIN	JA
SEST26	Nächstes Datum für Kaufoption („Call“)	Angabe des nächsten Datums, an dem gemäß den Modalitäten der Verbriefung/des Programms eine Kaufoption auf das Instrument ausgeübt werden kann. Hierunter fallen nicht Rückführungsvereinbarungen.	NEIN	JA
SEST27	Schwellenwert für Rückführungsaufruf	Angabe des Schwellenwerts für Rückführungsaufrufe gemäß den Modalitäten der Verbriefung/des Programms.	NEIN	JA
SEST28	Nächstes Datum für Verkaufsoption („Put“)	Angabe des nächsten Datums, an dem gemäß den Modalitäten der Verbriefung/des Programms eine Verkaufsoption ausgeübt werden kann.	NEIN	JA
SEST29	Zinsberechnungsmethode	„Tage“-Vereinbarung zur Berechnung der Zinsen: 30/360 (A011) act/365 (A005) act/360 (A004) act/act ICMA (A006) act/act ISDA (A008) act/act AFB (A010) act/366 (A009) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEST30	Abrechnungsregelung	<p>Übliche Abrechnungsregelung für die Tranche:</p> <p>T Plus eins (TONE)</p> <p>T Plus zwei (TTWO)</p> <p>T Plus drei (TTRE)</p> <p>So bald wie möglich (ASAP)</p> <p>Bei Vertragsende (ENDC)</p> <p>Ende des Monats (MONT)</p> <p>Künftig (FUTU)</p> <p>Nächster Tag (NXTD)</p> <p>Regelmäßig (REGU)</p> <p>T Plus fünf (TFIV)</p> <p>T Plus vier (TFOR)</p> <p>Bei Emission (sofern emittiert) (WHIF)</p> <p>Bei Verteilung (WDIS)</p> <p>Bei Emission (WISS)</p> <p>Bei Emission oder Verteilung (WHID)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>	NEIN	JA
SEST31	Derzeitiger oberer Tranchierungspunkt	Derzeitiger oberer Tranchierungspunkt (Attachment Point), berechnet gemäß Artikel 256 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, multipliziert mit 100.	NEIN	NEIN
SEST32	Ursprünglicher oberer Tranchierungspunkt	Oberer Tranchierungspunkt bei Ausgabe der Papiere, berechnet nach Artikel 256 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013, multipliziert mit 100.	NEIN	JA
SEST33	Aktuelle Bonitätsverbesserung	Aktuelle Bonitätsverbesserung der Tranche, berechnet gemäß Festlegung von Originator/Sponsor/Verbriefungszweckgesellschaft.	NEIN	NEIN
SEST34	Ursprüngliche Bonitätsverbesserung	Bonitätsverbesserung der Tranche bei Ausgabe der Papiere, berechnet gemäß Festlegung von Originator/Sponsor/Verbriefungszweckgesellschaft.	NEIN	JA
SEST35	Bonitätsverbesserungsformel	Beschreibung/Angabe der Formel zur Berechnung der Bonitätsverbesserung der Tranche.	NEIN	NEIN
SEST36	Pari-Passu-Tranchen	Angabe der ISIN aller Tranchen (einschließlich dieser), die zum Datenstichtag gemäß der zum Datenstichtag geltenden Zahlungsrangfolge der Verbriefung den gleichen Rang haben wie die derzeitige Tranche. Im Falle mehrerer ISIN sind sämtliche ISIN im XML-Schema anzugeben.	NEIN	JA
SEST37	Vorrangige Tranchen	Angabe der ISIN aller Tranchen, die zum Datenstichtag gemäß der zum Datenstichtag geltenden Zahlungsrangfolge der Verbriefung Vorrang vor der derzeitigen Tranche haben. Im Falle mehrerer ISIN sind sämtliche ISIN im XML-Schema anzugeben.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEST38	Ausstehender PDL-Saldo (Principal Deficiency Ledger)	Ausstehender PDL-Saldo der betreffenden Tranche. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEST39	Rechtsträgerkennung des Garantiegebers	Bei garantierten Tranchen Angabe der Rechtsträgerkennung des Garantiegebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)). Falls nicht garantiert, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
SEST40	Name des Garantiegebers	Vollständige juristische Bezeichnung des Garantiegebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen. Falls nicht garantiert, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
SEST41	ESVG-Teilsektor des Garantiegebers	ESVG-2010-Klassifizierung des Garantiegebers gemäß der Verordnung (EG) Nr. 549/2013 („ESVG 2010“). Dieser Eintrag muss auf der Ebene der Teilsektoren erfolgen. Dabei ist einer der in Tabelle 1 des Anhangs I angegebenen Werte zu verwenden. Falls nicht garantiert, ist ND5 einzugeben.	NEIN	JA
SEST42	Art der Sicherung	Angabe der Art des verwendeten Sicherungsinstruments: Kreditausfallswap (CDSX) Synthetische Unternehmensanleihen (CLKN) Gesamtertragsswap (TRES) Finanzgarantie (Kreditrisikominderung ohne Sicherheitsleistung) (FGUA) Kreditversicherung (CINS) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

## Angaben zum Konto

SESA1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
SESA2	Ursprüngliche Kennung des Kontos	Ursprüngliche Kennung des Kontos. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SESA3	Neue Kennung des Kontos	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes SESA2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in SESA2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SESA4	Kontotyp	Kontotyp: Rücklagenkonto („Barreserve“) (CARE) „Commingling Reserve“-Konto (CORE) Verrechnungskonto („Set-off Reserve“) (SORE) Liquiditätsfazilität (LQDF) Marginkonto („Margin Account“) (MGAC) Sonstiges Konto (OTHR)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESA5	Zielsaldo	Höhe der Mittel, die bei voller Finanzierung gemäß den Verbriefungsunterlagen auf dem betreffenden Konto eingezahlt wären. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESA6	Tatsächlicher Saldo	Saldo der Einlagen auf dem betreffenden Konto am Periodenende. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESA7	Amortisationskonto	Amortisiert das Konto während der Laufzeit der Verbriefung?	NEIN	NEIN

## Angaben zur Gegenpartei

SESP1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
SESP2	Rechtsträgerkennung der Gegenpartei	Angabe der Rechtsträgerkennung der Gegenpartei (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
SESP3	Name der Gegenpartei	Vollständige juristische Bezeichnung der Gegenpartei. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
SESP4	Art der Gegenpartei	Art der Gegenpartei: Kontoführende Bank (ABNK) Backup-Konto-Bank (ABNK) Kontoführende Bank — Vermittler (ABFC) Kontoführende Bank — Garantiegeber (ABGR) Sicherheitenverwalter (COLL) Zahlstelle (PAYA) Berechnungsstelle (CALC) Verwaltungsstelle (ADMI) Verwaltungsunterbeauftragter (ADSA) Transferstelle (RANA) Verifizierungsstelle (VERI) Sicherheitsstelle (SECU) Anbieter von Kassenvorschüssen (CAPR) Sicherungsgeber (COLL) Anbieter von garantierten Beteiligungsverträgen (GICP) Darlehensanbieter für Versicherungspolicen (IPCP) Anbieter von Liquiditätsfazilitäten (LQFP) Anbieter von Backup-Liquiditätsfazilitäten (BLQP) Sparhypotheken-Partei (SVMP) Emittent (ISSR)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Originator (ORIG) Verkäufer (SELL) Sponsor der Verbriefungszweckgesellschaft (SSSP) Servicer (SERV) Backup-Servicer (BSER) Backup-Servicer — Vermittler (BSRF) Special Servicer (SSRV) Zeichner (SUBS) Zinsswap-Anbieter (IRSP) Backup-Zinsswap-Anbieter (BIPR) Währungsswap-Anbieter (CSPR) Backup-Währungsswap-Anbieter (CSPR) Abschlussprüfer (AUDT) Berater (CNSL) Treuhänder (TRUS) Investoren-Vertreter (REPN) Zeichner (UNDR) Arrangeur (ARRG) Händler (DEAL) Manager (MNGR) Kreditbrief-Aussteller (LCPR) Multi-Seller-Conduit (MSCD) Verbriefungszweckgesellschaft (SSPE) Liquiditäts- oder Liquidationsstelle (LQAG) Anteilseigner des Conduit/der Verbriefungszweckgesellschaft (EQOC) Anbieter kurzfristiger Deckungslinien (SWNG) Anlaufkredit- oder Leasing-Anbieter (SULP) Repogeschäft-Gegenpartei (RAGC) Cash-Manager (CASM) Einzugskontobank (CACB) Sicherheitenkontobank (COLA) Anbieter von nachrangigen Darlehen (SBLP) CLO-Manager (CLOM) Portfolioberater (PRTA) Substitutionsstelle (SUBA) Sonstige (OTHR)		
SESP5	Niederlassungsland der Gegenpartei	Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESP6	Ratingschwelle für die Gegenpartei	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier die Ratingschwelle für die Gegenpartei zum Datenstichtag anzugeben. Im Falle mehrerer Ratings sind sämtliche Ratings im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SESP7	Rating der Gegenpartei	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier das Rating der Gegenpartei zum Datenstichtag anzugeben. Im Falle mehrerer Ratingschwellen sind sämtliche Ratingschwellen im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SESP8	Rechtsträgerkennung der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier die Rechtsträgerkennung der die Gegenpartei bewertenden Stelle (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)) zum Datenstichtag anzugeben. Im Falle mehrerer Ratings sind die Rechtsträgerkennungen sämtlicher Ratings vornehmender Stellen im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SESP9	Name der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier die vollständige Bezeichnung des Anbieters des Gegenpartei-Ratings zum Datenstichtag anzugeben. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen. Im Falle mehrerer Ratings sind die Rechtsträgerkennungen sämtlicher Ratings vornehmender Stellen im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA

## Angaben zur CLO-Verbriefung

SESC1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
SESC2	Ende der Kündigungssperrfrist	Angabe des Datums, an dem eine Kündigungssperrfrist (während der es z. B. Inhabern einer Tranche untersagt ist, von der Verbriefungszweckgesellschaft die Liquidierung des Portfolios und die Rückzahlung sämtlicher Tranchen oder die Rückstellung oder Refinanzierung von Tranchen usw. zu verlangen) endet.	NEIN	JA
SESC3	CLO-Typ	Angabe des CLO-Typs, der diese Transaktion am besten beschreibt: Bilanz-CLO (BCLO) Arbitrage-CLO (ACLO) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESC4	Laufende Periode	Status der laufenden CLO-Periode: Warehouse (WRHS) Anlaufphase (RMUP) Reinvestition (RINV) Post-Reinvestition (PORI) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SESC5	Beginn der laufenden Periode	Angabe des Datums, an dem die laufende Periode begonnen hat.	NEIN	JA
SESC6	Ende der laufenden Periode	Angabe des Datums, an dem die laufende Periode ausläuft/voraussichtlich ausläuft.	NEIN	JA
SESC7	Konzentrationsbegrenzung	Angabe der in den Transaktionsunterlagen festgelegten und für alle Gegenparteien/Schuldner geltenden Konzentrationsbegrenzung, ausgedrückt als prozentualer Anteil am Portfolio-Nennwert. Bei Mehrfachbegrenzungen ist der höchste Wert anzugeben (z. B. Angabe von 20 %, wenn es je nach Rating zwei Begrenzungen von 10 % und 20 % gibt).	NEIN	JA
SESC8	Beschränkungen — rechtliche Fälligkeit	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von Risikopositionen, deren rechtlicher Endfälligkeitstermin die kürzeste rechtliche Endfälligkeit der Tranchen überschreitet (unter Annahme eines Rückführungsaufrufs).	NEIN	JA
SESC9	Beschränkungen — nachrangige Risikopositionen	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von nicht erstrangigen Sicherungsrechten, die gekauft werden können.	NEIN	JA
SESC10	Beschränkungen — notleidende Risikopositionen	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von notleidenden Risikopositionen, die gekauft werden können.	NEIN	JA
SESC11	Beschränkungen — PIK-Risikopositionen	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von in Sachwerten zahlbaren Risikopositionen, die gehalten werden dürfen.	NEIN	JA
SESC12	Beschränkungen — Nullkupon-Risikopositionen	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von Nullkupon-Risikopositionen, die gehalten werden dürfen.	NEIN	JA
SESC13	Beschränkungen — Eigenkapital-Risikopositionen	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von Eigenkapital-Positionen oder in Eigenkapital umwandelbaren Schuldtiteln, die gekauft werden können.	NEIN	JA
SESC14	Beschränkungen — Beteiligungen	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von Beteiligungsdarlehen, die gekauft werden können.	NEIN	JA
SESC15	Beschränkungen — diskretionäre Verkäufe	Zulässiger Prozentsatz (gemessen am Portfolio-Nennwert) von diskretionären Verkäufen pro Jahr.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESC16	Diskretionäre Verkäufe	Tatsächliche diskretionäre Verkäufe, Jahr bis dato. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESC17	Reinvestitionen	Reinvestierte Beträge, Jahr bis dato. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESC18	Beschränkungen — Bonitätsverbesserung	Möglichkeit des CLO-Managers, überschüssige Bonitätsverbesserungen rückgängig zu machen oder zu veräußern.	NEIN	NEIN
SESC19	Beschränkungen — Kursofferten	Möglichkeit des CLO-Managers, Kursofferten von anderen Händlern als dem Arrangeur einzuholen.	NEIN	NEIN
SESC20	Beschränkungen — Handel	Möglichkeit des CLO-Managers für den Handel mit anderen Händlern als dem Arrangeur.	NEIN	NEIN
SESC21	Beschränkungen — Emissionen	Beschränkungen hinsichtlich zusätzlicher Schuldtitel-Emissionen.	NEIN	NEIN
SESC22	Beschränkungen — Rückzahlungen	Beschränkungen hinsichtlich der Herkunft von Mitteln für selektive Rückkäufe/Rückzahlungen (z. B. Verbot der Verwendung von Kapitalerlösen für Rückzahlungen; Auflage, dass alle Rückzahlungen in der Zahlungsrangfolge erfolgen; Auflage der Erhaltung oder Verbesserung der OC-Quote nach Kauf).	NEIN	NEIN
SESC23	Beschränkungen — Refinanzierung	Angabe jeglicher Beschränkungen hinsichtlich der Refinanzierung von Schuldtiteln.	NEIN	NEIN
SESC24	Beschränkungen — Vergütung von Schuldtiteln	Möglichkeit der Investoren zur Übergabe ihrer Schuldtitel an den Treuhänder zur Annullierung der Schuld ohne entsprechende Entschädigungszahlung.	NEIN	NEIN
SESC25	Beschränkungen — Kreditbesicherung	Möglichkeit des CLO-Managers zum Kauf oder Verkauf von Kreditbesicherungen für zugrunde liegende Vermögenswerte.	NEIN	NEIN
SESC26	Zeitraum für die Liquidation von Sicherheiten	Angabe der Anzahl der Kalendertage bis zur verpflichteten Liquidation der Sicherheiten. Im Falle einer Zeitspanne oder mehrerer möglicher Zeiträume ist die Mindestzahl von Kalendertagen anzugeben.	NEIN	JA
SESC27	Liquidation von Sicherheiten — Ausnahmen	Möglichkeit von Ausnahmen vom Zeitraum für die Liquidation von Sicherheiten für bestimmte oder alle Investoren.	NEIN	NEIN

## Angaben zum CLO-Manager

SESL1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
SESL2	Rechtsträgerkennung des CLO-Managers	Angabe der Rechtsträgerkennung des CLO-Managers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESL3	Name des Managers	Vollständige juristische Bezeichnung des CLO-Managers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
SESL4	Datum der Niederlassung	Datum der Eintragung/Niederlassung des CLO-Managers.	NEIN	JA
SESL5	Zulassungsdatum	Datum der Zulassung in der EU als Anlageberater.	NEIN	JA
SESL6	Beschäftigte	Gesamtzahl der Beschäftigten.	NEIN	NEIN
SESL7	Beschäftigte — CLO	Gesamtzahl der Beschäftigten, die für den Kredithandel und die Verwaltung von CLO-Portfolios zuständig sind.	NEIN	NEIN
SESL8	Beschäftigte — Abwicklung	Gesamtzahl der Beschäftigten, die für die Abwicklung notleidender Kredite zuständig sind.	NEIN	NEIN
SESL9	AUM	Verwaltete Vermögenswerte (Assets under management) Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL10	AUM — gehebelte Kredite	Gesamtwert der verwalteten gehebelten Kredite. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL11	AUM — CLO	Gesamtwert der verwalteten CLO. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL12	AUM — EU	Gesamtwert der in der EU verwalteten Vermögenswerte. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL13	AUM — EU-CLO	Gesamtwert der in der EU verwalteten CLO. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL14	Anzahl EU-CLO	Anzahl der in der EU verwalteten CLO.	NEIN	NEIN
SESL15	Kapital	Gesamtkapital. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL16	Kapital — Risikselbstbehalt	Kapital zur Finanzierung des Risikselbstbehalts. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESL17	Abwicklungsdauer	Durchschnittlich benötigte Zeit für die Abwicklung von Handelstransaktionen in Kalendertagen.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESL18	Bepreisungshäufigkeit	Häufigkeit der Bepreisung/Neubepreisung von Portfolios (in Tagen). Bei unterschiedlichen Häufigkeiten ist die gewichtete Durchschnittshäufigkeit anzugeben, gewichtet nach den verwalteten Vermögenswerten jeder Kategorie und gerundet auf den nächsten Tag.	NEIN	NEIN
SESL19	Ausfallquote — 1 Jahr	Durchschnittliche annualisierte Ausfallquote bei vom CLO-Manager verwalteten, CLO-verbrieften Vermögenswerten im vorangegangenen Jahr.	NEIN	NEIN
SESL20	Ausfallquote — 5 Jahre	Durchschnittliche annualisierte Ausfallquote bei vom CLO-Manager verwalteten, CLO-verbrieften Vermögenswerten in den vorangegangenen fünf Jahren.	NEIN	NEIN
SESL21	Ausfallquote — 10 Jahre	Durchschnittliche annualisierte Ausfallquote bei vom CLO-Manager verwalteten, CLO-verbrieften Vermögenswerten in den vorangegangenen zehn Jahren.	NEIN	NEIN

## Angaben zur synthetischen Deckung

SESV1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
SESV2	Kennung des Sicherungsinstruments	Eindeutige Kennung des Sicherungsinstruments. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SESV3	Art der Sicherung	Angabe der Art des verwendeten Sicherungsinstruments: Kreditausfallswap (CDSX) Synthetische Unternehmensanleihen (CLKN) Gesamtertragsswap (TRES) Finanzgarantie (Kreditrisikominderung ohne Sicherheitsleistung) (FGUA) Kreditversicherung (CINS) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SESV4	Internationale Wertpapierkennnummer des Sicherungsinstruments	Sofern anwendbar, Angabe des ISIN-Codes des Sicherungsinstruments.	NEIN	JA
SESV5	Name des Sicherungsgebers	Vollständige juristische Bezeichnung des Sicherungsgebers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
SESV6	Rechtsträgerkennung des Sicherungsgebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des Sicherungsgebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
SESV7	Einrichtungen mit einem Risikogewicht von 0 %	Handelt es sich bei dem Sicherungsgeber um eine in Artikel 113 Absatz 4, Artikel 117 Absatz 2 oder Artikel 118 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (in geänderter Fassung) genannte öffentliche Stelle?	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESV8	Anwendbares Recht	Recht des Landes, dem die Sicherungsvereinbarung unterliegt.	NEIN	NEIN
SESV9	ISDA-Rahmenvertrag	Grundlage für die Sicherungsunterlagen: ISDA-Vertrag 2002 (ISDA) ISDA-Vertrag 2014 (IS14) Sonstiger ISDA-Vertrag (ISOT) Rahmenvertrag (DERV) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SESV10	Ausfall- und Kündigungsereignisse	Wo sind die Ausfall- und Kündigungsereignisse des Sicherungsvertrags aufgeführt? ISDA 2002 (ISDA) ISDA 2014 (IS14) Sonstige — Rückzahlung (OTHR)	NEIN	JA
SESV11	Art der synthetischen Verbriefung	Handelt es sich um eine „synthetische Bilanzverbriefung“?	NEIN	NEIN
SESV12	Währung der Sicherung	Währung der Sicherung.	NEIN	NEIN
SESV13	Nennwert der aktuellen Sicherung	Gesamtdeckungssumme gemäß Sicherungsvereinbarung zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESV14	Nennwert der maximalen Sicherung	Höchstbetrag der Deckung gemäß Sicherungsvereinbarung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESV15	Attachment-Point der Sicherung	Angabe des Attachment-Points (in Bezug auf das Poolkapital), ab dem die Sicherung beginnt.	NEIN	JA
SESV16	Detachment-Point der Sicherung	Angabe des Detachment-Points (in Bezug auf das Poolkapital), ab dem die Sicherung endet.	NEIN	JA
SESV17	Internationale Wertpapierkennnummer der gedeckten Schuldtitel	Bei Sicherung bestimmter Tranchen (z. B. Garantie) Angabe der ISIN jeder unter die spezifische Sicherungsvereinbarung fallenden Tranche. Im Falle mehrerer ISIN sind sämtliche ISIN im XML-Schema anzugeben.	NEIN	JA
SESV18	Sicherungsdeckung	Angabe der Option, die die Deckung des Sicherungsbetrags am besten beschreibt: Deckung nur von Kapitalverlusten (PRNC) Deckung von Kapital- und Zinsverlusten (PACC) Deckung von Kapitalverlusten, Zinsverlusten und Strafzinsen (PAPE) Deckung von Kapitalverlusten, Zinsverlusten und Vollstreckungskosten (PINF)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Deckung von Kapitalverlusten, Zinsverlusten, Strafzinsen und Vollstreckungskosten (PIPF) Sonstige (OTHR)		
SESV19	Datum der Kündigung der Sicherung	Angabe des vertraglich festgelegten Datums, an dem die Sicherung enden/gekündigt werden soll.	NEIN	JA
SESV20	Wesentlichkeitsschwellenwerte	Angabe eventueller Wesentlichkeitsschwellen für Sicherungsauszahlungen. Dies wäre beispielsweise ein Mindestbetrag der Bonitätsverschlechterung von Cashflow generierenden Vermögenswerten, der erreicht sein muss, ehe ein Anspruch gegenüber dem Sicherungsgeber geltend gemacht werden kann.	NEIN	NEIN
SESV21	Bedingungen für die Freigabe von Zahlungen	Angabe der Bedingungen für die Freigabe von Zahlungen durch den Sicherungsgeber: Unmittelbar nach einem Kreditereignis in Höhe des vollen Betrags ausgefallener Vermögenswerte (IFAM) Unmittelbar nach einem Kreditereignis in Höhe des vollen Betrags ausgefallener Vermögenswerte ohne erwartete Rückflüsse (IFAR) Nach einem vorab festgelegten, für Einziehungen reservierten Zeitraum (ACOL) Nach einem vorab festgelegten, für Einziehungen reservierten Zeitraum in Höhe der tatsächlichen Verluste abzüglich der erwarteten Rückflüsse (APCR) Nach vollständiger Verwertung von Verlusten in Höhe des tatsächlichen Verlusts (AWRK) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SESV22	Möglichkeit von Anpassungszahlungen	Sind in den Modalitäten der Sicherungsvereinbarung Anpassungszahlungen an den Sicherungsnehmer vorgesehen (z. B. wenn nach Fälligkeit der Sicherungsvereinbarung Abweichungen zwischen den zuvor geschätzten und den tatsächlich gezahlten Beträgen bestehen)?	NEIN	NEIN
SESV23	Länge des Abwicklungszeitraums	Wenn im Hinblick auf die zeitliche Planung der Zahlungen vorab ein Zeitraum für Einziehungen festgelegt wurde und jegliche Anpassungen der ursprünglichen Verlustregelung nötig werden, ist die Anzahl der Tage dieses Zeitraums anzugeben.	NEIN	JA
SESV24	Pflicht zur Rückzahlung	Angabe jeglicher Verpflichtungen des Sicherungsnehmers zur Rückzahlung sämtlicher bereits erhaltener Sicherungszahlungen (neben Verpflichtungen bei Kündigung des Derivats oder aufgrund eines Auslöseereignisses oder bei Verstoß gegen die Garantie in Bezug auf die Referenzverbindlichkeiten).	NEIN	NEIN
SESV25	Sicherheitensubstitution	Können im Falle, dass Sicherheiten gehalten werden, die Vermögenswerte im Sicherheitenportfolio substituiert werden? Dieses Feld ist bei synthetischen Regelungen mit Sicherheitsleistung auszufüllen oder falls anderweitig zutreffend (z. B. wenn Barmittel als Sicherheit für Sicherungszahlungen gehalten werden).	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESV26	Anforderungen an die Deckung von Sicherheiten	Werden Sicherheiten gehalten, ist die in den Verbriefungsunterlagen festgelegte Deckungsanforderung (als Sicherungsnennwert) in % anzugeben. Dieses Feld ist bei synthetischen Regelungen mit Sicherheitsleistung auszufüllen oder falls anderweitig zutreffend (z. B. wenn Barmittel als Sicherheit für Sicherungszahlungen gehalten werden).	NEIN	JA
SESV27	Sicherheiteneinschüsse	Bei Repo-Geschäften Angabe des in den Verbriefungsunterlagen geforderten Ersteinschusses (Sicherheit) für zulässige Investitionen. Dieses Feld ist bei synthetischen Regelungen mit Sicherheitsleistung auszufüllen oder falls anderweitig zutreffend (z. B. wenn Barmittel als Sicherheit für Sicherungszahlungen gehalten werden). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SESV28	Frist für die Leistung von Sicherheiten	Bei Repo-Geschäften Angabe der in den Verbriefungsunterlagen festgelegten Frist (in Tagen) bis zur Leistung der Sicherheit bei Abruf. Dieses Feld ist bei synthetischen Regelungen mit Sicherheitsleistung auszufüllen oder falls anderweitig zutreffend (z. B. wenn Barmittel als Sicherheit für Sicherungszahlungen gehalten werden).	NEIN	JA
SESV29	Abwicklung	Zu leistende Entschädigung: Bar (CASH) Physische Abwicklung (PHYS)	NEIN	JA
SESV30	Maximaler Fälligkeitstermin	Bei physischer Abwicklung Angabe des in den Verbriefungsunterlagen festgelegten maximalen Fälligkeitstermins für lieferbare Wertpapiere.	NEIN	JA
SESV31	Aktueller Index für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	Aktueller Zinsindex (Referenzsatz für die Festlegung von Zahlungen an den Sicherungsnehmer). Dieses Feld ist insbesondere auszufüllen, wenn Sicherungen über einen Swap erbracht werden: MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
SESV32	Laufzeit des aktuellen Index für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	Laufzeit des für Zahlungen an den Sicherungsnehmer zugrunde gelegten Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SESV33	Anpassung der Zahlungshäufigkeit — Zahlungen an den Sicherungsnehmer	Häufigkeit, mit der Zahlungen an den Sicherungsnehmer gemäß der Sicherungsvereinbarung angepasst werden: Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESV34	Aktuelle Zinsmarge für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	Aktuelle Zinsmarge auf variabel verzinsliche Zahlungen an den Sicherungsnehmer oberhalb des als Referenzsatz für die Festlegung von Zahlungen an den Sicherungsnehmer dienenden Indexsatzes (falls unterhalb des Satzes, Eingabe eines negativen Werts). Dieses Feld ist insbesondere auszufüllen, wenn Sicherungen über einen Swap erbracht werden.	NEIN	JA
SESV35	Aktueller Zinsindex für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	Aktueller Zinsindex für Zahlungen an den Sicherungsnehmer. Dieses Feld ist insbesondere auszufüllen, wenn Sicherungen über einen Swap erbracht werden.	NEIN	JA
SESV36	Aktueller Index für Zahlungen an den Sicherungsgeber	Aktueller Zinsindex (Referenzsatz für die Festlegung von Zahlungen an den Sicherungsgeber). MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESV37	Laufzeit des aktuellen Index für Zahlungen an den Sicherungsgeber	Laufzeit des für Zahlungen an den Sicherungsgeber zugrunde gelegten Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SESV38	Anpassung der Zahlungshäufigkeit — Zahlungen an den Sicherungsgeber	Häufigkeit, mit der Zahlungen an den Sicherungsgeber gemäß der Sicherungsvereinbarung angepasst werden: Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SESV39	Aktuelle Zinsmarge für Zahlungen an den Sicherungsgeber	Aktuelle Zinsmarge auf variabel verzinsliche Zahlungen an den Sicherungsgeber oberhalb des als Referenzsatz für die Festlegung von Zahlungen an den Sicherungsnehmer dienenden Indexsatzes (falls unterhalb, Eingabe eines negativen Werts). Dieses Feld ist insbesondere auszufüllen, wenn Sicherungen über einen Swap erbracht werden.	NEIN	JA
SESV40	Aktueller Zinsindex für Zahlungen an den Sicherungsgeber	Aktueller Zinsindex für Zahlungen an den Sicherungsgeber.	NEIN	JA
SESV41	Unterstützung durch Überschussmarge	Nutzung der Überschussmarge zur Bonitätsverbesserung der nachrangigsten Schuldkategorien.	NEIN	NEIN
SESV42	Definition der Überschussmarge	Je nach Verbriefungsunterlagen wird die Überschussmarge am besten als feste Überschussmarge beschrieben (z. B. vorab festgelegte Höhe der verfügbaren Überschussmarge, in der Regel in Form eines festen Prozentsatzes).	NEIN	NEIN
SESV43	Aktueller Sicherungsstatus	Aktueller Sicherungsstatus zum Datenstichtag. Aktiv (ACTI) Annulliert (CANC) Deaktiviert (DEAC)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Ausgelaufen (EXPI) Inaktiv (INAC) Zurückgezogen (WITH) Sonstige (OTHR)		
SESV44	Kreditereignis Insolvenz	Fällt Insolvenz des Referenzkredits/-schuldners unter die Definition von Kreditereignissen in der Sicherungsvereinbarung?	NEIN	NEIN
SESV45	Kreditereignis Zahlungsver säumnis	Fällt das Ereignis, dass ein Schuldner nicht innerhalb von 90 Tagen zahlt, unter die Definition von Kreditereignissen in der Sicherungsvereinbarung?	NEIN	NEIN
SESV46	Kreditereignis Umstrukturierung	Fällt eine Umstrukturierung des Referenzkredits/-schuldners unter die Definition von Kreditereignissen in der Sicherungsvereinbarung?	NEIN	NEIN
SESV47	Kreditereignis	Wurde ein Kreditereignis mitgeteilt?	NEIN	NEIN
SESV48	Kumulierte Zahlungen an den Sicherungsnehmer	Gesamtbetrag der Zahlungen, die der Sicherungsgeber zum Datenstichtag an den Sicherungsnehmer geleistet hat. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESV49	Kumulierte Anpassungszahlungen an den Sicherungsnehmer	Gesamtbetrag der zum Datenstichtag vom Sicherungsgeber an den Sicherungsnehmer geleisteten Anpassungszahlungen (z. B. zum Ausgleich der Differenz zwischen den ursprünglichen Zahlungen für erwartete Verluste und den anschließend tatsächlichen realisierten Verlusten aufgrund wertgeminderter, Zahlungsströme generierender Vermögenswerte). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESV50	Kumulierte Zahlungen an den Sicherungsgeber	Gesamtbetrag der Zahlungen, die der Sicherungsnehmer zum Datenstichtag an den Sicherungsgeber geleistet hat. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESV51	Kumulierte Anpassungszahlungen an den Sicherungsgeber	Gesamtbetrag der zum Datenstichtag vom Sicherungsnehmer an den Sicherungsgeber geleisteten Anpassungszahlungen (z. B. zum Ausgleich der Differenz zwischen den ursprünglichen Zahlungen für erwartete Verluste und den anschließend tatsächlichen realisierten Verlusten aufgrund wertgeminderter, Zahlungsströme generierender Vermögenswerte). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESV52	Synthetische Überschussmarge	Gesamtbetrag des Kontos synthetische Überschussmarge zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

## Angaben zu den Sicherheiten des Emittenten

SESI1	Eindeutige Kennung	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESS1.	NEIN	NEIN
-------	--------------------	--	------	------

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESI2	Kennung des Sicherungsinstruments	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung wie in Feld SESV2.	NEIN	NEIN
SESI3	Ursprüngliche Kennung des Sicherungsinstruments	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die dem Sicherungsinstrument zugewiesen wurde. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SESI4	Neue Kennung der Sicherheit	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes SESI3 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in SESI3. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SESI5	Internationale Wertpapierkennnummer des Sicherungsinstruments	Sofern anwendbar, Angabe des ISIN-Codes des Sicherungsinstruments.	NEIN	JA
SESI6	Art des Sicherungsinstruments	Art des Sicherungsinstruments: Bar (CASH) Staatsanleihe (GBND) Geldmarktpapier (CPAP) Unbesicherte Bankschuld (UBDT) Vorrangige unbesicherte Bankschuld (SUCD) Nachrangige unbesicherte Bankschuld (JUCD) Gedekte Schuldverschreibung (CBND) Forderungsbesichertes Wertpapier (ABSE) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SESI7	ESVG-Teilsektor des Herausgebers der Sicherheit	ESVG-2010-Klassifizierung des Herausgebers der Sicherheit gemäß der Verordnung (EG) Nr. 549/2013 („ESVG 2010“). Dieser Eintrag muss auf der Ebene der Teilsektoren erfolgen. Dabei ist einer der in Tabelle 1 des Anhangs I angegebenen Werte zu verwenden.	NEIN	JA
SESI8	Rechtsträgerkennung des Herausgebers der Sicherheit	Angabe der Rechtsträgerkennung des Herausgebers der Sicherheit (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
SESI9	Verbindung des Herausgebers der Sicherheit mit dem Originator	Haben der Herausgeber der Sicherheit und der wichtigste Originator der Verbriefung die gleiche oberste Muttergesellschaft?	NEIN	NEIN
SESI10	Aktuell ausstehender Saldo	Ausstehender Gesamtkapitalsaldo der Sicherheit zum Datenstichtag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SESI11	Währung des Instruments	Währung, auf die das Instrument lautet.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SESI12	Fälligkeitstermin	Fälligkeitstermin der Sicherheit.	NEIN	JA
SESI13	Abschlag („Haircut“)	Angabe des gemäß den Verbriefungsunterlagen (auf den derzeitigen ausstehenden Kapitalsaldo) anzuwendenden Abschlags auf diese Sicherheit in %.	NEIN	JA
SESI14	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SESI15	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)		
SESI16	Aktueller Zinssatz auf Bareinlagen	Bei Sicherungsinstrumenten in Form von Bareinlagen Angabe des aktuellen Zinssatzes für diese Einlagen. Bei mehreren Einlagenkonten je Währung ist der gewichtete durchschnittliche aktuelle Zinssatz anzugeben, wobei als Gewicht der aktuelle Saldo der Bareinlagen in den jeweiligen Konten verwendet wird.	NEIN	JA
SESI17	Name der Gegenpartei des Repo-Geschäfts	Bei Sicherheiten, die Bestandteil eines Pensionsgeschäfts sind, Angabe der vollständigen juristischen Bezeichnung der Gegenpartei der Verbriefung. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
SESI18	Rechtsträgerkennung der Gegenpartei des Repo-Geschäfts	Bei Sicherheiten, die Bestandteil eines Pensionsgeschäfts sind, Angabe der Rechtsträgerkennung der Gegenpartei, bei der die Bareinlagen hinterlegt werden (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
SESI19	Fälligkeitstermin des Repo-Geschäfts	Bei Sicherheiten, die Bestandteil eines Pensionsgeschäfts sind, Angabe des Fälligkeitsdatums der Verbriefung.	NEIN	JA

## Sonstige Angaben

SESO1	Eindeutige Kennung	Im Feld SESS1 ausgewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
SESO2	Zeilennummer sonstiger Angaben	Angabe der Zeilennummer für sonstige Angaben.	NEIN	NEIN
SESO3	Sonstige Angaben.	Sonstige Angaben, Zeile für Zeile.	NEIN	NEIN

## ANHANG XV

INSIDERINFORMATIONEN ODER ANGABEN ZU SIGNIFIKANTEN EREIGNISSEN — VERBRIEFUNG  
FORDERUNGSGEDECKTER GELDMARKTPAPIERE

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1- ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
Angaben zum Programm				
SEAS1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 diesem ABCP-Programm zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
SEAS2	Datenstichtag	Datenstichtag für diese Meldung. Wenn die Daten zusammen mit Daten über zugrunde liegende Risikopositionen und Anlegerberichte übermittelt werden, muss dieses Datum mit dem Datenstichtag übereinstimmen, der in den Meldebögen für die zugrunde liegende Risikoposition und den Anlegerbericht angegeben wurde.	NEIN	NEIN
SEAS3	Nicht mehr STS	Erfüllt das ABCP-Programm nicht mehr die STS-Anforderungen? Wenn das ABCP-Programm nie STS-Status hatte, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAS4	Abhilfemaßnahmen	Haben zuständige Behörden in Bezug auf diese Verbriefung Abhilfemaßnahmen ergriffen? Ist die Verbriefung keine STS-Verbriefung, so ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAS5	Administrative Schritte	Haben zuständige Behörden administrative Schritte in Bezug auf diese Verbriefung unternommen? Ist die Verbriefung keine STS-Verbriefung, so ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAS6	Wesentliche Änderung der Unterlagen der Transaktion.	Beschreibung wesentlicher Änderungen an den Transaktionsunterlagen, einschließlich Bezeichnung und Positionscode (gemäß Anhang I Tabelle 3), sowie ausführliche Beschreibung der Änderungen.	NEIN	JA
SEAS7	Anwendbares Recht	Recht des Landes, dem das Programm unterliegt.	NEIN	NEIN
SEAS8	Dauer der Liquiditätsfazilität	Zeitraum der Deckung des Programms durch die Liquiditätsfazilität auf Programmebene (in Tagen).	NEIN	JA
SEAS9	Deckung der Liquiditätsfazilität	Maximaler Finanzierungsbetrag (als Prozentanteil der zugrunde liegenden Risikopositionen des Programms), der durch die Liquiditätsfazilität auf Programmebene gedeckt ist.	NEIN	JA
SEAS10	Deckungsintervall der Liquiditätsfazilität	Maximale Anzahl von Tagen vor Beginn der Finanzierung des Geschäfts durch die Liquiditätsfazilität auf Programmebene infolge der Auslösung eines Triggers und der dadurch bewirkten Auszahlungen aus der Liquiditätsfazilität.	NEIN	JA
SEAS11	Fälligkeitstermin der Liquiditätsfazilität	Datum, zu dem die Liquiditätsfazilität auf Programmebene endet.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAS12	Ziehungen im Rahmen der Liquiditätsfazilität	Wenn die Verbriefung mit einer Liquiditätsfazilität auf Programmebene verbunden ist, Bestätigung, ob in dem Zeitraum, der am letzten Zinszahlungsdatum endet, eine Ziehung unter der Liquiditätsfazilität stattgefunden hat oder nicht.	NEIN	JA
SEAS13	Gesamtemissionen	Ausstehende Gesamtemissionen des Programms, umgerechnet in EUR. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEAS14	Maximalemission	Gibt es eine Obergrenze für Emissionen des ABCP-Programms, so ist diese hier anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

## Angaben zur Transaktion

SEAR1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung des ABCP-Programms wie in Feld SEAS1.	NEIN	NEIN
SEAR2	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	Von der meldenden Stelle gemäß Artikel 11 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 dieser ABCP-Transaktion zugewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
SEAR3	Anzahl der Programme zur Finanzierung der Transaktion	Anzahl der ABCP-Programme, die diese Transaktion finanzieren.	NEIN	NEIN
SEAR4	Nicht mehr STS	Erfüllt die ABCP-Transaktion nicht mehr die STS-Anforderungen? Wenn die ABCP-Transaktion nie STS-Status hatte, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAR5	Originator als Kunde des Programmsponsors	Standen Originator und Programmsponsor zum Zeitpunkt der Übertragung von Vermögenswerten in einer Kundenbeziehung?	NEIN	NEIN
SEAR6	Gewährung von Sicherungsrechten	Hat die betreffende Verbriefungszweckgesellschaft/das insolvenzgeschützte Tochterunternehmen des Originators dem Käufer (Verbriefungszweckgesellschaft) Sicherungsrechte an ihren Vermögenswerten eingeräumt?	NEIN	NEIN
SEAR7	Einnahmen	Summe der Einnahmen des Originators in der Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (d. h. Jahresbeginn bis dato oder vorangehende 12 Monate) Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR8	Betriebliche Aufwendungen	Summe der betrieblichen Aufwendungen des Originators in der Periode, die durch die letzte Ergebnisrechnung abgedeckt wird (d. h. Jahresbeginn bis dato oder vorangehende 12 Monate) Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAR9	Umlaufvermögen	Umlaufvermögen des Originators (mit Fälligkeit innerhalb der nächsten 12 Monate oder nach geltendem Rechnungslegungsstandard) gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR10	Barmittel	Kassenbestände des Originators gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR11	Marktgängige Wertpapiere	Marktgängige Wertpapiere des Originators gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR12	Forderungen	Forderungen des Originators gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR13	Kurzfristige Verbindlichkeiten	Kurzfristige Verbindlichkeiten des Originators (mit Fälligkeit innerhalb der nächsten 12 Monate oder nach geltendem Rechnungslegungsstandard) gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR14	Gesamtschulden	Gesamtschulden des Originators gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR15	Gesamtkapital	Gesamtkapital des Originators gemäß der letzten Ergebnisrechnung. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR16	Währung des Abschlusses	Die in der Finanzberichterstattung in den Feldern SEAR7 — SEAR15 verwendete Währung.	NEIN	JA
SEAR17	Ebene der Unterstützung durch den Sponsor	Auf welcher Ebene leistet der Sponsor Unterstützung: Transaktionsebene (TRXN) Programmebene (PRGM) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SEAR18	Art der Unterstützung durch den Sponsor	Leistet der Sponsor volle Unterstützung für diese Transaktion?	NEIN	JA
SEAR19	Dauer der Liquiditätsfazilität	Zeitraum der Deckung der Transaktion durch die Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene (in Tagen).	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAR20	Aus der Liquiditätsfazilität in Anspruch genommener Betrag	Aus der Liquiditätsfazilität zwischen dem letzten Datenstichtag und dem Stichtag für die Übermittlung dieser Daten in Anspruch genommener Betrag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR21	Deckung der Liquiditätsfazilität	Maximaler Finanzierungsbetrag (als Prozentanteil der zugrunde liegenden Risikopositionen der Transaktion), der durch die Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene gedeckt ist.	NEIN	JA
SEAR22	Deckungsintervall der Liquiditätsfazilität	Maximale Anzahl von Tagen vor Beginn der Finanzierung der Transaktion durch die Liquiditätsfazilität infolge der Auslösung eines Triggers und der dadurch bewirkten Auszahlungen aus der Liquiditätsfazilität.	NEIN	JA
SEAR23	Art der Liquiditätsfazilität	Art der Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene: Kauf von Vermögenswerten (PURC) Pensionsgeschäfte (RPAG) Darlehensfazilität (LOFA) Beteiligungsvertrag (PAGR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SEAR24	Fälligkeitstermin der Pensionsgeschäfte der Liquiditätsfazilität	Nutzt die Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene Pensionsgeschäfte, so ist das Datum anzugeben, an dem das entsprechende Pensionsgeschäft ausläuft.	NEIN	JA
SEAR25	Währung der Liquiditätsfazilität	Angabe der Währung, in der Mittel aus der Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene gezogen werden können.	NEIN	JA
SEAR26	Fälligkeitstermin der Liquiditätsfazilität	Datum, zu dem die Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene endet.	NEIN	JA
SEAR27	Name des Anbieters der Liquiditätsfazilität	Vollständige juristische Bezeichnung des Anbieters der Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
SEAR28	Rechtsträgerkennung des Anbieters der Liquiditätsfazilität	Angabe der Rechtsträgerkennung des Anbieters der Liquiditätsfazilität auf Transaktionsebene (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
SEAR29	Übersicherung/Nachrangige Beteiligungen	Anteil der nachrangigen Beteiligungen an den zugrunde liegenden Risikopositionen, die vom Verkäufer verkauft werden (oder vom Verkäufer gewährter Nachlass auf den Kaufpreis der zugrunde liegenden Risikopositionen). Falls der Anteil der nachrangigen Beteiligungen je nach zugrunde liegender Risikoposition schwankt, ist die Mindestübersicherung sämtlicher zugrunde liegender Risikopositionen anzugeben.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAR30	Überschussmarge der Transaktion	Angabe des Betrags der nach Anwendung aller derzeit anwendbaren Zahlungen, Kosten, Gebühren usw. verbleibenden Mittel („Überschussmarge“). Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEAR31	Name des Kreditbrief-Ausstellers	Vollständige juristische Bezeichnung des Kreditbrief-Ausstellers. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
SEAR32	Rechtsträgerkennung des Kreditbrief-Ausstellers	Angabe der Rechtsträgerkennung des Kreditbrief-Ausstellers der Transaktion (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	JA
SEAR33	Währung des Kreditbriefs	Angabe der Währung des Kreditbriefs.	NEIN	JA
SEAR34	Maximale Sicherung durch den Kreditbrief	Maximaler Deckungsgrad durch den Kreditbrief der Sicherungsvereinbarung, ausgedrückt als Prozentanteil der zugrunde liegenden Risikopositionen.	NEIN	JA
SEAR35	Name des Garantiegebers	Angabe der vollständigen juristischen Bezeichnung des Garantiegebers unter Berücksichtigung von Vereinbarungen, in denen ein Institut sich zum Kauf ausgefallener Forderungen des Verkäufers verpflichtet. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	JA
SEAR36	Rechtsträgerkennung des Garantiegebers	Angabe der Rechtsträgerkennung des Garantiegebers (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)) unter Berücksichtigung von Vereinbarungen, durch die ein Institut sich zum Kauf ausgefallener Forderungen des Verkäufers verpflichtet.	NEIN	JA
SEAR37	Maximale Deckung durch die Garantie	Höchstbetrag der Deckung gemäß Garantie/Kaufvertrag. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR38	Währung der Garantie	Angabe der Währung, in der Mittel aus der Garantie bereitgestellt werden.	NEIN	JA
SEAR39	Fälligkeitstermin der Garantie	Datum, zu dem die Garantie endet.	NEIN	JA
SEAR40	Art der Forderungsübertragung	Angabe der Art der Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf den Käufer. „True-Sale“-Verkauf (1) Besichertes Darlehen (2) Sonstige (3)	NEIN	NEIN
SEAR41	Fälligkeitstermin der Pensionsgeschäfte	Datum, an dem Pensionsgeschäfte zur Übertragung der zugrunde liegenden Risikopositionen auf den Käufer außer Kraft treten.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAR42	Gekaufter Betrag	Betrag zugrunde liegender Risikopositionen, die zwischen dem letzten Datenstichtag und dem Stichtag für die Übermittlung dieser Daten bei dieser Transaktion vom Originator gekauft wurden. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEAR43	Maximale Finanzierungsgrenze	Maximale Obergrenze für Finanzierungen, die dem Originator im Rahmen der Transaktion zum Datenstichtag Verfügung gestellt werden können. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAR44	Referenzzinssatz des Zinsswaps	Beschreibung der Art des Referenzzinssatzes, an den die zahlende Komponente des Swaps gekoppelt ist: Bei mehreren Swapgeschäften in der Transaktion ist die Art des zuletzt abgeschlossenen Zinsswaps anzugeben. MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO) TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SEAR45	Fälligkeit des Zinsswaps	Angabe des Fälligkeitstermins des Zinsswaps. Bei mehreren Swaps in der Transaktion ist der Fälligkeitstermin des zuletzt abgeschlossenen Swaps anzugeben.	NEIN	JA
SEAR46	Nominalbetrag des Zinsswaps	Nominalbetrag des Zinsswaps auf Transaktionsebene. Bei mehreren Swapgeschäften in der Transaktion ist der Nominalbetrag des letzten Zinsswaps anzugeben.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAR47	Währung der zahlenden Komponente des Währungsswaps	Angabe der von der zahlenden Komponente des Swaps genutzten Währung. Bei mehreren Swapgeschäften in der Transaktion ist die Art des zuletzt abgeschlossenen Währungsswaps anzugeben.	NEIN	JA
SEAR48	Währung der empfangenden Komponente des Währungsswaps	Angabe der von der empfangenden Komponente des Swaps genutzten Währung. Bei mehreren Swapgeschäften in der Transaktion ist die Art des zuletzt abgeschlossenen Währungsswaps anzugeben.	NEIN	JA
SEAR49	Wechselkurs des Währungsswaps	Wechselkurs, der für einen Währungsswap auf Transaktionsebene festgelegt wurde Bei mehreren Swaps in der Transaktion ist der Wechselkurs des zuletzt abgeschlossenen Swaps anzugeben.	NEIN	JA
SEAR50	Fälligkeit des Währungsswaps	Angabe des Fälligkeitstermins des Währungsswaps auf Transaktionsebene. Bei mehreren Swaps in der Transaktion ist der Fälligkeitstermin des zuletzt abgeschlossenen Swaps anzugeben.	NEIN	JA
SEAR51	Nominalbetrag des Währungsswaps	Angabe des Nominalbetrags des Währungsswaps auf Transaktionsebene. Bei mehreren Swaps in der Transaktion ist der Nominalbetrag des zuletzt abgeschlossenen Swaps anzugeben. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA

## Angaben zu Tranche/Anleihe

SEAT1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung des ABCP-Programms wie in Feld SEAS1.	NEIN	NEIN
SEAT2	Ursprüngliche Kennung der Anleihe	Ursprüngliche eindeutige Kennung, die dem Instrument zugewiesen wurde. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SEAT3	Neue Kennung der Anleihe	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes SEAT2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in Feld SEAT2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SEAT4	Internationale Wertpapierkennnummer	Sofern anwendbar, ISIN-Code dieses Instruments.	NEIN	JA
SEAT5	Art der Tranche/Anleihe	Auswahl der am besten zutreffenden Beschreibung des Rückzahlungsprofils des Instruments: Hard bullet (d. h. fester Fälligkeitstermin) (HBUL) Soft bullet (d. h. geplanter Fälligkeitstermin kann bis zum gesetzlichen Fälligkeitstermin verlängert werden) (SBUL) Planmäßige Tilgung (d. h. Rückzahlung des Kapitalbetrags an planmäßigen Tilgungsdaten) (SAMO)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Kontrollierte Tilgung (d. h. Kapitalrückzahlung ab einem spezifischen Zeitpunkt) (CMM) Sonstige (OTHR)		
SEAT6	Emissionsdatum	Datum, an dem dieses Instrument emittiert wurde.	NEIN	NEIN
SEAT7	Gesetzliche Fälligkeit	Datum, bis zu dem dieses Instrument zurückgezahlt werden muss, um nicht in Verzug zu geraten.	NEIN	JA
SEAT8	Währung	Währung, auf die das Instrument lautet.	NEIN	NEIN
SEAT9	Aktueller Kapitalsaldo	Nennwert dieses Instruments nach dem aktuellen Kapitalrückzahlungsdatum. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEAT10	Aktueller Kupon	Kupon des Instruments in Basispunkten.	NEIN	NEIN
SEAT11	Aktueller Zinsindex	Aktuell geltender Basisreferenzindex (Referenzsatz, ausgehend von dem der Zinssatz festgelegt wird): MuniAAA (MAAA) FutureSWAP (FUSW) LIBID (LIBI) LIBOR (LIBO) SWAP (SWAP) US-Treasury (TREA) Euribor (EURI) Pfandbriefe (PFAN) EONIA (EONA) EONIASwaps (EONS) EURODOLLAR (EUUS) EuroSwiss (EUCH) TIBOR (TIBO) ISDAFIX (ISDA) GCFRepo (GCFR) STIBOR (STBO) BBSW (BBSW) JIBAR (JIBA) BUBOR (BUBO) CDOR (CDOR) CIBOR (CIBO) MOSPRIM (MOSP) NIBOR (NIBO) PRIBOR (PRBO)	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		TELBOR (TLBO) WIBOR (WIBO) Basissatz der Bank of England (BOER) Basissatz der Europäischen Zentralbank (ECBR) Eigener Satz des Kreditgebers (LDOR) Sonstige (OTHR)		
SEAT12	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	Laufzeit des aktuellen Zinsindex: Eintägig (OVNG) Intradaday (INDA) 1 Tag (DAIL) 1 Woche (WEEK) 2 Wochen (TOWK) 1 Monat (MNTH) 2 Monate (TOMN) 3 Monate (QUTR) 4 Monate (FOMN) 6 Monate (SEMI) 12 Monate (YEAR) Auf Anfrage (ONDE) Sonstige (OTHR)	NEIN	JA
SEAT13	Zinszahlungshäufigkeit	Häufigkeit, mit der bei diesem Instrument Zinsen fällig sind: Monatlich (MNTH) Vierteljährlich (QUTR) Halbjährlich (SEMI) Jährlich (YEAR) Sonstige (OTHR)	NEIN	NEIN
SEAT14	Aktuelle Bonitätsverbesserung	Aktuelle Bonitätsverbesserung des Instruments, berechnet gemäß Festlegung von Originator/Sponsor/Verbriefungszweckgesellschaft.	NEIN	NEIN
SEAT15	Bonitätsverbesserungsformel	Beschreibung/Angabe der Formel zur Berechnung der Bonitätsverbesserung der Anleihe.	NEIN	JA

## Angaben zum Konto

SEAA1	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung der Transaktion wie in Feld SEAR2.	NEIN	NEIN
SEAA2	Ursprüngliche Kennung des Kontos	Ursprüngliche Kennung des Kontos. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
SEAA3	Neue Kennung des Kontos	Wenn die ursprüngliche Kennung des Feldes SEAA2 in diesem Feld nicht übernommen werden kann, ist hier die neue Kennung einzugeben. Wenn sich die Kennung nicht geändert hat, ist dieselbe Kennung einzugeben wie in SEAA2. Die meldende Stelle darf diese eindeutige Kennung nicht ändern.	NEIN	NEIN
SEAA4	Kontotyp	Kontotyp: Rücklagenkonto („Barreserve“) (CARE) „Commingling Reserve“-Konto (CORE) Verrechnungskonto („Set-off Reserve“) (SORE) Liquiditätsfazilität (LQDF) Marginkonto („Margin Account“) (MGAC) Sonstiges Konto (OTHR)	NEIN	NEIN
SEAA5	Zielsaldo	Höhe der Mittel, die bei voller Finanzierung gemäß den Verbriefungsunterlagen auf dem betreffenden Konto eingezahlt wären. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	JA
SEAA6	Tatsächlicher Saldo	Saldo der Einlagen auf dem betreffenden Konto am Periodenende. Angabe der Währung, auf die der Betrag lautet, im Format {CURRENCYCODE_3}.	NEIN	NEIN
SEAA7	Amortisationskonto	Amortisiert das Konto während der Laufzeit der Verbriefung?	NEIN	NEIN

## Angaben zur Gegenpartei

SEAP1	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	Angabe der gleichen eindeutigen Kennung der Transaktion wie in Feld SEAR2.	NEIN	NEIN
SEAP2	Rechtsträgerkennung der Gegenpartei	Angabe der Rechtsträgerkennung der Gegenpartei (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)).	NEIN	NEIN
SEAP3	Name der Gegenpartei	Vollständige juristische Bezeichnung der Gegenpartei. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen.	NEIN	NEIN
SEAP4	Art der Gegenpartei	Art der Gegenpartei: Kontoführende Bank (ABNK) Backup-Konto-Bank (ABNK) Kontoführende Bank — Vermittler (ABFC) Kontoführende Bank — Garantiegeber (ABGR) Sicherheitenverwalter (COLL) Zahlstelle (PAYA) Berechnungsstelle (CALC)	NEIN	NEIN

Feld-code	Bezeichnung des felde	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		Verwaltungsstelle (ADMI) Verwaltungsunterbeauftragter (ADSA) Transferstelle (RANA) Verifizierungsstelle (VERI) Sicherheitsstelle (SECU) Anbieter von Kassenvorschüssen (CAPR) Sicherungsgeber (COLL) Anbieter von garantierten Beteiligungsverträgen (GICP) Darlehensanbieter für Versicherungspolice (IPCP) Anbieter von Liquiditätsfazilitäten (LQFP) Anbieter von Backup-Liquiditätsfazilitäten (BLQP) Sparhypotheken-Partei (SVMP) Emittent (ISSR) Originator (ORIG) Verkäufer (SELL) Sponsor der Verbriefungszweckgesellschaft (SSSP) Servicer (SERV) Backup-Servicer (BSER) Backup-Servicer — Vermittler (BSRF) Special Servicer (SSRV) Zeichner (SUBS) Zinsswap-Anbieter (IRSP) Backup-Zinsswap-Anbieter (BIPR) Währungsswap-Anbieter (CSPR) Backup-Währungsswap-Anbieter (CSPR) Abschlussprüfer (AUDT) Berater (CNSL) Treuhänder (TRUS) Investoren-Vertreter (REPN) Zeichner (UNDR) Arrangeur (ARRG) Händler (DEAL) Manager (MNGR) Kreditbrief-Aussteller (LCPR) Multi-Seller-Conduit (MSCD) Verbriefungszweckgesellschaft (SSPE) Liquiditäts- oder Liquidationsstelle (LQAG) Anteilseigner des Conduit/der Verbriefungszweckgesellschaft (EQOC) Anbieter kurzfristiger Deckungslinien (SWNG) Anlaufkredit- oder Leasing-Anbieter (SULP)		

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1-ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
		<p>Repogeschäft-Gegenpartei (RAGC)</p> <p>Cash-Manager (CASM)</p> <p>Einzugskontobank (CACB)</p> <p>Sicherheitenkontobank (COLA)</p> <p>Anbieter von nachrangigen Darlehen (SBLP)</p> <p>CLO-Manager (CLOM)</p> <p>Portfolioberater (PRTA)</p> <p>Substitutionsstelle (SUBA)</p> <p>Sonstige (OTHR)</p>		
SEAP5	Niederlassungsland der Gegenpartei	Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist.	NEIN	NEIN
SEAP6	Ratingschwelle für die Gegenpartei	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier die Ratingschwelle für die Gegenpartei zum Datenstichtag anzugeben. Im Falle mehrerer Ratings sind sämtliche Ratings im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAP7	Rating der Gegenpartei	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier das Rating der Gegenpartei zum Datenstichtag anzugeben. Im Falle mehrerer Ratingschwellen sind sämtliche Ratingschwellen im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAP8	Rechtsträgerkennung der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier die Rechtsträgerkennung der die Gegenpartei bewertenden Stelle (gemäß Eintragung in der Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF)) zum Datenstichtag anzugeben. Im Falle mehrerer Ratings sind die Rechtsträgerkennungen sämtlicher Ratings vornehmender Stellen im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA
SEAP9	Name der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	Falls für die von dieser Gegenpartei in der Verbriefung erbrachten Dienstleistungen ein auf Ratings basierendes Schwellenwert festgelegt wurde, ist hier die vollständige Bezeichnung des Anbieters des Gegenpartei-Ratings zum Datenstichtag anzugeben. Der Name muss der Eintragung in der LEI-Datenbank der Global Legal Entity Foundation (GLEIF) entsprechen. Im Falle mehrerer Ratings sind die Rechtsträgerkennungen sämtlicher Ratings vornehmender Stellen im XML-Schema anzugeben. Gibt es keine solche Ratingschwelle, ist ND5 anzugeben.	NEIN	JA

Feld-code	Bezeichnung des feldes	Inhalt der meldung	ND1- ND4 zulässig?	ND5 zulässig?
-----------	------------------------	--------------------	--------------------------	------------------

## Sonstige Angaben

SEAO1	Eindeutige Kennung	Im Feld SEAS1 ausgewiesene eindeutige Kennung.	NEIN	NEIN
SEAO2	Zeilennummer sonstiger Angaben	Angabe der Zeilennummer für sonstige Angaben.	NEIN	NEIN
SEAO3	Sonstige Angaben.	Sonstige Angaben, Zeile für Zeile.	NEIN	NEIN

**DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2020/1225 DER KOMMISSION****vom 29. Oktober 2019****zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format und die standardisierten Meldebögen, die vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft zur Bereitstellung der Einzelheiten von Verbriefungen zu verwenden sind****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012<sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 7 Absatz 4 und Artikel 17 Absatz 3,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Artikel 7 Absatz 4 der Verordnung (EU) 2017/2402 gilt für Verbriefungen jeder Art, einschließlich solcher, für die gemäß der Verordnung (EU) 2017/1129<sup>(2)</sup> ein Prospekt zu erstellen ist („öffentliche“ Verbriefungen), und solcher, für die kein Prospekt erstellt werden muss („private“ Verbriefungen). Artikel 17 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2017/2402 betrifft Verbriefungen, bei denen Informationen über ein Verbriefungsregister zur Verfügung gestellt werden, worunter keine privaten Verbriefungen fallen.
- (2) Verbriefungen sind komplex und haben vielfältige Erscheinungsformen. Um eine effiziente Datenerhebung und eine fundierte Beurteilung durch die Anleger, potenziellen Anleger, zuständigen Behörden und im Falle öffentlicher Verbriefungen auch durch die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten anderen Stellen zu ermöglichen, sollten die in Artikel 7 Absatz 1 Buchstaben a und e und die in Artikel 17 Absatz 2 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Angaben in einem harmonisierten Format bereitgestellt werden. Sind die Angaben über ein Verbriefungsregister bereitzustellen, erleichtert ein harmonisiertes Format zudem eine nahtlose Aggregation und einen Vergleich zwischen verschiedenen Registern.
- (3) Die Kosten für die Marktteilnehmer sollten so gering wie möglich gehalten werden. Aus diesem Grund sollte sich das Meldeformat für Verbriefungen so weit wie möglich an das Format anlehnen, das in Artikel 9 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(3)</sup> für die Meldung von Derivatekontrakten und in Artikel 4 der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(4)</sup> für die Meldung der Einzelheiten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT) vorgeschrieben ist. Werden die Angaben über ein Verbriefungsregister bereitgestellt, sollte das Meldeformat darüber hinaus den von den bestehenden Datensammelstellen entwickelten Lösungen Rechnung tragen. Aus diesem Grund sollte auch für die Meldung von Verbriefungen das Format XML vorgeschrieben werden, das im Allgemeinen für die Meldung von Angaben zu Krediten und ähnlichen zugrunde liegenden Risikopositionen verwendet wird.
- (4) Die Bestimmungen dieser Verordnung sind eng miteinander verknüpft, denn sie legen fest, welches Format und welche Meldebögen der Originator und der Sponsor einer Verbriefung sowie die Verbriefungszweckgesellschaft verwenden müssen, wenn sie den verschiedenen Parteien gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 Informationen über diese Verbriefung zur Verfügung stellen. Um zwischen diesen Bestimmungen, die gleichzeitig in Kraft treten sollten, Kohärenz zu gewährleisten und einen umfassenden Überblick über alle für die Verbriefung relevanten Angaben sowie einen problemlosen Zugriff darauf zu erleichtern, sollten diese technischen Durchführungsstandards in einer einzigen Verordnung zusammengefasst werden.

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

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

<sup>(3)</sup> Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1).

<sup>(4)</sup> Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1).

- (5) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (6) Die ESMA hat zu diesem Entwurf eine offene öffentliche Konsultation durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(5)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### ABSCHNITT 1

### FÜR ALLE VERBRIEFUNGEN GELTENDE MELDEBÖGEN

#### Artikel 1

### Meldebögen für die zugrunde liegenden Risikopositionen

(1) Die in Artikel 2 Absätze 1 und 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission <sup>(6)</sup> genannten Angaben sind auf folgenden Meldebögen auszuweisen:

- a) Angaben zu wohnimmobilienbesicherten Krediten an private Haushalte unabhängig vom Zweck der Kreditvergabe auf dem Meldebogen in Anhang II
- b) Angaben zu Krediten, die dem Ankauf von Gewerbeimmobilien dienen oder durch Gewerbeimmobilien besichert sind, auf dem Meldebogen in Anhang III
- c) Angaben zu zugrunde liegenden Unternehmensrisikopositionen, worunter auch Kredite an Kleinst-, Klein- und mittlere Unternehmen fallen, auf dem Meldebogen in Anhang IV
- d) Angaben zu zugrunde liegenden KFZ-Risikopositionen, worunter auch KFZ-besicherte Kredit- und Leasingverträge mit juristischen oder natürlichen Personen fallen, auf dem Meldebogen in Anhang V
- e) Angaben zu zugrunde liegenden Konsumentenrisikopositionen auf dem Meldebogen in Anhang VI
- f) Angaben zu zugrunde liegenden Kreditkartenrisikopositionen auf dem Meldebogen in Anhang VII
- g) Angaben zu zugrunde liegenden Leasingrisikopositionen auf dem Meldebogen in Anhang VIII
- h) Angaben zu zugrunde liegenden Risikopositionen, die unter keine der unter den Buchstaben a bis g genannten Kategorien fallen, auf dem Meldebogen in Anhang IX.

(2) Die in Artikel 2 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf folgenden Meldebögen auszuweisen:

- a) den für die Art des jeweils zugrunde liegenden Vermögenswerts relevanten Meldebögen des Absatzes 1
- b) Angaben zu den in Artikel 2 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Verbriefungen notleidender Risikopositionen auf dem Meldebogen in Anhang X.

(3) Die in Artikel 2 Absatz 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf den Meldebögen in Anhang XI auszuweisen.

<sup>(5)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

<sup>(6)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (siehe Seite 1 dieses Amtsblatts).

*Artikel 2***Meldebögen für den Anlegerbericht**

- (1) Die in Artikel 3 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf dem Meldebogen in Anhang XII auszuweisen.
- (2) Die in Artikel 3 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf dem Meldebogen in Anhang XIII auszuweisen.

## ABSCHNITT 2

**MELDEBÖGEN FÜR VERBRIEFUNGEN, FÜR DIE EIN PROSPEKT ERSTELLT WERDEN MUSS (ÖFFENTLICHE VERBRIEFUNGEN)***Artikel 3***Meldebögen für Insiderinformationen**

- (1) Die in Artikel 6 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf dem Meldebogen in Anhang XIV auszuweisen.
- (2) Die in Artikel 6 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf dem Meldebogen in Anhang XV auszuweisen.

*Artikel 4***Meldebögen für wichtige Ereignisse**

- (1) Die in Artikel 7 Absatz 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf dem Meldebogen in Anhang XIV auszuweisen.
- (2) Die in Artikel 7 Absatz 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 genannten Angaben sind auf dem Meldebogen in Anhang XV auszuweisen.

## ABSCHNITT 3

**GEMEINSAME BESTIMMUNGEN***Artikel 5***Format der Angaben**

- (1) Das Format der in den Meldebögen der Anhänge I bis XV gelieferten Angaben muss mit dem entsprechenden Format in Anhang I Tabelle 1 übereinstimmen.
- (2) Die Angaben sind in elektronischer, maschinenlesbarer Form über gemeinsame XML-Vorlagen zu übermitteln.

*Artikel 6***Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 29. Oktober 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER

---

## ANHANG I

## Feldformate

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Eingabe im ASCII-Format (in Großbuchstaben ohne Akzentzeichen).
{COUNTRYCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode in ISO 3166-1. Eingabe im ASCII-Format (in Großbuchstaben ohne Akzentzeichen).
{CURRENCYCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungsabkürzungen in ISO 4217. Eingabe im ASCII-Format (in Großbuchstaben ohne Akzentzeichen).
{YEAR}	Jahresangabe nach ISO 8601	Jahreszahl wie folgt angeben: JJJJ
{DATEFORMAT}	Datumsangabe nach ISO 8601	Daten wie folgt angeben: JJJJ-MM-TT
{MONETARY}	0-18 Stellen, von denen bis zu 5 Nachkommastellen sein können	Anzahl von Geldeinheiten, die in einer Währung ausgedrückt sind, wobei die Währungseinheit eindeutig identifizierbar ist und ISO 4217 entspricht.
{NUMERIC}	0-18 Stellen, von denen bis zu 5 Nachkommastellen sein können	Bis zu 18 numerische Zeichen mit bis zu fünf Dezimalstellen. Das Dezimaltrennzeichen wird nicht als numerisches Zeichen gezählt. Die Angabe erfolgt in Form eines Punkts.
{INTEGER-n}	Ganze Zahl bis maximal n	Numerisches Feld für positive und negative ganzzahlige Werte.
{Y/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„ja“ — Y „nein“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code nach ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung nach ISO 17442
{LIST}		In der jeweiligen Feldbeschreibung genannte Angabe
{NUTS}	5 alphanumerische Zeichen	Bezieht sich auf die von Eurostat geführte Systematik der Gebietseinheiten für die Statistik. Die Angaben sind auf NUTS-3-Ebene bereitzustellen. <a href="http://ec.europa.eu/eurostat/web/nuts/">http://ec.europa.eu/eurostat/web/nuts/</a>
{NACE}	7 alphanumerische Zeichen	Bezieht sich auf die in der Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(1)</sup> festgelegte statistische Systematik der Wirtschaftszweige in der Europäischen Union, auf die über die in diesem Kasten angegebene Webseite zugegriffen werden kann. Für jeden Wirtschaftszweig sind die Angaben auf der detailliertesten Stufe zu machen (anzugeben ist also der vollständige, samt Dezimalen aus 6 oder 7 Zeichen bestehende Code). <a href="http://ec.europa.eu/competition/mergers/cases/index/nace_all.html">http://ec.europa.eu/competition/mergers/cases/index/nace_all.html</a>

SYMBOL	DATENTYP	DEFINITION
{PERCENTAGE}	0-11 Stellen, von denen bis zu 10 Nachkommastellen sein können	Der Satz wird in Prozent, d. h. in Hundertsteln ausgedrückt: folglich sind 0,7 sieben Zehntel eines Prozents und 7,0 sieben Prozent.
{TELEPHONE}	Ein „+“ gefolgt von der Ländervorwahl (zwischen einem und drei Zeichen), einem „-“ und anschließend daran einer beliebigen Zahlenkombination, „(“,“)“, „+“ und „-“ (maximal 30 Zeichen).	Angabe, die die Ermittlung einer von den Telekomdiensten zugewiesenen Telefonnummer ermöglicht.
{ESA}	7 alphanumerische Zeichen	Das Europäische System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen 2010 unter Verwendung der Codes, die in Anhang I Tabelle 1 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission <sup>(2)</sup> festgelegt sind. <a href="http://ec.europa.eu/eurostat/cache/metadata/Annexes/nasa_10_f_esms_an1.pdf">http://ec.europa.eu/eurostat/cache/metadata/Annexes/nasa_10_f_esms_an1.pdf</a>
{WATCHLIST}	2 alphanumerische Zeichen	Der in Anhang I Tabelle 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 festgelegte Servicer-Watchlist-Code.

(<sup>1</sup>) Verordnung (EG) Nr. 1893/2006 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Dezember 2006 zur Aufstellung der statistischen Systematik der Wirtschaftszweige NACE Revision 2 und zur Änderung der Verordnung (EWG) Nr. 3037/90 des Rates sowie einiger Verordnungen der EG über bestimmte Bereiche der Statistik (ABl. L 393 vom 30.12.2006, S. 1).

(<sup>2</sup>) Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (siehe Seite ... dieses Amtsblatts).

## ANHANG II

**Meldebogen für die zugrunde liegenden risikopositionen — wohnimmobilien (RRE-Residential real estate)**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
<b>RREL1</b>	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
<b>RREL2</b>	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>RREL3</b>	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>RREL4</b>	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
<b>RREL5</b>	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
<b>RREL6</b>	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
<b>RREL7</b>	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
<b>RREL8</b>	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
<b>RREL9</b>	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>RREL10</b>	Gebietsansässiger	{Y/N}
<b>RREL11</b>	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
<b>RREL12</b>	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
<b>RREL13</b>	Beschäftigungsstatus	{LIST}
<b>RREL14</b>	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
<b>RREL15</b>	Kudentyp	{LIST}
<b>RREL16</b>	Primäreinkommen	{MONETARY}
<b>RREL17</b>	Art des Primäreinkommens	{LIST}
<b>RREL18</b>	Währung des Primäreinkommens	{CURRENCYCODE_3}
<b>RREL19</b>	Überprüfung des Primäreinkommens	{LIST}
<b>RREL20</b>	Sekundäreinkommen	{MONETARY}
<b>RREL21</b>	Überprüfung des Sekundäreinkommens	{LIST}
<b>RREL22</b>	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
<b>RREL23</b>	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
<b>RREL24</b>	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
RREL25	Ursprüngliche Laufzeit	{INTEGER-9999}
RREL26	Originierungskanal	{LIST}
RREL27	Zweck	{LIST}
RREL28	Währung	{CURRENCYCODE_3}
RREL29	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
RREL30	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
RREL31	Frühere Kapitalsalden	{MONETARY}
RREL32	Gleichrangige zugrunde liegende Risikopositionen	{MONETARY}
RREL33	Gesamtkreditlimit	{MONETARY}
RREL34	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
RREL35	Tilgungsart	{LIST}
RREL36	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
RREL37	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
RREL38	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
RREL39	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
RREL40	Verhältnis zwischen Schulden und Einkommen	{PERCENTAGE}
RREL41	Schlussrate	{MONETARY}
RREL42	Zinssatzart	{LIST}
RREL43	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
RREL44	Aktueller Zinsindex	{LIST}
RREL45	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
RREL46	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
RREL47	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
RREL48	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
RREL49	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
RREL50	Revisionsmarge 1	{PERCENTAGE}
RREL51	Zinsrevisionsdatum 1	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
RREL52	Revisionsmarge 2	{PERCENTAGE}
RREL53	Zinsrevisionsdatum 2	{DATEFORMAT}
RREL54	Revisionsmarge 3	{PERCENTAGE}
RREL55	Zinsrevisionsdatum 3	{DATEFORMAT}
RREL56	Revidierter Zinsindex	{LIST}
RREL57	Laufzeit des revidierten Zinsindex	{LIST}
RREL58	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
RREL59	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	{PERCENTAGE}
RREL60	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	{DATEFORMAT}
RREL61	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}
RREL62	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}
RREL63	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}
RREL64	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	{MONETARY}
RREL65	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}
RREL66	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
RREL67	Rückstandssaldo	{MONETARY}
RREL68	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
RREL69	Kontostatus	{LIST}
RREL70	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
RREL71	Ausfallbetrag	{MONETARY}
RREL72	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
RREL73	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
RREL74	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
RREL75	Rechtsstreit	{Y/N}
RREL76	Rückgriff	{Y/N}
RREL77	Einlagenbetrag	{MONETARY}
RREL78	Anbieter von Versicherungen oder Vermögensanlagen	{ALPHANUM-1000}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
RREL79	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
RREL80	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
RREL81	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}
RREL82	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
RREL83	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
RREL84	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}

#### Angaben zu Sicherheiten

RREC1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
RREC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
RREC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
RREC4	Neue Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
RREC5	Art der Sicherheit	{LIST}
RREC6	Geografische Region — Sicherheit	{NUTS}
RREC7	Art der Nutzung	{LIST}
RREC8	Sicherungsrechte	{INTEGER-9999}
RREC9	Immobilienart	{LIST}
RREC10	Energieeffizienzausweis	{LIST}
RREC11	Aussteller des Energieeffizienzausweises	{ALPHANUM-100}
RREC12	Aktuelle Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
RREC13	Aktueller Bewertungsbetrag	{MONETARY}
RREC14	Aktuelle Bewertungsmethode	{LIST}
RREC15	Aktuelles Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
RREC16	Ursprüngliche Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
RREC17	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	{MONETARY}
RREC18	Ursprüngliche Bewertungsmethode	{LIST}
RREC19	Ursprüngliches Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
RREC20	Verkaufsdatum	{DATEFORMAT}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>RREC21</b>	Verkaufspreis	{MONETARY}
<b>RREC22</b>	Währung der Sicherheit	{CURRENCYCODE_3}
<b>RREC23</b>	Art des Garantiegebers	{LIST}

## ANHANG III

**Meldebogen für die zugrunde liegenden Risikopositionen — gewerbeimmobilien (CRE —  
Commercial real estate)**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
CREL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
CREL2	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
CREL3	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
CREL4	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CREL5	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CREL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
CREL7	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
CREL8	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}
CREL9	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
CREL10	Datum der Substitution	{DATEFORMAT}
CREL11	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
CREL12	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
CREL13	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
CREL14	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
CREL15	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
CREL16	Tilgungsbeginn	{DATEFORMAT}
CREL17	Fälligkeitstermin am Verbriefungsdatum	{DATEFORMAT}
CREL18	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
CREL19	Ursprüngliche Laufzeit	{INTEGER-9999}
CREL20	Dauer der Verlängerungsoption	{INTEGER-9999}
CREL21	Art der Verlängerungsoption	{LIST}
CREL22	Währung	{CURRENCYCODE_3}
CREL23	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CREL24	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
CREL25	Ursprünglicher Kapitalsaldo am Verbriefungsdatum	{MONETARY}
CREL26	Zugesicherter nicht in Anspruch genommener Saldo der zugrunde liegenden Risikoposition	{MONETARY}
CREL27	Summe der sonstigen offenen Beträge	{MONETARY}
CREL28	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
CREL29	Datum der letzten Nutzung	{DATEFORMAT}
CREL30	Zweck	{LIST}
CREL31	Struktur	{LIST}
CREL32	A-B-Wasserfall für planmäßige Zinszahlungen vor Vollstreckung	{LIST}
CREL33	A-B-Wasserfall für planmäßige Kapitalrückzahlungen vor Vollstreckung	{LIST}
CREL34	Zuweisung von Kapitalrückzahlungen für vorrangige Darlehen	{PERCENTAGE}
CREL35	Art des Wasserfalls	{LIST}
CREL36	Kaufpreis für ausfallende zugrunde liegende Risikoposition	{PERCENTAGE}
CREL37	Möglichkeit einer Zahlungsübernahme?	{LIST}
CREL38	Beschränkungen des Verkaufs nachrangiger Darlehen?	{Y/N}
CREL39	Ist der Inhaber eines nachrangigen Darlehens mit dem Schuldner verbunden?	{Y/N}
CREL40	Kontrolle des Abwicklungsprozesses durch Inhaber nachrangiger Darlehen	{Y/N}
CREL41	Stellen Nichtzahlungen bei vorrangig gesicherten Forderungen einen Ausfall der zugrunde liegenden Risikoposition dar?	{Y/N}
CREL42	Stellen Nichtzahlungen bei zugrunde liegenden Risikopositionen gleichen Ranges einen Immobilienausfall dar?	{Y/N}
CREL43	Einwilligung der Investoren	{Y/N}
CREL44	Nächste Investorenversammlung	{DATEFORMAT}
CREL45	Syndizierung	{Y/N}
CREL46	Beteiligung der Verbriefungszweckgesellschaft	{LIST}
CREL47	Folgen bei Nichteinhaltung der Finanzkennzahl	{LIST}
CREL48	Strafen bei Nichtvorlage von Finanzdaten	{Y/N}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CREL49	Rückgriff	{Y/N}
CREL50	Rückgriff — Dritte	{Y/N}
CREL51	Servicing-Standard	{Y/N}
CREL52	Hinterlegte Beträge	{MONETARY}
CREL53	Einziehung von Hinterlegungen	{Y/N}
CREL54	Einziehung sonstiger Rücklagen	{Y/N}
CREL55	Trigger für Hinterlegung	{LIST}
CREL56	Ziel für Hinterlegungsbeträge/Rücklagen	{MONETARY}
CREL57	Freigabebedingungen für Hinterlegungskonto	{ALPHANUM-1000}
CREL58	Bedingungen für die Inanspruchnahme der Barreserve	{LIST}
CREL59	Währung des Hinterlegungskontos	{CURRENCYCODE_3}
CREL60	Währung der hinterlegten Zahlungen	{CURRENCYCODE_3}
CREL61	Rücklagengesamtsaldo	{MONETARY}
CREL62	Währung des Rücklagensaldos	{CURRENCYCODE_3}
CREL63	Hinterlegungs-Trigger eingetreten?	{Y/N}
CREL64	Hinterlegte Beträge in aktueller Periode	{MONETARY}
CREL65	Einnahmen	{MONETARY}
CREL66	Betriebskosten am Verbriefungsdatum	{MONETARY}
CREL67	Investitionsaufwendungen am Verbriefungsdatum	{MONETARY}
CREL68	Währung des Abschlusses	{CURRENCYCODE_3}
CREL69	Verstoß gegen Berichtspflicht durch Schuldner	{Y/N}
CREL70	Methode für die Berechnung der Schuldendeckungsquote	{LIST}
CREL71	Indikator der Schuldendeckungsquote am Verbriefungsdatum	{LIST}
CREL72	Indikator der aktuellsten Schuldendeckungsquote	{LIST}
CREL73	Schuldendeckungsquote am Verbriefungsdatum	{PERCENTAGE}
CREL74	Aktuelle Schuldendeckungsquote	{PERCENTAGE}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>CREL75</b>	Ursprüngliche Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
<b>CREL76</b>	Aktuelle Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
<b>CREL77</b>	Zinsdeckungsquote am Verbriefungsdatum	{PERCENTAGE}
<b>CREL78</b>	Aktuelle Zinsdeckungsquote	{PERCENTAGE}
<b>CREL79</b>	Berechnungsmethode für Zinsdeckungsquote	{LIST}
<b>CREL80</b>	Anzahl der Immobilien am Verbriefungsdatum	{INTEGER-9999}
<b>CREL81</b>	Anzahl der Immobilien zum Datenstichtag	{INTEGER-9999}
<b>CREL82</b>	Immobilien zur Besicherung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>CREL83</b>	Immobilienportfoliowert am Verbriefungsdatum	{MONETARY}
<b>CREL84</b>	Währung der Immobilienportfoliobewertung am Verbriefungsdatum	{CURRENCYCODE_3}
<b>CREL85</b>	Status der Immobilien	{LIST}
<b>CREL86</b>	Bewertungsdatum am Verbriefungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREL87</b>	Tilgungsart	{LIST}
<b>CREL88</b>	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
<b>CREL89</b>	Zulässige tilgungsfreie Periode in Tagen	{INTEGER-9999}
<b>CREL90</b>	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
<b>CREL91</b>	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
<b>CREL92</b>	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
<b>CREL93</b>	Beschreibung der Vorfälligkeitsbedingungen	{ALPHANUM-100}
<b>CREL94</b>	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	{DATEFORMAT}
<b>CREL95</b>	Wegfall des Vorfälligkeitsentgelts	{DATEFORMAT}
<b>CREL96</b>	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}
<b>CREL97</b>	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}
<b>CREL98</b>	Außerplanmäßige Kapitaleinziehungen	{MONETARY}
<b>CREL99</b>	Datum der Liquidation/vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}
<b>CREL100</b>	Code der Liquidation/vorzeitigen Rückzahlung	{LIST}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>CREL101</b>	Zinsmehrzahlung/-minderzahlung aufgrund vorzeitiger Rückzahlungen	{MONETARY}
<b>CREL102</b>	Zahlungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREL103</b>	Nächstes Zahlungsanpassungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREL104</b>	Nächstes Zahlungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREL105</b>	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
<b>CREL106</b>	Ursprünglicher Zinssatz	{PERCENTAGE}
<b>CREL107</b>	Zinssatz am Verbriefungsdatum	{PERCENTAGE}
<b>CREL108</b>	Erstes Zahlungsanpassungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREL109</b>	Zinssatzart	{LIST}
<b>CREL110</b>	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
<b>CREL111</b>	Aktueller Zinsindex	{LIST}
<b>CREL112</b>	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
<b>CREL113</b>	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
<b>CREL114</b>	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
<b>CREL115</b>	Aktueller Indexsatz	{PERCENTAGE}
<b>CREL116</b>	Indexfestsetzungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREL117</b>	Rundungsinkrement	{PERCENTAGE}
<b>CREL118</b>	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
<b>CREL119</b>	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
<b>CREL120</b>	Aktueller Verzugszins	{PERCENTAGE}
<b>CREL121</b>	Auflaufen von Zinsen zulässig?	{Y/N}
<b>CREL122</b>	Zinsberechnungsmethode	{LIST}
<b>CREL123</b>	Planmäßige Kapital- und Zinsgesamtfälligkeit	{MONETARY}
<b>CREL124</b>	Planmäßige Kapital- und Zinsgesamtzahlungen	{MONETARY}
<b>CREL125</b>	Negative Tilgung	{MONETARY}
<b>CREL126</b>	Aufgeschobene Zinsen	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CREL127	Gesamtminderzahlung bei offenen Kapital- und Zinsbeträgen	{MONETARY}
CREL128	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
CREL129	Rückstandssaldo	{MONETARY}
CREL130	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
CREL131	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
CREL132	Ausfallbetrag	{MONETARY}
CREL133	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
CREL134	Nachträgliche Zinszahlung	{Y/N}
CREL135	Tatsächliche Verzugszinsen	{MONETARY}
CREL136	Kontostatus	{LIST}
CREL137	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
CREL138	Nettoerlöse bei Liquidation	{MONETARY}
CREL139	Liquidationskosten	{MONETARY}
CREL140	Voraussichtlicher Zeitpunkt von Rückflüssen	{INTEGER-9999}
CREL141	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
CREL142	Vollstreckungsbeginn	{DATEFORMAT}
CREL143	Code der Abwicklungsstrategie	{LIST}
CREL144	Änderung	{LIST}
CREL145	Special Servicing-Status	{Y/N}
CREL146	Datum der letzten Übertragung an Special Servicer	{DATEFORMAT}
CREL147	Datum der letzten Rückübertragung an Primary Servicer	{DATEFORMAT}
CREL148	Uneinbringlichkeit festgestellt	{Y/N}
CREL149	Nichteinhaltung der Finanzkennzahl/Trigger	{LIST}
CREL150	Datum des Verstoßes	{DATEFORMAT}
CREL151	Datum der Behebung des Verstoßes	{DATEFORMAT}
CREL152	Code der Servicer-Watchlist	{WATCHLIST}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CREL153	Datum der Servicer-Watchlist	{DATEFORMAT}
CREL154	Zinsswap-Anbieter	{ALPHANUM-1000}
CREL155	Rechtsträgerkennung des Zinsswap-Anbieters	{LEI}
CREL156	Fälligkeit des Zinsswaps	{DATEFORMAT}
CREL157	Nominalbetrag des Zinsswaps	{MONETARY}
CREL158	Währungsswap-Anbieter	{ALPHANUM-1000}
CREL159	Rechtsträgerkennung des Währungsswap-Anbieters	{LEI}
CREL160	Fälligkeit des Währungsswaps	{DATEFORMAT}
CREL161	Nominalbetrag des Währungsswaps	{MONETARY}
CREL162	Swap-Wechselkurs	{PERCENTAGE}
CREL163	Anderer Swap-Anbieter	{ALPHANUM-1000}
CREL164	Rechtsträgerkennung des anderen Swap-Anbieters	{LEI}
CREL165	Pflicht des Schuldners zur Zahlung von Zinsauflösungskosten auf Swap	{LIST}
CREL166	Vollständige oder teilweise Kündigung des Swaps für aktuelle Periode	{LIST}
CREL167	Periodische Nettozahlung des Swap-Anbieters	{MONETARY}
CREL168	An den Anbieter des Swaps für die zugrunde liegende Risikoposition zu zahlende Vertragsauflösungskosten	{MONETARY}
CREL169	Minderzahlung bei Vertragsauflösungskosten auf Swap	{MONETARY}
CREL170	Von der Swap-Gegenpartei zu zahlende Vertragsauflösungskosten	{MONETARY}
CREL171	Datum der nächsten Anpassung des Swaps	{DATEFORMAT}
CREL172	Sponsor	{ALPHANUM-100}
CREL173	Rechtsträgerkennung der Korrespondenzbank der Syndizierung	{LEI}
CREL174	Rechtsträgerkennung des Servicers	{LEI}
CREL175	Name des Servicers	{ALPHANUM-100}
CREL176	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
CREL177	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
CREL178	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CREL179	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
CREL180	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
CREL181	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}

#### Angaben zu Sicherheiten

CREC1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
CREC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CREC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
CREC4	Neue Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
CREC5	Art der Sicherheit	{LIST}
CREC6	Name der Immobilie	{ALPHANUM-100}
CREC7	Adresse der Immobilie	{ALPHANUM-1000}
CREC8	Geografische Region — Sicherheit	{NUTS}
CREC9	Postleitzahl der Immobilie	{ALPHANUM-100}
CREC10	Sicherungsrechte	{INTEGER-9999}
CREC11	Immobilienstatus	{LIST}
CREC12	Immobilienart	{LIST}
CREC13	Form des Eigentumstitels	{LIST}
CREC14	Aktuelles Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
CREC15	Aktueller Bewertungsbetrag	{MONETARY}
CREC16	Aktuelle Bewertungsmethode	{LIST}
CREC17	Aktuelle Bewertungsbasis	{LIST}
CREC18	Ursprüngliche Bewertungsmethode	{LIST}
CREC19	Verbriefungsdatum	{DATEFORMAT}
CREC20	Zugewiesener Prozentsatz der zugrunde liegenden Risikoposition am Verbriefungsdatum	{PERCENTAGE}
CREC21	Aktueller zugewiesener Anteil der zugrunde liegenden Risikoposition	{PERCENTAGE}
CREC22	Bewertung bei Verbriefung	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>CREC23</b>	Name des Gutachters bei Verbriefung	{ALPHANUM-100}
<b>CREC24</b>	Datum der Bewertung bei Verbriefung	{DATEFORMAT}
<b>CREC25</b>	Baujahr	{YEAR}
<b>CREC26</b>	Jahr der letzten Renovierung	{YEAR}
<b>CREC27</b>	Anzahl der Einheiten	{INTEGER-999999999}
<b>CREC28</b>	Nettoquadratmeter	{INTEGER-999999999}
<b>CREC29</b>	Gewerbliche Fläche	{INTEGER-999999999}
<b>CREC30</b>	Wohnfläche	{INTEGER-999999999}
<b>CREC31</b>	Validierung der Nettowohnfläche	{Y/N}
<b>CREC32</b>	Aktueller Stand der Nutzung	{DATEFORMAT}
<b>CREC33</b>	Wirtschaftlicher Vermietungsgrad bei Verbriefung	{PERCENTAGE}
<b>CREC34</b>	Physische Nutzung bei Verbriefung	{PERCENTAGE}
<b>CREC35</b>	Wert der leer stehenden Immobilie am Verbriefungsdatum	{MONETARY}
<b>CREC36</b>	Datum der Finanzdaten bei Verbriefung	{DATEFORMAT}
<b>CREC37</b>	Nettobetriebsergebnis bei Verbriefung	{MONETARY}
<b>CREC38</b>	Letzte Finanzdaten zum Startdatum	{DATEFORMAT}
<b>CREC39</b>	Letzte Finanzdaten zum Enddatum	{DATEFORMAT}
<b>CREC40</b>	Letzte Einnahmen	{MONETARY}
<b>CREC41</b>	Letzte Betriebskosten	{MONETARY}
<b>CREC42</b>	Letzter Investitionsaufwand	{MONETARY}
<b>CREC43</b>	Zahlbare Grundstückspacht	{MONETARY}
<b>CREC44</b>	Gewichtete durchschnittliche Mietdauer	{INTEGER-9999}
<b>CREC45</b>	Ablauf der Grundstückspacht	{DATEFORMAT}
<b>CREC46</b>	Vertragliche Jahresmieteinnahmen	{MONETARY}
<b>CREC47</b>	Einnahmen mit Ablauf in 1-12 Monaten	{PERCENTAGE}
<b>CREC48</b>	Einnahmen mit Ablauf in 13-24 Monaten	{PERCENTAGE}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>CREC49</b>	Einnahmen mit Ablauf in 25-36 Monaten	{PERCENTAGE}
<b>CREC50</b>	Einnahmen mit Ablauf in 37-48 Monaten	{PERCENTAGE}
<b>CREC51</b>	Einnahmen mit Ablauf in 49 oder mehr Monaten	{PERCENTAGE}

**Angaben zum Mieter**

<b>CRET1</b>	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
<b>CRET2</b>	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>CRET3</b>	Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
<b>CRET4</b>	Kennung des Mieters	{ALPHANUM-1000}
<b>CRET5</b>	Name des Mieters	{ALPHANUM-100}
<b>CRET6</b>	NACE-Branchencode	{NACE}
<b>CRET7</b>	Datum des Mietauslaufs	{DATEFORMAT}
<b>CRET8</b>	Zahlbare Miete	{MONETARY}
<b>CRET9</b>	Währung der Miete	{CURRENCYCODE_3}

## ANHANG IV

**Meldebogen für die zugrunde liegenden risikopositionen — Unternehmen**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
<b>CRPL1</b>	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
<b>CRPL2</b>	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPL3</b>	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPL4</b>	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPL5</b>	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPL6</b>	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
<b>CRPL7</b>	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
<b>CRPL8</b>	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CRPL9</b>	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CRPL10</b>	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
<b>CRPL11</b>	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
<b>CRPL12</b>	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
<b>CRPL13</b>	Kudentyp	{LIST}
<b>CRPL14</b>	NACE-Branchencode	{NACE}
<b>CRPL15</b>	Basel III-Segment des Schuldners	{LIST}
<b>CRPL16</b>	Unternehmensgröße	{LIST}
<b>CRPL17</b>	Einnahmen	{MONETARY}
<b>CRPL18</b>	Gesamtschulden	{MONETARY}
<b>CRPL19</b>	EBITDA	{MONETARY}
<b>CRPL20</b>	Unternehmenswert	{MONETARY}
<b>CRPL21</b>	Freier Cashflow	{MONETARY}
<b>CRPL22</b>	Datum der Finanzdaten	{DATEFORMAT}
<b>CRPL23</b>	Währung des Abschlusses	{CURRENCYCODE_3}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CRPL24	Art der Schuld	{LIST}
CRPL25	Verbriefte Forderungen	{LIST}
CRPL26	Internationale Wertpapierkennnummer	{ISIN}
CRPL27	Rang	{LIST}
CRPL28	Syndizierung	{Y/N}
CRPL29	Fremdfinanzierte Transaktion	{Y/N}
CRPL30	CLO-Verwaltung	{Y/N}
CRPL31	Zahlung in Sachleistungen	{Y/N}
CRPL32	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
CRPL33	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
CRPL34	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
CRPL35	Originierungskanal	{LIST}
CRPL36	Zweck	{LIST}
CRPL37	Währung	{CURRENCYCODE_3}
CRPL38	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
CRPL39	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
CRPL40	Frühere Kapitalsalden	{MONETARY}
CRPL41	Marktwert	{MONETARY}
CRPL42	Gesamtkreditlimit	{MONETARY}
CRPL43	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
CRPL44	Kündigungstermin	{DATEFORMAT}
CRPL45	Verkaufsoption	{MONETARY}
CRPL46	Tilgungsart	{LIST}
CRPL47	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
CRPL48	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
CRPL49	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>CRPL50</b>	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
<b>CRPL51</b>	Schlussrate	{MONETARY}
<b>CRPL52</b>	Zinssatzart	{LIST}
<b>CRPL53</b>	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
<b>CRPL54</b>	Aktueller Zinsindex	{LIST}
<b>CRPL55</b>	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	{LIST}
<b>CRPL56</b>	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
<b>CRPL57</b>	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
<b>CRPL58</b>	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
<b>CRPL59</b>	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
<b>CRPL60</b>	Revisionsmarge 1	{PERCENTAGE}
<b>CRPL61</b>	Zinsrevisionsdatum 1	{DATEFORMAT}
<b>CRPL62</b>	Revisionsmarge 2	{PERCENTAGE}
<b>CRPL63</b>	Zinsrevisionsdatum 2	{DATEFORMAT}
<b>CRPL64</b>	Revisionsmarge 3	{PERCENTAGE}
<b>CRPL65</b>	Zinsrevisionsdatum 3	{DATEFORMAT}
<b>CRPL66</b>	Revidierter Zinsindex	{LIST}
<b>CRPL67</b>	Laufzeit des revidierten Zinsindexes	{LIST}
<b>CRPL68</b>	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
<b>CRPL69</b>	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	{PERCENTAGE}
<b>CRPL70</b>	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	{DATEFORMAT}
<b>CRPL71</b>	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}
<b>CRPL72</b>	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}
<b>CRPL73</b>	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}
<b>CRPL74</b>	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	{MONETARY}
<b>CRPL75</b>	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CRPL76	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
CRPL77	Rückstandssaldo	{MONETARY}
CRPL78	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
CRPL79	Kontostatus	{LIST}
CRPL80	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
CRPL81	Ausfallbetrag	{MONETARY}
CRPL82	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
CRPL83	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
CRPL84	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
CRPL85	Quelle von Rückzahlungen	{LIST}
CRPL86	Rückgriff	{Y/N}
CRPL87	Einlagenbetrag	{MONETARY}
CRPL88	Nominalbetrag des Zinsswaps	{MONETARY}
CRPL89	Rechtsträgerkennung des Zinsswap-Anbieters	{LEI}
CRPL90	Zinsswap-Anbieter	{ALPHANUM-1000}
CRPL91	Fälligkeit des Zinsswaps	{DATEFORMAT}
CRPL92	Nominalbetrag des Währungsswaps	{MONETARY}
CRPL93	Rechtsträgerkennung des Währungsswap-Anbieters	{LEI}
CRPL94	Währungsswap-Anbieter	{ALPHANUM-1000}
CRPL95	Fälligkeit des Währungsswaps	{DATEFORMAT}
CRPL96	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
CRPL97	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
CRPL98	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}
CRPL99	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
CRPL100	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
CRPL101	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu Sicherheiten</b>		
<b>CRPC1</b>	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
<b>CRPC2</b>	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPC3</b>	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPC4</b>	Neue Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
<b>CRPC5</b>	Geografische Region — Sicherheit	{NUTS}
<b>CRPC6</b>	Art der Sicherung	{LIST}
<b>CRPC7</b>	Art der Belastung	{LIST}
<b>CRPC8</b>	Sicherungsrechte	{INTEGER-9999}
<b>CRPC9</b>	Art der Sicherheit	{LIST}
<b>CRPC10</b>	Aktueller Bewertungsbetrag	{MONETARY}
<b>CRPC11</b>	Aktuelle Bewertungsmethode	{LIST}
<b>CRPC12</b>	Aktuelles Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CRPC13</b>	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	{MONETARY}
<b>CRPC14</b>	Ursprüngliche Bewertungsmethode	{LIST}
<b>CRPC15</b>	Ursprüngliches Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CRPC16</b>	Verkaufsdatum	{DATEFORMAT}
<b>CRPC17</b>	Verkaufspreis	{MONETARY}
<b>CRPC18</b>	Währung der Sicherheit	{CURRENCYCODE_3}
<b>CRPC19</b>	Land des Garantiegebers	{COUNTRYCODE_2}
<b>CRPC20</b>	ESVG-Teilektor des Garantiegebers	{ESA}

## ANHANG V

## Meldebogen für die zugrunde liegenden risikopositionen — Kraftfahrzeuge

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
AUTL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
AUTL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
AUTL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
AUTL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
AUTL5	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
AUTL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
AUTL7	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
AUTL8	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
AUTL9	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
AUTL10	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
AUTL11	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
AUTL12	Beschäftigungsstatus	{LIST}
AUTL13	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
AUTL14	Rechtsform des Schuldners	{LIST}
AUTL15	Kudentyp	{LIST}
AUTL16	Primäreinkommen	{MONETARY}
AUTL17	Art des Primäreinkommens	{LIST}
AUTL18	Währung des Primäreinkommens	{CURRENCYCODE_3}
AUTL19	Überprüfung des Primäreinkommens	{LIST}
AUTL20	Einnahmen	{MONETARY}
AUTL21	Währung des Abschlusses	{CURRENCYCODE_3}
AUTL22	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
AUTL23	Art des Produkts	{LIST}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
AUTL24	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
AUTL25	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
AUTL26	Ursprüngliche Laufzeit	{INTEGER-9999}
AUTL27	Originierungskanal	{LIST}
AUTL28	Währung	{CURRENCYCODE_3}
AUTL29	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
AUTL30	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
AUTL31	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
AUTL32	Tilgungsart	{LIST}
AUTL33	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
AUTL34	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
AUTL35	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
AUTL36	Zahlungsmethode	{LIST}
AUTL37	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
AUTL38	Schlussrate	{MONETARY}
AUTL39	Anzahlungsbetrag	{MONETARY}
AUTL40	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
AUTL41	Aktueller Zinsindex	{LIST}
AUTL42	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
AUTL43	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
AUTL44	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
AUTL45	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
AUTL46	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
AUTL47	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
AUTL48	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	{PERCENTAGE}
AUTL49	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
AUTL50	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}
AUTL51	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}
AUTL52	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	{MONETARY}
AUTL53	Hersteller	{ALPHANUM-100}
AUTL54	Modell	{ALPHANUM-100}
AUTL55	Jahr der Zulassung	{YEAR}
AUTL56	Neu oder gebraucht	{LIST}
AUTL57	Energieeffizienzausweis	{LIST}
AUTL58	Aussteller des Energieeffizienzausweises	{ALPHANUM-100}
AUTL59	Ursprüngliche Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
AUTL60	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	{MONETARY}
AUTL61	Ursprünglicher Restwert des Fahrzeugs	{MONETARY}
AUTL62	Preis bei Kaufoption	{MONETARY}
AUTL63	Verbriefter Restwert	{MONETARY}
AUTL64	Aktualisierter Restwert des Fahrzeugs	{MONETARY}
AUTL65	Datum der aktualisierten Restwertbestimmung des Fahrzeugs	{DATEFORMAT}
AUTL66	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}
AUTL67	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
AUTL68	Rückstandssaldo	{MONETARY}
AUTL69	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
AUTL70	Kontostatus	{LIST}
AUTL71	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
AUTL72	Ausfallbetrag	{MONETARY}
AUTL73	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
AUTL74	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
AUTL75	Restwertverluste	{MONETARY}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>AUTL76</b>	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
<b>AUTL77</b>	Verkaufspreis	{MONETARY}
<b>AUTL78</b>	Einlagenbetrag	{MONETARY}
<b>AUTL79</b>	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
<b>AUTL80</b>	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
<b>AUTL81</b>	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}
<b>AUTL82</b>	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
<b>AUTL83</b>	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
<b>AUTL84</b>	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}

## ANHANG VI

**Meldebogen für die zugrunde liegenden risikopositionen — Konsumenten**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
CMRL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
CMRL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CMRL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CMRL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
CMRL5	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
CMRL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
CMRL7	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
CMRL8	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
CMRL9	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
CMRL10	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
CMRL11	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
CMRL12	Beschäftigungsstatus	{LIST}
CMRL13	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
CMRL14	Kudentyp	{LIST}
CMRL15	Primäreinkommen	{MONETARY}
CMRL16	Art des Primäreinkommens	{LIST}
CMRL17	Währung des Primäreinkommens	{CURRENCYCODE_3}
CMRL18	Überprüfung des Primäreinkommens	{LIST}
CMRL19	Durch Lohn-/Pensionsabtretung besichert	{Y/N}
CMRL20	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
CMRL21	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
CMRL22	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
CMRL23	Ursprüngliche Laufzeit	{INTEGER-9999}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
CMRL24	Originierungskanal	{LIST}
CMRL25	Zweck	{LIST}
CMRL26	Währung	{CURRENCYCODE_3}
CMRL27	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
CMRL28	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
CMRL29	Gesamtkreditlimit	{MONETARY}
CMRL30	Revolvierendes Enddatum	{DATEFORMAT}
CMRL31	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
CMRL32	Tilgungsart	{LIST}
CMRL33	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
CMRL34	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
CMRL35	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
CMRL36	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
CMRL37	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
CMRL38	Aktueller Zinsindex	{LIST}
CMRL39	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	{LIST}
CMRL40	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
CMRL41	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
CMRL42	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
CMRL43	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
CMRL44	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
CMRL45	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	{PERCENTAGE}
CMRL46	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	{DATEFORMAT}
CMRL47	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}
CMRL48	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}
CMRL49	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>CMRL50</b>	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	{MONETARY}
<b>CMRL51</b>	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}
<b>CMRL52</b>	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
<b>CMRL53</b>	Rückstandssaldo	{MONETARY}
<b>CMRL54</b>	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
<b>CMRL55</b>	Kontostatus	{LIST}
<b>CMRL56</b>	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
<b>CMRL57</b>	Ausfallbetrag	{MONETARY}
<b>CMRL58</b>	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
<b>CMRL59</b>	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
<b>CMRL60</b>	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
<b>CMRL61</b>	Einlagenbetrag	{MONETARY}
<b>CMRL62</b>	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
<b>CMRL63</b>	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
<b>CMRL64</b>	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}
<b>CMRL65</b>	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
<b>CMRL66</b>	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
<b>CMRL67</b>	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}
<b>CMRL68</b>	Energieeffizienzausweis	{LIST}
<b>CMRL69</b>	Aussteller des Energieeffizienzausweises	{ALPHANUM-100}

## ANHANG VII

**Meldebogen für die zugrunde liegenden Risikopositionen — Kreditkarten**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
CCDL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
CCDL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CCDL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
CCDL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
CCDL5	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
CCDL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
CCDL7	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
CCDL8	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
CCDL9	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
CCDL10	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
CCDL11	Beschäftigungsstatus	{LIST}
CCDL12	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
CCDL13	Kudentyp	{LIST}
CCDL14	Primäreinkommen	{MONETARY}
CCDL15	Art des Primäreinkommens	{LIST}
CCDL16	Währung des Primäreinkommens	{CURRENCYCODE_3}
CCDL17	Überprüfung des Primäreinkommens	{LIST}
CCDL18	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
CCDL19	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
CCDL20	Originierungskanal	{LIST}
CCDL21	Währung	{CURRENCYCODE_3}
CCDL22	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
CCDL23	Gesamtkreditlimit	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>CCDL24</b>	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
<b>CCDL25</b>	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
<b>CCDL26</b>	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
<b>CCDL27</b>	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
<b>CCDL28</b>	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
<b>CCDL29</b>	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
<b>CCDL30</b>	Aktueller Zinsindex	{LIST}
<b>CCDL31</b>	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
<b>CCDL32</b>	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
<b>CCDL33</b>	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}
<b>CCDL34</b>	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
<b>CCDL35</b>	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
<b>CCDL36</b>	Rückstandssaldo	{MONETARY}
<b>CCDL37</b>	Kontostatus	{LIST}
<b>CCDL38</b>	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
<b>CCDL39</b>	Ausfallbetrag	{MONETARY}
<b>CCDL40</b>	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
<b>CCDL41</b>	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
<b>CCDL42</b>	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
<b>CCDL43</b>	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
<b>CCDL44</b>	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}
<b>CCDL45</b>	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
<b>CCDL46</b>	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
<b>CCDL47</b>	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}

## ANHANG VIII

## Meldebogen für die zugrunde liegenden Risikopositionen — Leasing

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
LESL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
LESL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
LESL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
LESL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
LESL5	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
LESL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
LESL7	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
LESL8	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
LESL9	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
LESL10	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
LESL11	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
LESL12	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
LESL13	Basel III-Segment des Schuldners	{LIST}
LESL14	Kudentyp	{LIST}
LESL15	NACE-Branchencode	{NACE}
LESL16	Unternehmensgröße	{LIST}
LESL17	Einnahmen	{MONETARY}
LESL18	Währung des Abschlusses	{CURRENCYCODE_3}
LESL19	Art des Produkts	{LIST}
LESL20	Syndizierung	{Y/N}
LESL21	Sonderregelungen	{ALPHANUM-10000}
LESL22	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
LESL23	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
LESL24	Ursprüngliche Laufzeit	{INTEGER-9999}
LESL25	Originierungskanal	{LIST}
LESL26	Währung	{CURRENCYCODE_3}
LESL27	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
LESL28	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
LESL29	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
LESL30	Verbriefter Restwert	{MONETARY}
LESL31	Tilgungsart	{LIST}
LESL32	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
LESL33	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
LESL34	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
LESL35	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
LESL36	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
LESL37	Aktueller Zinsindex	{LIST}
LESL38	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
LESL39	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
LESL40	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
LESL41	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
LESL42	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
LESL43	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
LESL44	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	{PERCENTAGE}
LESL45	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	{DATEFORMAT}
LESL46	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}
LESL47	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}
LESL48	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}
LESL49	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
LESL50	Preis bei Kaufoption	{MONETARY}
LESL51	Anzahlungsbetrag	{MONETARY}
LESL52	Aktueller Restwert des Vermögenswerts	{MONETARY}
LESL53	Datum der Umstrukturierung	{DATEFORMAT}
LESL54	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
LESL55	Rückstandssaldo	{MONETARY}
LESL56	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
LESL57	Kontostatus	{LIST}
LESL58	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
LESL59	Ausfallbetrag	{MONETARY}
LESL60	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
LESL61	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
LESL62	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
LESL63	Quelle von Rückzahlungen	{LIST}
LESL64	Einlagenbetrag	{MONETARY}
LESL65	Geografische Region — Sicherheit	{NUTS}
LESL66	Hersteller	{ALPHANUM-100}
LESL67	Modell	{ALPHANUM-100}
LESL68	Herstellungs-/Baujahr	{YEAR}
LESL69	Neu oder gebraucht	{LIST}
LESL70	Ursprünglicher Restwert des Vermögenswerts	{MONETARY}
LESL71	Art der Sicherheit	{LIST}
LESL72	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	{MONETARY}
LESL73	Ursprüngliche Bewertungsmethode	{LIST}
LESL74	Ursprüngliches Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
LESL75	Aktueller Bewertungsbetrag	{MONETARY}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>LESL76</b>	Aktuelle Bewertungsmethode	{LIST}
<b>LESL77</b>	Aktuelles Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>LESL78</b>	Zahl der Leasing-Objekte	{INTEGER-9999}
<b>LESL79</b>	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
<b>LESL80</b>	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
<b>LESL81</b>	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}
<b>LESL82</b>	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
<b>LESL83</b>	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
<b>LESL84</b>	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}

## ANHANG IX

**Meldebogen für die zugrunde liegenden risikopositionen — Keiner anderen kategorie  
zuordnungsfähige vermögenswerte („Esoteric exposures“)**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
ESTL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
ESTL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
ESTL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
ESTL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
ESTL5	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
ESTL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
ESTL7	Pool-Transferdatum	{DATEFORMAT}
ESTL8	Rückkaufsdatum	{DATEFORMAT}
ESTL9	Rückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
ESTL10	Beschreibung	{ALPHANUM-1000}
ESTL11	Geografische Region — Schuldner	{NUTS}
ESTL12	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
ESTL13	Beschäftigungsstatus	{LIST}
ESTL14	Schuldner mit beeinträchtigter Bonität	{Y/N}
ESTL15	Rechtsform des Schuldners	{LIST}
ESTL16	NACE-Branchencode	{NACE}
ESTL17	Primäreinkommen	{MONETARY}
ESTL18	Art des Primäreinkommens	{LIST}
ESTL19	Währung des Primäreinkommens	{CURRENCYCODE_3}
ESTL20	Überprüfung des Primäreinkommens	{LIST}
ESTL21	Einnahmen	{MONETARY}
ESTL22	Währung des Abschlusses	{CURRENCYCODE_3}
ESTL23	Internationale Wertpapierkennnummer	{ISIN}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
ESTL24	Datum der Originierung	{DATEFORMAT}
ESTL25	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
ESTL26	Währung	{CURRENCYCODE_3}
ESTL27	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
ESTL28	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
ESTL29	Gesamtkreditlimit	{MONETARY}
ESTL30	Kaufpreis	{PERCENTAGE}
ESTL31	Tilgungsart	{LIST}
ESTL32	Ende der tilgungsfreien Periode	{DATEFORMAT}
ESTL33	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen	{LIST}
ESTL34	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen	{LIST}
ESTL35	Zahlungsfälligkeit	{MONETARY}
ESTL36	Verhältnis zwischen Schulden und Einkommen	{PERCENTAGE}
ESTL37	Schlussrate	{MONETARY}
ESTL38	Zinsanpassungsintervall	{INTEGER-9999}
ESTL39	Aktueller Zinssatz	{PERCENTAGE}
ESTL40	Aktueller Zinsindex	{LIST}
ESTL41	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
ESTL42	Aktuelle Zinsmarge	{PERCENTAGE}
ESTL43	Zinsobergrenze	{PERCENTAGE}
ESTL44	Zinsuntergrenze	{PERCENTAGE}
ESTL45	Anzahl der Zahlungen vor Verbriefung	{INTEGER-9999}
ESTL46	Prozentsatz der zulässigen vorzeitigen Rückzahlungen pro Jahr	{PERCENTAGE}
ESTL47	Ende der Sperre für vorzeitige Rückzahlungen	{DATEFORMAT}
ESTL48	Vorfälligkeitsgebühr	{MONETARY}
ESTL49	Wegfall der Vorfälligkeitsgebühr	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
ESTL50	Datum der vorzeitigen Rückzahlung	{DATEFORMAT}
ESTL51	Kumulierte vorzeitige Rückzahlungen	{MONETARY}
ESTL52	Datum des letzten Rückstands	{DATEFORMAT}
ESTL53	Rückstandssaldo	{MONETARY}
ESTL54	Rückstand in Tagen	{INTEGER-9999}
ESTL55	Kontostatus	{LIST}
ESTL56	Grund für den Ausfall oder die Zwangsvollstreckung	{LIST}
ESTL57	Ausfallbetrag	{MONETARY}
ESTL58	Ausfalldatum	{DATEFORMAT}
ESTL59	Zugewiesene Verluste	{MONETARY}
ESTL60	Kumulierte Rückflüsse	{MONETARY}
ESTL61	Name des Originators	{ALPHANUM-100}
ESTL62	Rechtsträgerkennung des Originators	{LEI}
ESTL63	Land der Niederlassung des Originators	{COUNTRYCODE_2}
ESTL64	Name des ursprünglichen Kreditgebers	{ALPHANUM-100}
ESTL65	Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers	{LEI}
ESTL66	Land der Niederlassung des ursprünglichen Kreditgebers	{COUNTRYCODE_2}

#### Angaben zu Sicherheiten

ESTC1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
ESTC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
ESTC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
ESTC4	Neue Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
ESTC5	Geografische Region — Sicherheit	{NUTS}
ESTC6	Art der Sicherung	{LIST}
ESTC7	Art der Belastung	{LIST}
ESTC8	Sicherungsrechte	{INTEGER-9999}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>ESTC9</b>	Art der Sicherheit	{LIST}
<b>ESTC10</b>	Aktueller Bewertungsbetrag	{MONETARY}
<b>ESTC11</b>	Aktuelle Bewertungsmethode	{LIST}
<b>ESTC12</b>	Aktuelles Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>ESTC13</b>	Aktuelle Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
<b>ESTC14</b>	Ursprünglicher Bewertungsbetrag	{MONETARY}
<b>ESTC15</b>	Ursprüngliche Bewertungsmethode	{LIST}
<b>ESTC16</b>	Ursprüngliches Bewertungsdatum	{DATEFORMAT}
<b>ESTC17</b>	Ursprüngliche Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
<b>ESTC18</b>	Verkaufsdatum	{DATEFORMAT}
<b>ESTC19</b>	Verkaufspreis	{MONETARY}
<b>ESTC20</b>	Währung der Sicherheit	{CURRENCYCODE_3}

## ANHANG X

**Meldebogen für die zugrunde liegenden vermögenswerte — Aufschlag für notleidende Risikopositionen**

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
NPEL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
NPEL2	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
NPEL3	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
NPEL4	Ursprüngliche Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
NPEL5	Neue Kennung des Schuldners	{ALPHANUM-1000}
NPEL6	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
NPEL7	Unter Zwangsverwaltung	{Y/N}
NPEL8	Datum des letzten Kontakts	{DATEFORMAT}
NPEL9	Verstorben	{Y/N}
NPEL10	Rechtsform	{LIST}
NPEL11	Art des rechtlichen Verfahrens	{LIST}
NPEL12	Bezeichnung des rechtlichen Verfahrens	{ALPHANUM-1000}
NPEL13	Abgeschlossene rechtliche Maßnahmen	{ALPHANUM-1000}
NPEL14	Datum der Einleitung des aktuellen rechtlichen Verfahrens	{DATEFORMAT}
NPEL15	Datum der Bestellung des Insolvenzverwalters	{DATEFORMAT}
NPEL16	Zahl der derzeitigen Urteile	{INTEGER-9999}
NPEL17	Zahl der vollstreckten Urteile	{INTEGER-9999}
NPEL18	Datum der externen Zahlungsaufforderung	{DATEFORMAT}
NPEL19	Datum des Schreibens über den Rechtsvorbehalt	{DATEFORMAT}
NPEL20	Gerichtliche Zuständigkeit	{COUNTRYCODE_2}
NPEL21	Datum des Erhalts des Räumungsbescheids	{DATEFORMAT}
NPEL22	Anmerkungen zu anderen Verfahren im Zusammenhang mit Rechtsstreitigkeiten	{ALPHANUM-1000}
NPEL23	Anwendbares Recht	{COUNTRYCODE_2}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
NPEL24	Beschreibung der Rückzahlung	{ALPHANUM-1000}
NPEL25	Beginn des tilgungsfreien Zeitraums	{DATEFORMAT}
NPEL26	Ende des tilgungsfreien Zeitraums	{DATEFORMAT}
NPEL27	Beginn des Zeitraums mit fester Verzinsung	{DATEFORMAT}
NPEL28	Ende des Zeitraums mit fester Verzinsung	{DATEFORMAT}
NPEL29	Aktueller Zinsumwandlungssatz	{PERCENTAGE}
NPEL30	Datum der letzten Zahlung	{DATEFORMAT}
NPEL31	Syndizierter Anteil	{PERCENTAGE}
NPEL32	Beginn des MARP-Prozesses	{DATEFORMAT}
NPEL33	MARP-Status	{LIST}
NPEL34	Externe Einziehungen	{Y/N}
NPEL35	Rückzahlungsplan	{Y/N}
NPEL36	Stundung	{Y/N}
NPEL37	Datum der ersten Stundung	{DATEFORMAT}
NPEL38	Zahl früherer Stundungen	{INTEGER-9999}
NPEL39	Kapitalverzicht	{MONETARY}
NPEL40	Datum des Kapitalverzichts	{DATEFORMAT}
NPEL41	Enddatum der Stundung	{DATEFORMAT}
NPEL42	Unter die Stundung fallender Rückzahlungsbetrag	{MONETARY}

#### Angaben zu Sicherheiten

NPEC1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
NPEC2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
NPEC3	Ursprüngliche Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
NPEC4	Neue Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
NPEC5	Höhe der Mehrwertsteuer	{PERCENTAGE}
NPEC6	Fertigstellungsquote	{PERCENTAGE}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
NPEC7	Status der Vollstreckung	{Y/N}
NPEC8	Status der Vollstreckung durch Dritte	{Y/N}
NPEC9	Zugewiesener Hypothekenbetrag	{MONETARY}
NPEC10	Höherrangige zugrunde liegende Risikopositionen	{MONETARY}
NPEC11	Beschreibung der Vollstreckung	{ALPHANUM-1000}
NPEC12	Vom Gericht festgestellter Betrag	{MONETARY}
NPEC13	Datum der gerichtlichen Prüfung	{DATEFORMAT}
NPEC14	Marktpreis	{MONETARY}
NPEC15	Angebotspreis	{MONETARY}
NPEC16	Datum, an dem die Immobilie für den Verkauf vorbereitet wird	{DATEFORMAT}
NPEC17	Datum, an dem der Verkauf der Immobilie angekündigt wird	{DATEFORMAT}
NPEC18	Datum, ab dem die Immobilie zum Verkauf angeboten wird	{DATEFORMAT}
NPEC19	Vereinbartes Verkaufsdatum	{DATEFORMAT}
NPEC20	Vertragsdatum	{DATEFORMAT}
NPEC21	Erstes Auktionsdatum	{DATEFORMAT}
NPEC22	Vom Gericht festgelegter Mindestpreis für die erste Auktion	{MONETARY}
NPEC23	Nächstes Auktionsdatum	{DATEFORMAT}
NPEC24	Vom Gericht festgelegter Mindestpreis für die nächste Auktion	{MONETARY}
NPEC25	Letztes Auktionsdatum	{DATEFORMAT}
NPEC26	Vom Gericht festgelegter Mindestpreis für die letzte Auktion	{MONETARY}
NPEC27	Zahl ergebnisloser Auktionen	{INTEGER-9999}

#### Angaben zu früheren Einziehungen

NPEH1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
NPEH2	Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
NPEH[3-38]	Negativsaldo im Monat n	{MONETARY}
NPEH[39-74]	Aufstellung der überfälligen Salden im Monat n	{MONETARY}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>NPEH[75-110]</b>	Aufstellung der nicht aus dem Verkauf von Sicherheiten stammenden Rückzahlungen im Monat n	{MONETARY}
<b>NPEH[111-146]</b>	Aufstellung der Rückzahlungen aus dem Verkauf von Sicherheiten im Monat n	{MONETARY}

## ANHANG XI

**Meldebogen für die zugrunde liegenden risikopositionen — Forderungsgedekte geldmarktpapiere**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu den zugrunde liegenden Risikopositionen</b>		
<b>IVAL1</b>	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	{ALPHANUM-28}
<b>IVAL2</b>	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	{ALPHANUM-36}
<b>IVAL3</b>	Ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>IVAL4</b>	Neue Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition	{ALPHANUM-1000}
<b>IVAL5</b>	Art der zugrunde liegenden Risikoposition	{LIST}
<b>IVAL6</b>	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
<b>IVAL7</b>	Geografische Region — höchste Expositionskonzentration 1	{NUTS}
<b>IVAL8</b>	Geografische Region — höchste Expositionskonzentration 2	{NUTS}
<b>IVAL9</b>	Geografische Region — höchste Expositionskonzentration 3	{NUTS}
<b>IVAL10</b>	Klassifizierung der geografischen Region	{YEAR}
<b>IVAL11</b>	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
<b>IVAL12</b>	Anzahl der zugrunde liegenden Risikopositionen	{INTEGER-99999999}
<b>IVAL13</b>	Risikopositionen in EUR	{MONETARY}
<b>IVAL14</b>	Risikopositionen in GBP	{MONETARY}
<b>IVAL15</b>	Risikopositionen in USD	{MONETARY}
<b>IVAL16</b>	Sonstige Risikopositionen	{MONETARY}
<b>IVAL17</b>	Maximale Restlaufzeit	{INTEGER-9999}
<b>IVAL18</b>	Durchschnittliche Restlaufzeit	{INTEGER-9999}
<b>IVAL19</b>	Aktuelle Beleihungsquote	{PERCENTAGE}
<b>IVAL20</b>	Verhältnis zwischen Schulden und Einkommen	{PERCENTAGE}
<b>IVAL21</b>	Tilgungsart	{MONETARY}
<b>IVAL22</b>	Planmäßige Häufigkeit der Kapitalrückzahlungen in Abständen von mehr als einem Monat	{MONETARY}
<b>IVAL23</b>	Planmäßige Häufigkeit der Zinszahlungen in Abständen von mehr als einem Monat	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
IVAL24	Forderungen mit variabler Verzinsung	{MONETARY}
IVAL25	Finanzierter Betrag	{MONETARY}
IVAL26	Verwässerungen	{MONETARY}
IVAL27	Zurückgekaufte Risikopositionen	{MONETARY}
IVAL28	Bei Verbriefung ausgefallene oder bonitätsbeeinträchtigte Risikopositionen	{MONETARY}
IVAL29	Ausgefallene Risikopositionen	{MONETARY}
IVAL30	Ausgefallene Risikopositionen im Sinne der Eigenmittelverordnung	{MONETARY}
IVAL31	Bruttoausbuchungen in der Periode	{MONETARY}
IVAL32	Rückstände 1-29 Tage	{PERCENTAGE}
IVAL33	Rückstände 30-59 Tage	{PERCENTAGE}
IVAL34	Rückstände 60-89 Tage	{PERCENTAGE}
IVAL35	Rückstände 90-119 Tage	{PERCENTAGE}
IVAL36	Rückstände 120-149 Tage	{PERCENTAGE}
IVAL37	Rückstände 150-179 Tage	{PERCENTAGE}
IVAL38	Rückstände 180+ Tage	{PERCENTAGE}
IVAL39	Umstrukturierte Risikopositionen	{PERCENTAGE}
IVAL40	Umstrukturierte Risikopositionen (0 bis 1 Jahr vor Übertragung)	{MONETARY}
IVAL41	Umstrukturierte Risikopositionen (1 bis 3 Jahre vor Übertragung)	{MONETARY}
IVAL42	Umstrukturierte Risikopositionen (mehr als 3 Jahre vor Übertragung)	{MONETARY}
IVAL43	Umstrukturierte Risikopositionen (Zinssatz)	{MONETARY}
IVAL44	Umstrukturierte Risikopositionen (Rückzahlungsplan)	{MONETARY}
IVAL45	Umstrukturierte Risikopositionen (Fälligkeit)	{MONETARY}
IVAL46	Umstrukturierte Risikopositionen (0 bis 1 Jahr vor Übertragung und keine neuen Rückstände)	{MONETARY}
IVAL47	Umstrukturierte Risikopositionen (keine neuen Rückstände)	{MONETARY}
IVAL48	Umstrukturierte Risikopositionen (neue Rückstände)	{MONETARY}
IVAL49	Umstrukturierte Risikopositionen (Sonstige)	{MONETARY}

## ANHANG XII

**Meldebogen anlegerbericht — Verbriefung nicht forderungsgedeckter geldmarktpapiere**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu Verbriefungen</b>		
IVSS1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
IVSS2	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
IVSS3	Bezeichnung der Verbriefung	{ALPHANUM-100}
IVSS4	Bezeichnung der meldenden Stelle	{ALPHANUM-100}
IVSS5	Kontaktperson der meldenden Stelle	{ALPHANUM-256}
IVSS6	Kontaktperson der meldenden Stelle — Telefonnummer	{TELEPHONE}
IVSS7	Kontaktperson der meldenden Stelle — E-Mail	{ALPHANUM-256}
IVSS8	Verfahren des Risikselbstbehalts	{LIST}
IVSS9	Träger des Risikselbstbehalts	{LIST}
IVSS10	Art der zugrunde liegenden Risikoposition	{LIST}
IVSS11	Verfahren der Risikoübertragung	{Y/N}
IVSS12	Trigger-Bewertungen/Quoten	{Y/N}
IVSS13	Ende der revolvingen Periode/Anlaufphase	{DATEFORMAT}
IVSS14	Kapitalrückflüsse in der Periode	{MONETARY}
IVSS15	Zinsrückflüsse in der Periode	{MONETARY}
IVSS16	Kapitaleingänge in der Periode	{MONETARY}
IVSS17	Zinseingänge in der Periode	{MONETARY}
IVSS18	Ziehungen im Rahmen der Liquiditätsfazilität	{Y/N}
IVSS19	Überschussmarge der Verbriefung	{MONETARY}
IVSS20	„Trapping“-Mechanismus für die Überschussmarge	{Y/N}
IVSS21	Aktuelle Übersicherung	{PERCENTAGE}
IVSS22	Annualisierte konstante vorzeitige Rückzahlungsrate	{PERCENTAGE}
IVSS23	Verwässerungen	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
IVSS24	Bruttoausbuchungen in der Periode	{MONETARY}
IVSS25	Zurückgekaufte Risikopositionen	{MONETARY}
IVSS26	Umstrukturierte Risikopositionen	{MONETARY}
IVSS27	Annualisierte konstante Ausfallquote	{PERCENTAGE}
IVSS28	Ausgefallene Risikopositionen	{MONETARY}
IVSS29	Ausgefallene Risikopositionen im Sinne der Eigenmittelverordnung	{MONETARY}
IVSS30	Risikogewichtungsansatz	{LIST}
IVSS31	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [0,00 %, 0,10 %)	{PERCENTAGE}
IVSS32	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [0,10 %, 0,25 %)	{PERCENTAGE}
IVSS33	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [0,25 %, 1,00 %)	{PERCENTAGE}
IVSS34	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [1,00 %, 7,50 %)	{PERCENTAGE}
IVSS35	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [7,50 %, 20,00 %)	{PERCENTAGE}
IVSS36	Ausfallwahrscheinlichkeit des Schuldners im Größenbereich [20,00 %, 100,00 %]	{PERCENTAGE}
IVSS37	Intern geschätzte Verlustquote bei Ausfall (LGD)	{PERCENTAGE}
IVSS38	Rückstände 1-29 Tage	{PERCENTAGE}
IVSS39	Rückstände 30-59 Tage	{PERCENTAGE}
IVSS40	Rückstände 60-89 Tage	{PERCENTAGE}
IVSS41	Rückstände 90-119 Tage	{PERCENTAGE}
IVSS42	Rückstände 120-149 Tage	{PERCENTAGE}
IVSS43	Rückstände 150-179 Tage	{PERCENTAGE}
IVSS44	Rückstände 180+ Tage	{PERCENTAGE}

#### Angaben zu Test/Ereignis/Trigger

IVSR1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
IVSR2	Ursprüngliche Kennung für Test/Ereignis/Trigger	{ALPHANUM-1000}
IVSR3	Neue Kennung für Test/Ereignis/Trigger	{ALPHANUM-1000}
IVSR4	Beschreibung	{ALPHANUM-100000}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
IVSR5	Schwellenwert	{NUMERIC}
IVSR6	Tatsächlicher Wert	{NUMERIC}
IVSR7	Status	{Y/N}
IVSR8	Abhilfefrist	{INTEGER-9999}
IVSR9	Berechnungshäufigkeit	{INTEGER-9999}
IVSR10	Folgen von Verstößen	{LIST}

#### Angaben zum Cashflow

IVSF1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
IVSF2	Ursprüngliche Kennung des Cashflow-Postens	{ALPHANUM-1000}
IVSF3	Neue Kennung des Cashflow-Postens	{ALPHANUM-1000}
IVSF4	Cashflow-Posten	{ALPHANUM-1000}
IVSF5	In der Periode gezahlter Betrag	{MONETARY}
IVSF6	Verfügbare Mittel	{MONETARY}

## ANHANG XIII

**Meldebogen anlegerbericht — Verbriefung forderungsgedekter geldmarktpapiere**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zum Programm</b>		
IVAS1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	{ALPHANUM-28}
IVAS2	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
IVAS3	Bezeichnung der meldenden Stelle	{ALPHANUM-100}
IVAS4	Kontaktperson der meldenden Stelle	{ALPHANUM-256}
IVAS5	Kontaktperson der meldenden Stelle — Telefonnummer	{TELEPHONE}
IVAS6	Kontaktperson der meldenden Stelle — E-Mail	{ALPHANUM-256}
IVAS7	Trigger-Bewertungen/Quoten	{Y/N}
IVAS8	Nicht konforme Risikopositionen	{MONETARY}
IVAS9	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit	{INTEGER-9999}
IVAS10	Verfahren des Risikselbstbehalts	{LIST}
IVAS11	Träger des Risikselbstbehalts	{LIST}
<b>Angaben zur Transaktion</b>		
IVAN1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	{ALPHANUM-28}
IVAN2	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	{ALPHANUM-36}
IVAN3	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
IVAN4	NACE-Branchencode	{NACE}
IVAN5	Verfahren des Risikselbstbehalts	{LIST}
IVAN6	Träger des Risikselbstbehalts	{LIST}
IVAN7	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit	{INTEGER-9999}
<b>Angaben zu Test/Ereignis/Trigger</b>		
IVAR1	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	{ALPHANUM-36}
IVAR2	Ursprüngliche Kennung für Test/Ereignis/Trigger	{ALPHANUM-1000}
IVAR3	Neue Kennung für Test/Ereignis/Trigger	{ALPHANUM-1000}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>IVAR4</b>	Beschreibung	{ALPHANUM-100000}
<b>IVAR5</b>	Status	{Y/N}
<b>IVAR6</b>	Folgen von Verstößen	{LIST}

## ANHANG XIV

**Meldebogen für insiderinformationen oder signifikante ereignisse — Verbriefung nicht forderungs-gedeckter geldmarktpapiere**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zu Verbriefungen</b>		
SESS1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESS2	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
SESS3	Nicht mehr STS	{Y/N}
SESS4	Abhilfemaßnahmen	{Y/N}
SESS5	Administrative Schritte	{Y/N}
SESS6	Wesentliche Änderung der Unterlagen der Transaktion.	{ALPHANUM-1000000}
SESS7	Verkaufsabschluss	{Y/N}
SESS8	Aktuelle Art des Wasserfalls	{LIST}
SESS9	Art der Master-Trust-Struktur	{LIST}
SESS10	Wert der Verbriefungszweckgesellschaft	{MONETARY}
SESS11	Kapitalwert der Verbriefungszweckgesellschaft	{MONETARY}
SESS12	Verbriefungszweckgesellschaft — Anzahl der Konten	{INTEGER-999999999}
SESS13	Kapitalsaldo der Schuldtitel	{MONETARY}
SESS14	Anteil des Verkäufers	{PERCENTAGE}
SESS15	Finanzierungsanteil	{PERCENTAGE}
SESS16	Dieser Serie zugewiesene Einnahmen	{MONETARY}
SESS17	Referenzzinssatz des Zinsswaps	{LIST}
SESS18	Fälligkeit des Zinsswaps	{DATEFORMAT}
SESS19	Nominalbetrag des Zinsswaps	{MONETARY}
SESS20	Währung der zahlenden Komponente des Währungsswaps	{CURRENCYCODE_3}
SESS21	Währung der empfangenden Komponente des Währungsswaps	{CURRENCYCODE_3}
SESS22	Wechselkurs des Währungsswaps	{PERCENTAGE}
SESS23	Fälligkeit des Währungsswaps	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SESS24	Nominalbetrag des Währungsswaps	{MONETARY}
<b>Angaben zu Tranche/Anleihe</b>		
SEST1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SEST2	Ursprüngliche Kennung der Tranche	{ALPHANUM-1000}
SEST3	Neue Kennung der Tranche	{ALPHANUM-1000}
SEST4	Internationale Wertpapierkennnummer	{ISIN}
SEST5	Bezeichnung der Tranche	{ALPHANUM-100}
SEST6	Art der Tranche/Anleihe	{LIST}
SEST7	Währung	{CURRENCYCODE_3}
SEST8	Ursprünglicher Kapitalsaldo	{MONETARY}
SEST9	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
SEST10	Zinszahlungshäufigkeit	{LIST}
SEST11	Zinszahlungsdatum	{DATEFORMAT}
SEST12	Kapitalrückzahlungsdatum	{DATEFORMAT}
SEST13	Aktueller Kupon	{PERCENTAGE}
SEST14	Aktuelle Zinsmarge/Kupon-Spread	{PERCENTAGE}
SEST15	Kupon-Untergrenze	{PERCENTAGE}
SEST16	Kupon-Obergrenze	{PERCENTAGE}
SEST17	Betrag des Step-Up/Step-Down-Kupons	{PERCENTAGE}
SEST18	Datum des Step-Up/Step-Down-Kupons	{DATEFORMAT}
SEST19	Geschäftstagekonvention	{LIST}
SEST20	Aktueller Zinsindex	{LIST}
SEST21	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	{LIST}
SEST22	Emissionsdatum	{DATEFORMAT}
SEST23	Auszahlungsdatum	{DATEFORMAT}
SEST24	Gesetzliche Fälligkeit	{DATEFORMAT}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SEST25	Verlängerungsklausel	{LIST}
SEST26	Nächstes Datum für Kaufoption („Call“)	{DATEFORMAT}
SEST27	Schwellenwert für Rückführungsaufruf	{ALPHANUM-1000}
SEST28	Nächstes Datum für Verkaufsoption („Put“)	{DATEFORMAT}
SEST29	Zinsberechnungsmethode	{LIST}
SEST30	Abrechnungsregelung	{LIST}
SEST31	Derzeitiger oberer Tranchierungspunkt	{PERCENTAGE}
SEST32	Ursprünglicher oberer Tranchierungspunkt	{PERCENTAGE}
SEST33	Aktuelle Bonitätsverbesserung	{PERCENTAGE}
SEST34	Ursprüngliche Bonitätsverbesserung	{PERCENTAGE}
SEST35	Bonitätsverbesserungsformel	{ALPHANUM-1000}
SEST36	Pari-Passu-Tranchen	{ISIN}
SEST37	Vorrangige Tranchen	{ISIN}
SEST38	Ausstehender PDL-Saldo (Principal Deficiency Ledger)	{MONETARY}
SEST39	Rechtsträgerkennung des Garantiegebers	{LEI}
SEST40	Name des Garantiegebers	{ALPHANUM-1000}
SEST41	ESVG-Teilektor des Garantiegebers	{ESA}
SEST42	Art der Sicherung	{LIST}

#### Angaben zum Konto

SESA1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESA2	Ursprüngliche Kennung des Kontos	{ALPHANUM-1000}
SESA3	Neue Kennung des Kontos	{ALPHANUM-1000}
SESA4	Kontotyp	{LIST}
SESA5	Zielsaldo	{MONETARY}
SESA6	Tatsächlicher Saldo	{MONETARY}
SESA7	Amortisationskonto	{Y/N}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zur Gegenpartei</b>		
SESP1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESP2	Rechtsträgerkennung der Gegenpartei	{LEI}
SESP3	Name der Gegenpartei	{ALPHANUM-100}
SESP4	Art der Gegenpartei	{LIST}
SESP5	Niederlassungsland der Gegenpartei	{COUNTRYCODE_2}
SESP6	Ratingschwelle der Gegenpartei	{ALPHANUM-100000}
SESP7	Rating der Gegenpartei	{ALPHANUM-100000}
SESP8	Rechtsträgerkennung der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	{LEI}
SESP9	Name der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	{ALPHANUM-100}
<b>Angaben zur CLO-Verbriefung</b>		
SESC1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESC2	Ende der Kündigungssperrfrist	{DATEFORMAT}
SESC3	CLO-Typ	{LIST}
SESC4	Laufende Periode	{LIST}
SESC5	Beginn der laufenden Periode	{DATEFORMAT}
SESC6	Ende der laufenden Periode	{DATEFORMAT}
SESC7	Konzentrationsbegrenzung	{PERCENTAGE}
SESC8	Beschränkungen — rechtliche Fälligkeit	{PERCENTAGE}
SESC9	Beschränkungen — nachrangige Risikopositionen	{PERCENTAGE}
SESC10	Beschränkungen — notleidende Risikopositionen	{PERCENTAGE}
SESC11	Beschränkungen — PIK-Risikopositionen	{PERCENTAGE}
SESC12	Beschränkungen — Nullkupon-Risikopositionen	{PERCENTAGE}
SESC13	Beschränkungen — Eigenkapital-Risikopositionen	{PERCENTAGE}
SESC14	Beschränkungen — Beteiligungen	{PERCENTAGE}
SESC15	Beschränkungen — diskretionäre Verkäufe	{PERCENTAGE}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SESC16	Diskretionäre Verkäufe	{MONETARY}
SESC17	Reinvestitionen	{MONETARY}
SESC18	Beschränkungen — Bonitätsverbesserung	{Y/N}
SESC19	Beschränkungen — Kursofferten	{Y/N}
SESC20	Beschränkungen — Handel	{Y/N}
SESC21	Beschränkungen — Emissionen	{Y/N}
SESC22	Beschränkungen — Rückzahlungen	{Y/N}
SESC23	Beschränkungen — Refinanzierung	{Y/N}
SESC24	Beschränkungen — Vergütung von Schuldtiteln	{Y/N}
SESC25	Beschränkungen — Kreditbesicherung	{Y/N}
SESC26	Zeitraum für die Liquidation von Sicherheiten	{INTEGER-9999}
SESC27	Liquidation von Sicherheiten — Ausnahmen	{Y/N}

#### Angaben zum CLO-Manager

SESL1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESL2	Rechtsträgerkennung des CLO-Managers	{LEI}
SESL3	Name des Managers	{ALPHANUM-1000}
SESL4	Datum der Niederlassung	{DATEFORMAT}
SESL5	Zulassungsdatum	{DATEFORMAT}
SESL6	Beschäftigte	{INTEGER-9999}
SESL7	Beschäftigte — CLO	{INTEGER-9999}
SESL8	Beschäftigte — Abwicklung	{INTEGER-9999}
SESL9	AUM	{MONETARY}
SESL10	AUM — gehebelte Kredite	{MONETARY}
SESL11	AUM — CLO	{MONETARY}
SESL12	AUM — EU	{MONETARY}
SESL13	AUM — EU-CLO	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SESL14	Anzahl EU-CLO	{INTEGER-9999}
SESL15	Kapital	{MONETARY}
SESL16	Kapital — Risikselbstbehalt	{MONETARY}
SESL17	Abwicklungsdauer	{INTEGER-9999}
SESL18	Bepreisungshäufigkeit	{INTEGER-9999}
SESL19	Ausfallquote — 1 Jahr	{PERCENTAGE}
SESL20	Ausfallquote — 5 Jahre	{PERCENTAGE}
SESL21	Ausfallquote — 10 Jahre	{PERCENTAGE}

#### Angaben zur synthetischen Deckung

SESV1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESV2	Kennung des Sicherungsinstruments	{ALPHANUM-1000}
SESV3	Art der Sicherung	{LIST}
SESV4	Internationale Wertpapierkennnummer des Sicherungsinstruments	{ISIN}
SESV5	Name des Sicherungsgebers	{ALPHANUM-100}
SESV6	Rechtsträgerkennung des Sicherungsgebers	{LEI}
SESV7	Einrichtungen mit einem Risikogewicht von 0 %	{Y/N}
SESV8	Anwendbares Recht	{COUNTRYCODE_2}
SESV9	ISDA-Rahmenvertrag	{LIST}
SESV10	Ausfall- und Kündigungsereignisse	{LIST}
SESV11	Art der synthetischen Verbriefung	{Y/N}
SESV12	Währung der Sicherung	{CURRENCYCODE_3}
SESV13	Nennwert der aktuellen Sicherung	{MONETARY}
SESV14	Nennwert der maximalen Sicherung	{MONETARY}
SESV15	Attachment-Point der Sicherung	{PERCENTAGE}
SESV16	Detachment-Point der Sicherung	{PERCENTAGE}
SESV17	Internationale Wertpapierkennnummer der gedeckten Schuldtitel	{ISIN}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SESV18	Sicherungsdeckung	{LIST}
SESV19	Datum der Kündigung der Sicherung	{DATEFORMAT}
SESV20	Wesentlichkeitsschwellenwerte	{Y/N}
SESV21	Bedingungen für die Freigabe von Zahlungen	{LIST}
SESV22	Möglichkeit von Anpassungszahlungen	{Y/N}
SESV23	Länge des Abwicklungszeitraums	{INTEGER-9999}
SESV24	Pflicht zur Rückzahlung	{Y/N}
SESV25	Sicherheitsubstitution	{Y/N}
SESV26	Anforderungen an die Deckung von Sicherheiten	{PERCENTAGE}
SESV27	Sicherheiteneinschüsse	{MONETARY}
SESV28	Frist für die Leistung von Sicherheiten	{INTEGER-9999}
SESV29	Abwicklung	{LIST}
SESV30	Maximaler Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
SESV31	Aktueller Index für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	{LIST}
SESV32	Laufzeit des aktuellen Index für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	{LIST}
SESV33	Anpassung der Zahlungshäufigkeit — Zahlungen an den Sicherungsnehmer	{LIST}
SESV34	Aktuelle Zinsmarge für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	{PERCENTAGE}
SESV35	Aktueller Zinsindex für Zahlungen an den Sicherungsnehmer	{PERCENTAGE}
SESV36	Aktueller Index für Zahlungen an den Sicherungsgeber	{LIST}
SESV37	Laufzeit des aktuellen Index für Zahlungen an den Sicherungsgeber	{LIST}
SESV38	Anpassung der Zahlungshäufigkeit — Zahlungen an den Sicherungsgeber	{LIST}
SESV39	Aktuelle Zinsmarge für Zahlungen an den Sicherungsgeber	{PERCENTAGE}
SESV40	Aktueller Zinsindex für Zahlungen an den Sicherungsgeber	{PERCENTAGE}
SESV41	Unterstützung durch Überschussmarge	{Y/N}
SESV42	Definition der Überschussmarge	{Y/N}
SESV43	Aktueller Sicherungsstatus	{LIST}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SESV44	Kreditereignis Insolvenz	{Y/N}
SESV45	Kreditereignis Zahlungsver säumnis	{Y/N}
SESV46	Kreditereignis Umstrukturierung	{Y/N}
SESV47	Kreditereignis	{Y/N}
SESV48	Kumulierte Zahlungen an den Sicherungsnehmer	{MONETARY}
SESV49	Kumulierte Anpassungszahlungen an den Sicherungsnehmer	{MONETARY}
SESV50	Kumulierte Zahlungen an den Sicherungsgeber	{MONETARY}
SESV51	Kumulierte Anpassungszahlungen an den Sicherungsgeber	{MONETARY}
SESV52	Synthetische Überschussmarge	{MONETARY}

#### Angaben zu den Sicherheiten des Emittenten

SESI1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SESI2	Kennung des Sicherungsinstruments	{ALPHANUM-1000}
SESI3	Ursprüngliche Kennung des Sicherungsinstruments	{ALPHANUM-1000}
SESI4	Neue Kennung der Sicherheit	{ALPHANUM-1000}
SESI5	Internationale Wertpapierkennnummer des Sicherungsinstruments	{ISIN}
SESI6	Art des Sicherungsinstruments	{LIST}
SESI7	ESVG-Teilektor des Herausgebers der Sicherheit	{ESA}
SESI8	Rechtsträgerkennung des Herausgebers der Sicherheit	{LEI}
SESI9	Verbindung des Herausgebers der Sicherheit mit dem Originator	{Y/N}
SESI10	Aktuell ausstehender Saldo	{MONETARY}
SESI11	Währung des Instruments	{CURRENCYCODE_3}
SESI12	Fälligkeitstermin	{DATEFORMAT}
SESI13	Abschlag („Haircut“)	{PERCENTAGE}
SESI14	Aktueller Zinsindex	{LIST}
SESI15	Laufzeit des aktuellen Zinsindex	{LIST}
SESI16	Aktueller Zinssatz auf Bareinlagen	{PERCENTAGE}

<b>FELD-CODE</b>	<b>FELDBEZEICHNUNG</b>	<b>FORMAT</b>
<b>SESI17</b>	Name der Gegenpartei des Repo-Geschäfts	{ALPHANUM-100}
<b>SESI18</b>	Rechtsträgerkennung der Gegenpartei des Repo-Geschäfts	{LEI}
<b>SESI19</b>	Fälligkeitstermin des Repo-Geschäfts	{DATEFORMAT}

**Sonstige Angaben**

<b>SESO1</b>	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
<b>SESO2</b>	Zeilennummer sonstiger Angaben	{INTEGER-9999}
<b>SESO3</b>	Sonstige Angaben.	{ALPHANUM-1000}

## ANHANG XV

**Meldebogen für insiderinformationen oder signifikante ereignisse — Verbriefung forderungs-  
gedeckter geldmarktpapiere**

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Angaben zum Programm</b>		
SEAS1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	{ALPHANUM-28}
SEAS2	Datenstichtag	{DATEFORMAT}
SEAS3	Nicht mehr STS	{Y/N}
SEAS4	Abhilfemaßnahmen	{Y/N}
SEAS5	Administrative Schritte	{Y/N}
SEAS6	Wesentliche Änderung der Unterlagen der Transaktion.	{ALPHANUM-100000}
SEAS7	Anwendbares Recht	{COUNTRYCODE_2}
SEAS8	Dauer der Liquiditätsfazilität	{INTEGER-9999}
SEAS9	Deckung der Liquiditätsfazilität	{PERCENTAGE}
SEAS10	Deckungsintervall der Liquiditätsfazilität	{INTEGER-9999}
SEAS11	Fälligkeitstermin der Liquiditätsfazilität	{DATEFORMAT}
SEAS12	Ziehungen im Rahmen der Liquiditätsfazilität	{Y/N}
SEAS13	Gesamtemissionen	{MONETARY}
SEAS14	Maximalemissionen	{MONETARY}
<b>Angaben zur Transaktion</b>		
SEAR1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	{ALPHANUM-28}
SEAR2	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	{ALPHANUM-36}
SEAR3	Anzahl der Programme zur Finanzierung der Transaktion	{INTEGER-9999}
SEAR4	Nicht mehr STS	{Y/N}
SEAR5	Originator als Kunde des Programmsponsors	{Y/N}
SEAR6	Gewährung von Sicherungsrechten	{Y/N}
SEAR7	Einnahmen	{MONETARY}
SEAR8	Betriebliche Aufwendungen	{MONETARY}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SEAR9	Umlaufvermögen	{MONETARY}
SEAR10	Barmittel	{MONETARY}
SEAR11	Marktgängige Wertpapiere	{MONETARY}
SEAR12	Forderungen	{MONETARY}
SEAR13	Kurzfristige Verbindlichkeiten	{MONETARY}
SEAR14	Gesamtschulden	{MONETARY}
SEAR15	Gesamtkapital	{MONETARY}
SEAR16	Währung des Abschlusses	{CURRENCYCODE_3}
SEAR17	Ebene der Unterstützung durch den Sponsor	{LIST}
SEAR18	Art der Unterstützung durch den Sponsor	{Y/N}
SEAR19	Dauer der Liquiditätsfazilität	{INTEGER-9999}
SEAR20	Aus der Liquiditätsfazilität in Anspruch genommener Betrag	{MONETARY}
SEAR21	Deckung der Liquiditätsfazilität	{PERCENTAGE}
SEAR22	Deckungsintervall der Liquiditätsfazilität	{INTEGER-9999}
SEAR23	Art der Liquiditätsfazilität	{LIST}
SEAR24	Fälligkeitstermin der Pensionsgeschäfte der Liquiditätsfazilität	{DATEFORMAT}
SEAR25	Währung der Liquiditätsfazilität	{CURRENCYCODE_3}
SEAR26	Fälligkeitstermin der Liquiditätsfazilität	{DATEFORMAT}
SEAR27	Name des Anbieters der Liquiditätsfazilität	{ALPHANUM-100}
SEAR28	Rechtsträgerkennung des Anbieters der Liquiditätsfazilität	{LEI}
SEAR29	Übersicherung/Nachrangige Beteiligungen	{PERCENTAGE}
SEAR30	Überschussmarge der Transaktion	{MONETARY}
SEAR31	Name des Kreditbrief-Ausstellers	{ALPHANUM-100}
SEAR32	Rechtsträgerkennung des Kreditbrief-Ausstellers	{LEI}
SEAR33	Währung des Kreditbriefs	{CURRENCYCODE_3}
SEAR34	Maximale Sicherung durch den Kreditbrief	{PERCENTAGE}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SEAR35	Name des Garantiegebers	{ALPHANUM-100}
SEAR36	Rechtsträgerkennung des Garantiegebers	{LEI}
SEAR37	Maximale Deckung durch die Garantie	{MONETARY}
SEAR38	Währung der Garantie	{CURRENCYCODE_3}
SEAR39	Fälligkeitstermin der Garantie	{DATEFORMAT}
SEAR40	Art der Forderungsübertragung	{LIST}
SEAR41	Fälligkeitstermin der Pensionsgeschäfte	{DATEFORMAT}
SEAR42	Gekaufter Betrag	{MONETARY}
SEAR43	Maximale Finanzierungsgrenze	{MONETARY}
SEAR44	Referenzzinssatz des Zinsswaps	{LIST}
SEAR45	Fälligkeit des Zinsswaps	{DATEFORMAT}
SEAR46	Nominalbetrag des Zinsswaps	{MONETARY}
SEAR47	Währung der zahlenden Komponente des Währungsswaps	{CURRENCYCODE_3}
SEAR48	Währung der empfangenden Komponente des Währungsswaps	{CURRENCYCODE_3}
SEAR49	Wechselkurs des Währungsswaps	{PERCENTAGE}
SEAR50	Fälligkeit des Währungsswaps	{DATEFORMAT}
SEAR51	Nominalbetrag des Währungsswaps	{MONETARY}

#### Angaben zu Tranche/Anleihe

SEAT1	Eindeutige Kennung — ABCP-Programm	{ALPHANUM-28}
SEAT2	Ursprüngliche Kennung der Anleihe	{ALPHANUM-1000}
SEAT3	Neue Kennung der Anleihe	{ALPHANUM-1000}
SEAT4	Internationale Wertpapierkennnummer	{ISIN}
SEAT5	Art der Tranche/Anleihe	{LIST}
SEAT6	Emissionsdatum	{DATEFORMAT}
SEAT7	Gesetzliche Fälligkeit	{DATEFORMAT}
SEAT8	Währung	{CURRENCYCODE_3}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
SEAT9	Aktueller Kapitalsaldo	{MONETARY}
SEAT10	Aktueller Kupon	{PERCENTAGE}
SEAT11	Aktueller Zinsindex	{LIST}
SEAT12	Laufzeit des aktuellen Zinsindexes	{LIST}
SEAT13	Zinszahlungshäufigkeit	{LIST}
SEAT14	Aktuelle Bonitätsverbesserung	{PERCENTAGE}
SEAT15	Bonitätsverbesserungsformel	{ALPHANUM-1000}

**Angaben zum Konto**

SEAA1	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	{ALPHANUM-36}
SEAA2	Ursprüngliche Kennung des Kontos	{ALPHANUM-1000}
SEAA3	Neue Kennung des Kontos	{ALPHANUM-1000}
SEAA4	Kontotyp	{LIST}
SEAA5	Zielsaldo	{MONETARY}
SEAA6	Tatsächlicher Saldo	{MONETARY}
SEAA7	Amortisationskonto	{Y/N}

**Angaben zur Gegenpartei**

SEAP1	Eindeutige Kennung — ABCP-Transaktion	{ALPHANUM-36}
SEAP2	Rechtsträgerkennung der Gegenpartei	{LEI}
SEAP3	Name der Gegenpartei	{ALPHANUM-100}
SEAP4	Art der Gegenpartei	{LIST}
SEAP5	Niederlassungsland der Gegenpartei	{COUNTRYCODE_2}
SEAP6	Ratingschwelle der Gegenpartei	{ALPHANUM-100000}
SEAP7	Rating der Gegenpartei	{ALPHANUM-100000}
SEAP8	Rechtsträgerkennung der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	{LEI}
SEAP9	Name der Stelle, die das Gegenpartei-Rating vornimmt	{ALPHANUM-100}

FELD-CODE	FELDBEZEICHNUNG	FORMAT
<b>Sonstige Angaben</b>		
SEAO1	Eindeutige Kennung	{ALPHANUM-28}
SEAO2	Zeilennummer sonstiger Angaben	{INTEGER-9999}
SEAO3	Sonstige Angaben.	{ALPHANUM-1000}

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

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

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

in Erwägung nachstehender Gründe:

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

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

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

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

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

##### **Bei der STS-Meldung bereitzustellende Informationen**

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

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

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

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

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

#### Artikel 2

##### **Zusätzliche Informationen**

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

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

#### Artikel 3

##### **Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 12. November 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER

## ANHANG I

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

**Allgemeine Informationen**

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

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

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

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

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

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

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

## Spezifische Informationen

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

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

STSS29	Artikel 20 Absatz 10	Solide Vergabe- standards			√  Ausführliche-Erläuterung, — ob die zugrunde liegenden Risiko- positionen im ordentlichen Ge- schäftsgang des Kreditgebers origi- niert wurden und ob die angewandten Vergabestandards nicht weniger streng waren als die zum Zeitpunkt der Originierung verwendeten Standards für die Ori- ginierung nicht verbriefter Risiko- positionen; — ob die Vergabestandards und we- sentliche Änderungen gegenüber früheren Vergabestandards potenzi- ellen Anlegern unverzüglich in vollem Umfang offengelegt wurden bzw. werden; — wie bei Verbriefungen, bei denen die zugrunde liegenden Risikopositi- onen Darlehen für Wohnimmobilien sind, der Pool der zugrunde liegen- den Risikopositionen die Anforder- ung des Artikels 20 Absatz 10 Un- terabsatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 erfüllt; — ob die Prüfung der Kreditwürdigkeit des Kredit- bzw. Darlehensnehmers die Anforderungen des Artikels 8 der Richtlinie 2008/48/EG des Eu- ropäischen Parlaments und des Ra- tes <sup>(?)</sup> oder die Anforderungen des Artikels 18 Absätze 1 bis 4, Ab- satz 5 Buchstabe a und Absatz 6 der Richtlinie 2014/17/EU des Eu- ropäischen Parlaments und des Ra- tes <sup>(*)</sup> oder gegebenenfalls entspre- chende Anforderungen in Drittländern erfüllt.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verord- nung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS30	Artikel 20 Absatz 10	Erfahrung des Originators/Kre- ditgebers			√  Ausführliche Erläuterung dazu, ob der Originator bzw. der ursprüngliche Kreditgeber über Erfahrung mit der Originierung von Risikopositionen, die den verbrieften Risikopositionen äh- neln, verfügt.	Punkt 2.2.7 von Anhang 19 der Delegierten Verord- nung (EU) 2019/980 der Kommission
STSS31	Artikel 20 Absatz 11	Übertragene zug- runde liegende Risikopositionen, die keine ausge- fallenen Risikopo- sitionen enthalten			√  Ausführliche Erläuterung, ob — die übertragenen zugrunde liegen- den Risikopositionen zum Zeit- punkt der Auswahl keine ausgefal- lenen (oder umstrukturierten) Risikopositionen im Sinne von Ar- tikel 20 Absatz 11 der Verordnung (EU) 2017/2402 enthalten; — die in Artikel 20 Absatz 11 Buch- stabe a Ziffern i und ii der Verord- nung (EU) 2017/2402 genannten Anforderungen erfüllt sind; — die in Artikel 20 Absatz 11 Buch- stabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Anforde- rungen erfüllt sind;	Punkt 2.2.8 von Anhang 19 der Delegierten Verord- nung (EU) 2019/980 der Kommission

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## ANHANG II

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

**Allgemeine Informationen**

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

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

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

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

### Spezifische Informationen

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

## ANHANG III

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

**Allgemeine Informationen**

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

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

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

### Spezifische Informationen

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

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

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

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

STSAP32	Artikel 26 Absatz 7 Buchsta- be c	Anforderungen an die ABCP-Pro- grammunterla- gen (Verfahren und Zuständig- keiten bei Ausfall des Forderungs- verwalters)	√			Bestätigung, dass die Verfahren und Zuständigkeiten, die erforderlich sind, um bei Ausfall oder Insolvenz des Forderungsverwalters die Kontinuität der Forderungsverwaltung zu ge- währleisten, in den ABCP-Program- munterlagen festgelegt sind.	Entfällt
STSAP33	Artikel 26 Absatz 7 Buchsta- be d	Anforderungen an die ABCP-Pro- grammunterla- gen (Bestimmun- gen über den Ersatz von Deri- vatgegenpartei- en und der kon- toführenden Bank)	√			Bestätigung, dass die Anforderungen des Artikels 26 Absatz 7 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402 in Bezug auf Bestimmungen über den Ersatz von Derivatgegenparteien und der kontoführenden Bank auf ABCP- Programmebene bei deren Ausfall, Insolvenz oder bestimmten anderen Ereignissen, wenn die Liquiditätsfazi- lität diese Ereignisse nicht abdeckt, erfüllt sind.	Entfällt
STSAP34	Artikel 26 Absatz 7 Buchsta- be e	Anforderungen an die ABCP-Pro- grammunterla- gen (Verfahren zur Gewährlei- stung der Besi- cherung der Fi- nanzierungszusa- ge)	√			Bestätigung, dass in den ABCP-Pro- grammunterlagen Verfahren festgelegt sind, mit denen sichergestellt wird, dass bei bestimmten Ereignissen, bei Ausfall oder Insolvenz des Sponsors Abhilfemaßnahmen vorgesehen sind, um gegebenenfalls eine Besicherung der Finanzierungszusage oder einen Ersatz des Bereitstellers der Liquidi- tätsfazilität zu erreichen. Angabe der entsprechenden Seiten im Prospekt oder der sonstigen zugrunde liegenden Dokumentation, auf denen die für die Anforderungen des Arti- kels 26 Absatz 7 Buchstabe e der Ver- ordnung (EU) 2017/2402 relevanten Informationen zu finden sind.	Entfällt
STSAP35	Artikel 26 Absatz 7 Buchsta- be f	Anforderungen an die ABCP-Pro- grammunterla- gen (Liquiditäts- fazilität und Rückzahlung fäl- lig werdender Wertpapiere, falls der Sponsor die Finanzierungszu- sage für die Li- quiditätsfazilität vor deren Ablauf nicht erneuert)	√			Bestätigung, dass die ABCP-Program- munterlagen Bestimmungen enthal- ten, die sicherstellen, dass für den Fall, dass der Sponsor seine Zusage in Be- zug auf die Finanzierung der Liquidi- tätsfazilität nicht vor deren Ablauf er- neuert, die Liquiditätsfazilität in Anspruch genommen wird und die fällig werdenden Wertpapiere zurück- gezahlt werden. Angabe der entsprechenden Seiten im Prospekt oder der sonstigen zugrunde liegenden Dokumentation, auf denen die für die Anforderungen des Arti- kels 26 Absatz 7 Buchstabe f der Ver- ordnung (EU) 2017/2402 relevanten Informationen zu finden sind.	Entfällt

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

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

**DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2020/1227 DER KOMMISSION****vom 12. November 2019****zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf Meldebögen für die Bereitstellung von Informationen gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012 <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 27 Absatz 7,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Um die Wirksamkeit und Harmonisierung von Meldungen zu erleichtern, sollten die Informationen zu Verbriefungen, die die Anforderungen der Artikel 19 bis 22 und 23 bis 26 der Verordnung (EU) 2017/2402 an eine einfache, transparente und standardisierte („STS“-)Verbriefung erfüllen, der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) in einem durchgängig angewandten Format und nach einheitlichen Standards übermittelt werden.
- (2) Die Bereitstellung von Informationen in einem harmonisierten Format ermöglicht der ESMA eine effiziente Datenerhebung und erleichtert die Kohärenzkontrollen sowie die Bewertung der Vollständigkeit durch die Anleger und die zuständigen Behörden. Daher sollte das Format jedes für eine STS-Meldung auszufüllenden Feldes spezifiziert und sollten alle Informationen an die ESMA elektronisch übermittelt werden.
- (3) Diese Verordnung basiert auf den Entwürfen technischer Durchführungsstandards, die der Kommission von der ESMA gemäß Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(2)</sup> vorgelegt wurden.
- (4) Die ESMA hat zu den Entwürfen technischer Durchführungsstandards, auf denen diese Verordnung basiert, eine offene öffentliche Anhörung durchgeführt, die potenziell anfallenden Kosten und den Nutzen analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

*Artikel 1***Meldebögen für die STS-Meldung**

- (1) Die in Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe a und Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe a der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission genannten Informationen <sup>(3)</sup> werden unter Verwendung des Musters in Anhang I dieser Verordnung bereitgestellt.
- (2) Die in Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe b und Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe b der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 genannten Informationen werden unter Verwendung des Musters in Anhang II dieser Verordnung bereitgestellt.

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

<sup>(2)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

<sup>(3)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2020/1226 der Kommission vom 12. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Spezifizierung der gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung zu übermittelnden Informationen (siehe Seite 285 dieses Amtsblatts).

- (3) Die in Artikel 1 Absatz 1 Buchstabe c und Artikel 1 Absatz 2 Buchstabe c der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 genannten Informationen werden unter Verwendung des Musters in Anhang III dieser Verordnung bereitgestellt.
- (4) Sind die nach diesem Artikel bereitzustellenden Informationen wegen der Anwendung der in Artikel 43 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Übergangsbestimmungen nicht verfügbar oder erforderlich, ist im jeweiligen Feld/in den jeweiligen Feldern der Anhänge dieser Verordnung „Entfällt wegen der Anwendung von Übergangsbestimmungen“ anzugeben.
- (5) Die in diesem Artikel genannten Informationen sind in elektronischer und maschinenlesbarer Form zu übermitteln.
- (6) Die in Artikel 2 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1226 genannten „Zusätzlichen Informationen“ sind in das Feld „Auszufüllendes Kästchen“ der Anhänge I bis III dieser Verordnung einzufügen.

#### Artikel 2

#### **Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 12. November 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER

## ANHANG I

## Feldformate des STS-Meldeformulars

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{LÄNDERCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode nach ISO 3166-1 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{WÄHRUNGSCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungscode nach ISO 4217 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{DATUMSFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT
{J/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„richtig“ — J „falsch“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI) gemäß ISO 17442

## STS-Meldeformular für Nicht-ABCP-Verbriefungen

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS0	Erste Anlaufstelle		{ALPHANUM-1000}
STSS1	Identifikationsnummer des Finanzinstruments		{ISIN}
STSS2	LEI des Originators oder Sponsors oder ursprünglichen Kreditgebers		{LEI}
STSS3	Kennziffer der Meldung		{ALPHANUM-100}
STSS4	Eindeutige Kennung		{ALPHANUM-100}
STSS5	Kennziffer des Prospekts		{ALPHANUM-100}
STSS6	Verbriefungsregister		{ALPHANUM-1000}
STSS7	Bezeichnung der Verbriefung		{ALPHANUM-100}
STSS8	Sitzland		{LÄNDERCODE_2}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS9	Klassifizierung der Verbriefung		{LISTE}
STSS10	Art der zugrunde liegenden Risikopositionen		{LISTE}
STSS11	Ausgabedatum		{DATUMSFORMAT}
STSS12	Melddatum		{DATUMSFORMAT}
STSS13	Zugelassener Dritter		{ALPHANUM-100}
STSS14	Zugelassener Dritter (Name und Sitzland)		{ALPHANUM-1000} {LÄNDERCODE_2}
STSS15	Zuständige Behörde, die den Dritten zugelassen hat		{ALPHANUM-100}
STSS16	STS-Status		{ALPHANUM-1000}
STSS17	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) kein EU-Kreditinstitut		{J/N}
STSS18	Bestätigung der Kreditvergabekriterien		{ALPHANUM-1000}
STSS19	Erklärung, dass die Kreditvergabekriterien beaufsichtigt werden		{ALPHANUM-1000}
STSS20	Zugrunde liegende Risikopositionen im Wege einer „True-Sale“-Verbriefung erworben		{ALPHANUM-10000}
STSS21	Keine schwerwiegende Rückforderung		{ALPHANUM-10000}
STSS22	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht		{ALPHANUM-1000}
STSS23	Übertragung, wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist		{ALPHANUM-1000}
STSS24	Übertragung im Wege einer Abtretung, die zu einem späteren Zeitpunkt abgeschlossen wird		{ALPHANUM-10000}
STSS25	Zusicherungen und Gewährleistungen		{ALPHANUM-10000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS26	Kriterien für aktive Portfolioverwaltung		{ALPHANUM-10000}
STSS27	Homogenität der Vermögenswerte		{ALPHANUM}
STSS28	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen/keine Wiederverbriefung		{ALPHANUM-1000}
STSS29	Solidität der Vergabestandards		{ALPHANUM}
STSS30	Erfahrung des Originators/Kreditgebers		{ALPHANUM}
STSS31	Ausgefallene Vermögenswerte		{ALPHANUM}
STSS32	Mindestens eine Zahlung zum Zeitpunkt der Übertragung		{ALPHANUM-1000}
STSS33	Rückzahlung an die Inhaber/Veräußerung von Vermögenswerten		{ALPHANUM}
STSS34	Erfüllung der Anforderung in Bezug auf den Risikoseibstbehalt		{LISTE}
STSS35	Minderung von Zins- (IR-) und Währungs- (FX-)risiken		{ALPHANUM-10000}
STSS36	Derivatekäufe/-verkäufe der Verbriefungszweckgesellschaft		{ALPHANUM-10000}
STSS37	Derivate mit gemeinsamen Standards		{ALPHANUM-10000}
STSS38	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen		{ALPHANUM-10000}
STSS39	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über die vorzeitige Fälligkeit		{ALPHANUM-10000}
STSS40	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS41	Weiterreichung von Tilgungseingängen an die Anleger		{ALPHANUM-1000}
STSS42	Rückzahlung nicht in umgekehrter Reihenfolge zur Seniorität		{ALPHANUM-1000}
STSS43	Keine Bestimmungen, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern		{ALPHANUM-1000}
STSS44	Verbriefungen mit nichtsequentieller Zahlungsrangfolge		{ALPHANUM-1000}
STSS45	Revolvierende Verbriefung mit vorzeitigen Rückzahlungsereignissen für die Beendigung der revolvierenden Periode, basierend auf festgelegten Auslösern		{ALPHANUM-10000}
STSS46	Verschlechterung der Kreditqualität der zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-10000}
STSS47	Insolvenz des Originators oder des Forderungsverwalters		{ALPHANUM-10000}
STSS48	Absinken des Werts der zugrunde liegenden Risikopositionen, die von der Verbriefungszweckgesellschaft gehalten werden, unter einen im Voraus festgelegten Schwellenwert		{ALPHANUM-10000}
STSS49	Nicht hinreichende Generierung neuer zugrunde liegender Risikopositionen, die über die im Voraus festgelegte Kreditqualität verfügen (auslösendes Ereignis für die Beendigung der revolvierenden Periode)		{ALPHANUM-10000}
STSS50	Information über die vertraglichen Verpflichtungen des Forderungsverwalters, des Treuhänders und anderer Anbieter von Nebendienstleistungen		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSS51	Bestimmungen zur Kontinuität der Forderungsverwaltung		{ALPHANUM-1000}
STSS52	Bestimmungen zur Kontinuität der Derivatgegenparteien		{ALPHANUM-1000}
STSS53	Bestimmungen zur Kontinuität der Liquiditätsgeber und der kontoführenden Bank		{ALPHANUM-1000}
STSS54	Erforderliche Erfahrung des Forderungsverwalters sowie angemessene Strategien, Verfahren und Kontrollen des Risikomanagements vorhanden		{ALPHANUM}
STSS55	Klare und kohärente Definitionen (Problemkredite)		{ALPHANUM-1000}
STSS56	Zahlungsrangfolgen und auslösende Ereignisse		{ALPHANUM-1000}
STSS57	Zeitnahe Lösung von Konflikten zwischen den verschiedenen Kategorien von Anlegern und Zuständigkeiten der Treuhänder		{ALPHANUM-1000}
STSS58	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste		{ALPHANUM-1000}
STSS59	Externe Überprüfung einer Stichprobe der zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-1000}
STSS60	Verfügbarkeit eines Liability-Cashflow-Modells für potenzielle Anleger		{ALPHANUM-1000}
STSS61	Umweltbilanz/Darlehen für Wohnimmobilien oder Darlehen für Kfz-Käufe oder -Leasinggeschäfte		{ALPHANUM-10000}
STSS62	Verantwortlichkeit von Originator und Sponsor für die Einhaltung des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}

## ANHANG II

## Feldformate des STS-Meldeformulars

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{LÄNDERCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode nach ISO 3166-1 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{WÄHRUNGSCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungscodes nach ISO 4217 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{DATUMSFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT
{J/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„richtig“ — J „falsch“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI) gemäß ISO 17442

## STS-Meldeformular für ABCP-Verbriefungen

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT0	Erste Anlaufstelle		{ALPHANUM-1000}
STSAT1	Identifikationsnummer des Finanzinstruments		{ISIN}
STSAT2	LEI des Originators oder Sponsors oder ursprünglichen Kreditgebers		{LEI}
STSAT3	Kennziffer der Meldung		{ALPHANUM-100}
STSAT4	Eindeutige Kennung		{ALPHANUM-100}
STSAT5	Kennziffer des Prospekts		{ALPHANUM-100}
STSAT6	Verbriefungsregister		{ALPHANUM-1000}
STSAT7	Bezeichnung der Verbriefung		{ALPHANUM-100}
STSAT8	Sitzland		{ALPHANUM-1000}
STSAT9	Verbriefungsart		{LISTE}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT10	Art der zugrunde liegenden Risikopositionen		{LISTE}
STSAT11	Ausgabedatum		{DATUMSFORMAT}
STSAT12	Melddatum		{DATUMSFORMAT}
STSAT13	Zugelassener Dritter		{ALPHANUM-100}
STSAT14	Zugelassener Dritter (Name und Sitzland)		{ALPHANUM-1000} {LÄNDERCODE_2}
STSAT15	Zuständige Behörde, die den Dritten zugelassen hat		{ALPHANUM-100}
STSAT16	STS-Status		{ALPHANUM-1000}
STSAT17	Originator (oder ursprünglicher Kreditgeber) kein EU-Kreditinstitut		{J/N}
STSAT18	Bestätigung der Kreditvergabekriterien		{ALPHANUM-1000}
STSAT19	Erklärung, dass die Kreditvergabekriterien beaufsichtigt werden		{ALPHANUM-1000}
STSAT20	Zugrunde liegende Risikopositionen im Wege einer „True-Sale“-Verbriefung erworben		{ALPHANUM-10000}
STSAT21	Keine schwerwiegende Rückforderung		{ALPHANUM-10000}
STSAT22	Ausnahmeregelung für Rückforderungsvereinbarungen im nationalen Insolvenzrecht		{ALPHANUM-1000}
STSAT23	Übertragung, wenn der Verkäufer nicht der ursprüngliche Kreditgeber ist		{ALPHANUM-1000}
STSAT24	Übertragung im Wege einer Abtretung, die zu einem späteren Zeitpunkt abgeschlossen wird		{ALPHANUM-10000}
STSAT25	Zusicherungen und Gewährleistungen		{ALPHANUM-10000}
STSAT26	Kriterien für aktive Portfolioverwaltung		{ALPHANUM-10000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT27	Keine Wiederverbriefung		{ALPHANUM-1000}
STSAT28	Übertragene zugrunde liegende Risikopositionen umfassen keine ausgefallenen Risikopositionen		{ALPHANUM}
STSAT29	Mindestens eine geleistete Zahlung zum Zeitpunkt der Übertragung		{ALPHANUM-1000}
STSAT30	Rückzahlung an die Inhaber/Veräußerung von Vermögenswerten		{ALPHANUM}
STSAT31	Minderung von Zins- (IR-) und Währungs- (FX-)risiken		{ALPHANUM-10000}
STSAT32	Derivatekäufe/-verkäufe der Verbriefungszweckgesellschaft		{ALPHANUM-10000}
STSAT33	Derivate in den zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-10000}
STSAT34	Derivate mit gemeinsamen Standards		{ALPHANUM-10000}
STSAT35	Klare und kohärente Definitionen für den Umgang mit Problemkrediten		{ALPHANUM-1000}
STSAT36	Zahlungsrangfolgen und auslösende Ereignisse		{ALPHANUM-1000}
STSAT37	Daten über die historische Wertentwicklung im Hinblick auf Ausfälle und Verluste		{ALPHANUM-1000}
STSAT38	Homogenität der Vermögenswerte		{ALPHANUM}
STSAT39	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-1000}
STSAT40	Verpflichtungen in Bezug auf die zugrunde liegenden Risikopositionen		{ALPHANUM-1000}
STSAT41	An einen Referenzwert gebundene Zinszahlungen basieren auf üblichen Zinssätzen		{ALPHANUM-10000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAT42	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen nach Beitreibungsbescheid oder Mitteilung über die vorzeitige Fälligkeit		{ALPHANUM-10000}
STSAT43	Keine Zurückbehaltung von Geldbeträgen/Beitreibung oder vorzeitige Fälligkeit		{ALPHANUM-1000}
STSAT44	Weiterreichung von Tilgungseingängen an die Anleger		{ALPHANUM-1000}
STSAT45	Keine Bestimmungen, die eine automatische Liquidation der zugrunde liegenden Risikopositionen zum Marktwert erfordern		{ALPHANUM-1000}
STSAT46	Solidität der Vergabestandards		{ALPHANUM}
STSAT47	Erfahrung des Verkäufers		{ALPHANUM}
STSAT48	Revolvierende ABCP-Transaktion/auslösendes Ereignis Kreditqualität		{ALPHANUM}
STSAT49	Aufgaben der an der Verbriefung Beteiligten		{ALPHANUM-1000}
STSAT50	Bestimmungen zur Kontinuität der Forderungsverwaltung		{ALPHANUM-1000}
STSAT51	Bestimmungen zur Kontinuität der Derivatgegenpartei und der kontoführenden Bank		{ALPHANUM-1000}
STSAT52	Solidität des Sponsors		{ALPHANUM-1000}

## ANHANG III

## Feldformate des STS-Meldeformulars

ZEICHEN	DATENTYP	DEFINITION
{ALPHANUM-n}	Bis zu n alphanumerische Zeichen	Freitextfeld. Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{LÄNDERCODE_2}	2 alphanumerische Zeichen	Aus 2 Buchstaben bestehender Ländercode gemäß dem Alpha-2-Ländercode nach ISO 3166-1 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{WÄHRUNGSCODE_3}	3 alphanumerische Zeichen	Aus 3 Buchstaben bestehender Währungscode gemäß den Währungscodes nach ISO 4217 Im ASCII-Format eingeben (ohne mit Akzent versehene Zeichen).
{DATUMSFORMAT}	Datumsformat nach ISO 8601	Formatierung des Datums: JJJJ-MM-TT
{J/N}	1 alphanumerisches Zeichen	„richtig“ — J „falsch“ — N
{ISIN}	12 alphanumerische Zeichen	ISIN-Code gemäß ISO 6166
{LEI}	20 alphanumerische Zeichen	Rechtsträgerkennung (Legal Entity Identifier, LEI) gemäß ISO 17442

## STS-Meldeformular für das ABCP-Programm

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP0	Erste Anlaufstelle		{ALPHANUM-1000}
STSAP1	Identifikationsnummer des Finanzinstruments		{ISIN}
STSAP2	LEI des Sponsors		{LEI}
STSAP3	Kennziffer der Meldung		{ALPHANUM-100}
STSAP4	Eindeutige Kennung		{ALPHANUM-100}
STSAP5	Kennziffer des Prospekts		{ALPHANUM-100}
STSAP6	Verbriefungsregister		{ALPHANUM-1000}
STSAP7	Bezeichnung des ABCP-Programms		{ALPHANUM-100}
STSAP8	Sitzland		{ALPHANUM-1000}
STSAP9	Klassifizierung des Instruments		{LISTE}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP10	Ausgabedatum		{DATUMSFORMAT}
STSAP11	Melddatum		{DATUMSFORMAT}
STSAP12	Zugelassener Dritter		{ALPHANUM-100}
STSAP13	Zugelassener Dritter (Name und Sitzland)		{ALPHANUM-1000} {LÄNDERCODE_2}
STSAP14	Zuständige Behörde, die den Dritten zugelassen hat		{ALPHANUM-100}
STSAP15	STS-Status		{ALPHANUM-1000}
STSAP16	Sponsor muss beaufsichtigtes Kreditinstitut sein		{ALPHANUM-1000}
STSAP17	Unterstützung durch den Sponsor als Bereitsteller von Liquiditätsfazilitäten		{ALPHANUM-1000}
STSAP18	Nachweis, den das Kreditinstitut gegenüber seiner zuständigen Behörde zu erbringen hat		{ALPHANUM-1000}
STSAP19	Erfüllung der Prüf- und Sorgfaltspflichten des Sponsors		{ALPHANUM-1000}
STSAP20	Einhaltung der Risiko-selbstbehalt-Anforderungen (Transaktionsebene/Programmebene)		{LISTE}
STSAP21	Einhaltung von Artikel 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 auf der Ebene des ABCP-Programms		{ALPHANUM-1000}
STSAP22	Inanspruchnahme von Liquidität für den Fall, dass die Liquiditätsfazilität nicht erneuert wird		{ALPHANUM-10000}
STSAP23	Konformität der ABCP-Transaktionen im Rahmen eines ABCP-Programms mit Artikel 24 Absätze 1 bis 8 und 12 bis 20 der Verordnung (EU) 2017/2402		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP24	Höchstens 5 % des Gesamtbetrags der zugrunde liegenden Risikopositionen temporär nicht konform		{ALPHANUM}
STSAP25	Gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAL) höchstens zwei Jahre		{ALPHANUM-1000}
STSAP26	Vollständig unterstütztes ABCP-Programm (Sponsorenunterstützung)		{ALPHANUM-10000}
STSAP27	Keine Wiederverbriefung und keine Bonitätsverbesserung, die eine zweite Tranchierungsebene beim ABCP-Programm schafft		{ALPHANUM-1000}
STSAP28	Keine Kaufoptionen		{ALPHANUM-1000}
STSAP29	Zins- und Währungsrisiken auf ABCP-Programmebene in geeigneter Weise gemindert und dokumentiert		{ALPHANUM}
STSAP30	Anforderungen an ABCP-Programmunterlagen (Zuständigkeiten des Treuhänders gegenüber den Anlegern)		{ALPHANUM-1000}
STSAP31	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (vertragliche Verpflichtungen des Sponsors)		{ALPHANUM-1000}
STSAP32	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Verfahren und Zuständigkeiten bei Ausfall des Forderungsverwalters)		{ALPHANUM-1000}
STSAP33	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Bestimmungen über den Ersatz von Derivatgegenparteien und der kontoführenden Bank)		{ALPHANUM-1000}

FELDCODE	FELDBEZEICHNUNG	AUSZUFÜLLENDES KÄSTCHEN	FELDFORMAT
STSAP34	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Verfahren zur Gewährleistung der Besicherung der Finanzierungszusage)		{ALPHANUM-1000}
STSAP35	Anforderungen an die ABCP-Programmunterlagen (Liquiditätsfazilität und Rückzahlung fällig werdender Wertpapiere, falls der Sponsor die Finanzierungszusage für die Liquiditätsfazilität vor deren Ablauf nicht erneuert)		{ALPHANUM-1000}
STSAP36	Erfahrung des Forderungsverwalters		{ALPHANUM}

**DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2020/1228 DER KOMMISSION****vom 29. November 2019****zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format von Anträgen auf Registrierung als Verbriefungsregister oder auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 10 Absatz 8,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Ein einheitliches Format für die bei der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) einzureichenden Anträge auf Registrierung als Verbriefungsregister oder auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister sollte sicherstellen, dass sämtliche gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1230 der Kommission <sup>(2)</sup> vorgeschriebenen Informationen an die ESMA übermittelt und von dieser problemlos identifiziert werden.
- (2) Es ist wichtig, dass die in diesen Anträgen enthaltenen Informationen in einem Format übermittelt werden, das ihre Speicherung für eine künftige Verwendung und Reproduktion ermöglicht. Deshalb sollten diese Anträge auf einem dauerhaften Datenträger übermittelt werden.
- (3) Um die Identifizierung der im Rahmen dieser Anträge übermittelten Informationen zu vereinfachen, sollten für jedes im Antrag enthaltene Dokument eine eindeutige Referenznummer und ein Titel angegeben werden. Aus demselben Grund sollte der Antragsteller verpflichtet sein, bei jeder übermittelten Information anzugeben, auf welche Bestimmung der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1230 sich die betreffende Information bezieht.
- (4) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, den die ESMA der Kommission vorgelegt hat.
- (5) Gemäß Artikel 15 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und Rates <sup>(3)</sup> hat die ESMA zu dem Entwurf technischer Durchführungsstandards, auf dem diese Verordnung beruht, eine öffentliche Konsultation durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der vorgenannten Verordnung eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

*Artikel 1***Format des Antrags auf Registrierung und Ausweitung der Registrierung**

(1) Anträge auf Registrierung als Verbriefungsregister nach Artikel 10 Absatz 5 Buchstabe a der Verordnung (EU) 2017/2402 werden in dem in Anhang 1 dieser Verordnung festgelegten Format ausgefüllt.

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

<sup>(2)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2020/1230 der Kommission vom 29. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten des Antrags auf Registrierung als Verbriefungsregister und der Einzelheiten des Antrags bei einem vereinfachten Antrag auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister (siehe Seite 345 dieses Amtsblatts).

<sup>(3)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 176/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

- (2) Transaktionsregister, die nach Artikel 10 Absatz 5 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 einen Antrag auf Ausweitung der Registrierung stellen, füllen ihren Antrag in dem in Anhang 2 dieser Verordnung festgelegten Format aus.
- (3) Für die Zwecke der Absätze 1 und 2 erfolgt die Übermittlung der Anträge
- a) auf einem dauerhaften Datenträger im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 Buchstabe m der Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(4)</sup>;
  - b) unter Vergabe einer eindeutigen Referenznummer für jedes im Antrag enthaltene Dokument.

#### Artikel 2

#### **Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 29. November 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER

---

<sup>(4)</sup> Richtlinie 2009/65/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 13. Juli 2009 zur Koordinierung der Rechts- und Verwaltungsvorschriften betreffend bestimmte Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW) (ABl. L 302 vom 17.11.2009, S. 32).

## ANHANG I

**Formate für einen Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister**

Tabelle 1

**Allgemeine Informationen**


---

Datum der Antragstellung

---

Unternehmensbezeichnung des Verbriefungsregisters

---

Ort der Erlangung der Rechtsfähigkeit und Umfang der Geschäftstätigkeit

---

Bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI)

---

Geschäftsanschrift des Verbriefungsregisters

---

Geschäftsanschrift etwaiger Tochterunternehmen des Verbriefungsregisters

---

Geschäftsanschrift etwaiger Zweigniederlassungen des Verbriefungsregisters

---

Uniform Resource Locator (URL) der Website des Verbriefungsregisters

---

Verbriefungsarten, Risikübertragungsmethoden und Arten von zugrunde liegenden Risikopositionen, für die das antragstellende Register die Registrierung beantragt

---

Wurde der Antragsteller von einer zuständigen Behörde des Mitgliedstaats, in dem er seinen Sitz hat, zugelassen oder registriert, Name der Behörde und etwaige Referenznummer der Zulassung oder Registrierung

---

Name(n) der für den Antrag verantwortlichen Person(en)

---

Kontaktdaten der für den Antrag verantwortlichen Person(en)

---

Name(n) der Person(en), die beim Verbriefungsregister für die Compliance verantwortlich sind (oder aller etwaigen anderen Mitarbeiter, die beim Verbriefungsregister an den Compliance-Bewertungen beteiligt sind)

---

Kontaktdaten der Person(en), die in Bezug auf die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beim Verbriefungsregister für die Compliance verantwortlich sind, oder aller etwaigen anderen Mitarbeiter, die in Bezug auf die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beim Verbriefungsregister an den Compliance-Bewertungen beteiligt sind

---

Name etwaiger Mutterunternehmen

---

Bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI) etwaiger Mutterunternehmen

---

Geschäftsanschrift etwaiger Mutterunternehmen

---

Name der zuständigen Aufsichtsbehörde etwaiger Mutterunternehmen

---

Referenznummer der zuständigen Aufsichtsbehörde etwaiger Mutterunternehmen

---

Name eines etwaigen obersten Mutterunternehmens

---

Bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI) eines etwaigen obersten Mutterunternehmens

---

Geschäftsanschrift eines etwaigen obersten Mutterunternehmens

---

Name der zuständigen Aufsichtsbehörde eines etwaigen obersten Mutterunternehmens

---

Referenznummer der zuständigen Aufsichtsbehörde eines etwaigen obersten Mutterunternehmens

---

Tabelle 2

**Dokumentreferenzen <sup>(1)</sup>**

Bestimmung der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1230 der Kommission, in der die im betreffenden Dokument enthaltene Information verlangt wird	Eindeutige Referenznummer des Dokuments	Titel des Dokuments	Kapitel, Abschnitt oder Seite des Dokuments, wo die Information zu finden ist, oder Grund, warum die Information nicht übermittelt wurde
---	---	---------------------	--

<sup>(1)</sup> Für alle nach der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1230 with the exception of points (a) to ( der Kommission verlangten Informationen, mit Ausnahme von deren Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a bis c, e, f, h und i sowie Artikel 7 Absatz 2.

## ANHANG II

**Formate für den Antrag eines Transaktionsregisters auf Ausweitung der Registrierung**

Tabelle 1

**Allgemeine Informationen**

Datum der Antragstellung
Datum der Registrierung des Antragstellers als Transaktionsregister
Unternehmensbezeichnung des Verbriefungsregisters
Bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI)
Geschäftsanschrift des Verbriefungsregisters
Geschäftsanschrift etwaiger Tochterunternehmen des Verbriefungsregisters
Geschäftsanschrift etwaiger Zweigniederlassungen des Verbriefungsregisters
Uniform Resource Locator (URL) der Website des Verbriefungsregisters
Bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI)
Verbriefungsarten, Risikoübertragungsmethoden und Arten von zugrunde liegenden Risikopositionen, für die das antragstellende Register die Registrierung beantragt
Wurde der Antragsteller von einer zuständigen Behörde des Mitgliedstaats, in dem er seinen Sitz hat, zugelassen oder registriert, Name der Behörde und etwaige Referenznummer der Zulassung oder Registrierung
Name(n) der für den Antrag verantwortlichen Person(en)
Kontaktdaten der für den Antrag verantwortlichen Person(en)
Name(n) der Person(en), die in Bezug auf die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beim Verbriefungsregister für die Compliance verantwortlich sind, oder aller etwaigen anderen Mitarbeiter, die in Bezug auf die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beim Verbriefungsregister an den Compliance-Bewertungen beteiligt sind
Kontaktdaten der Person(en), die beim Verbriefungsregister für die Compliance verantwortlich sind (oder aller etwaigen anderen Mitarbeiter, die beim Verbriefungsregister an den Compliance-Bewertungen beteiligt sind)

Tabelle 2

**Dokumentreferenzen <sup>(1)</sup>**

Bestimmung der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1230 der Kommission, in der die im betreffenden Dokument enthaltene Information verlangt wird	Eindeutige Referenznummer des Dokuments	Titel des Dokuments	Kapitel, Abschnitt oder Seite des Dokuments, wo die Information zu finden ist, oder Grund, warum die Information nicht übermittelt wurde
---	---	---------------------	--

(<sup>1</sup>) Für alle nach der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1230 der Kommission verlangten Informationen, mit Ausnahme von deren Artikel 2 Absatz 2 Buchstaben a bis c, e, f, h und i sowie Artikel 7 Absatz 2.

**DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2020/1229 DER KOMMISSION****vom 29. November 2019****zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die operativen Standards von Verbriefungsregistern für die Sammlung, die Aggregation und den Vergleich von Daten, den Zugang zu Daten sowie die Überprüfung der Vollständigkeit und der Konsistenz von Daten****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012 <sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 10 Absatz 7 Buchstabe a und Artikel 17 Absatz 2 Buchstaben b, c und d,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen sollten in der Lage sein, ihre jeweiligen Aufgaben, Mandate und Verpflichtungen zu erfüllen. Folglich sollten die Informationen, die diesen Stellen von den Verbriefungsregistern zur Verfügung gestellt werden, eine hohe Qualität aufweisen und sich fristgerecht, umfassend und strukturiert aggregieren und über Verbriefungsregister hinweg vergleichen lassen. Die Verbriefungsregister sollten daher bewerten, ob die einschlägigen Informationen vollständig und kohärent sind, bevor sie den betreffenden Stellen zur Verfügung gestellt werden, und sie sollten diesen Stellen Tagesabschlussberichte und eine Bewertung der allgemeinen Vollständigkeit der Daten bereitstellen.
- (2) Die Verfahren zur Überprüfung der Vollständigkeit und Kohärenz der Informationen, die den Verbriefungsregistern von Originatoren, Sponsoren oder Verbriefungszweckgesellschaften gemeldet wurden, sollten den verschiedenen Verbriefungsarten, -merkmalen und -praktiken Rechnung tragen. Daher sollten Überprüfungsverfahren vorgesehen werden, bei denen die gemeldeten Informationen mit ähnlichen Verbriefungen verglichen werden, etwa mit Verbriefungen desselben oder eines verbundenen Originators oder mit Verbriefungen, denen dieselbe Risikopositionsart zugrunde liegt oder die dieselben strukturellen oder geografischen Merkmale aufweisen.
- (3) Um die Qualität der gemeldeten Informationen zu gewährleisten, sollten auch die Vollständigkeit und Kohärenz der Unterlagen, die diesen Informationen zugrunde liegen, Gegenstand von Überprüfungsverfahren sein. Da es jedoch relativ schwierig ist, die Vollständigkeit und Kohärenz dieser Unterlagen zu überprüfen, sollten die Verbriefungsregister die meldenden Einrichtungen ersuchen, schriftlich zu bestätigen, dass die ihnen zur Verfügung gestellten zugrunde liegenden Verbriefungsunterlagen vollständig und kohärent sind. Wesentliche Aktualisierungen von bereits vorgelegten Unterlagen sollten als neue Verbriefungsdokumente betrachtet werden, für die eine schriftliche Bestätigung einzuholen ist.
- (4) Damit die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen ihre jeweiligen Aufgaben, Mandate und Verpflichtungen erfüllen können, sollten die Einzelheiten der Verbriefungen, zu denen diese Stellen direkten und unmittelbaren Zugang haben müssen, auf harmonisierte und kohärente Weise über Verbriefungsregister hinweg vergleichbar sein. Solche Einzelheiten sollten daher im XML-Format bereitgestellt werden, da dieses Format in der Finanzbranche breite Anwendung findet.
- (5) Bei jedem Datenaustausch zwischen Verbriefungsregistern und den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen sollte die Vertraulichkeit gewährleistet sein. Ein solcher Datenaustausch sollte daher über eine sichere Machine-to-machine-Verbindung unter Verwendung von Datenverschlüsselungsprotokollen erfolgen. Um gemeinsame Mindeststandards zu gewährleisten, sollte ein SSH-Dateiübertragungsprotokoll (SFTP) eingesetzt werden.

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

- (6) Daten zu den aktuellen einer Verbriefung zugrunde liegenden Risikopositionen, Anlegerberichte, Insiderinformationen und Informationen über signifikante Ereignisse sowie Indikatoren für die Qualität und Aktualität dieser Daten sind von wesentlicher Bedeutung für die laufende Überwachung von Anlagen in Verbriefungspositionen und potenziellen Anlagen sowie für die Finanzstabilität und das Systemrisiko. Die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen sollten daher ad hoc oder in vordefinierten regelmäßigen Zeitabständen und in einem angemessenen Verhältnis zu ihrem jeweiligen Bedarf Zugang zu diesen Daten haben.
- (7) Verbriefungen sind komplex und heterogen, und es gibt ein breites Spektrum an Nutzern, die auf Informationen aus Verbriefungsregistern zugreifen. Infolgedessen ist es von maßgeblicher Bedeutung, den direkten und unmittelbaren Zugang zu bestimmten Datensätzen und Informationen zu erleichtern. Dazu gehört auch, dass der Zugang zu Informationen in einem maschinenlesbaren Format bereitgestellt wird und diese Informationen Daten sowie sämtliche aktuellen und historischen Informationen zu einer in einem Register gespeicherten Verbriefung umfassen. Zu diesem Zweck sollte ein Rahmen für kombinierbare Ad-hoc-Anträge zur Einholung spezifischer Informationen geschaffen werden. Die Fristen, innerhalb deren Verbriefungsregister den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen Daten zur Verfügung bereitzustellen haben, sollten harmonisiert werden, um solchen Stellen und den Verbriefungsregistern eine effiziente Datenverarbeitung zu erleichtern. Gleichzeitig sollte sichergestellt werden, dass Daten innerhalb von Fristen eingeholt werden können, die den betreffenden Stellen ermöglichen, wirksam ihre Aufgaben zu erfüllen.
- (8) Die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen benötigen die von Verbriefungsregistern verwalteten Daten, einschließlich für den Vergleich aktueller Verbriefungen mit früheren Verbriefungen. Im Einklang mit Artikel 10 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 und Artikel 80 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(?)</sup> ist es daher angemessen, dass Verbriefungsregister Aufzeichnungen über eine Verbriefung für einen Zeitraum von zehn Jahren nach deren Beendigung aufbewahren sollten.
- (9) Die Bestimmungen dieser Verordnung sind eng miteinander verknüpft, da sie Standards und Verfahren für die Erhebung und Verarbeitung von Informationen, die von Verbriefungsregistern gehalten werden, sowie den Zugang zu diesen Informationen regeln. Es ist daher angebracht, diese Bestimmungen in einer einzigen Verordnung zusammenzufassen.
- (10) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (11) Die ESMA hat zu diesem Entwurf eine offene öffentliche Konsultation durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(?)</sup> eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

#### **Begriffsbestimmungen**

Für die Zwecke dieser Verordnung bezeichnet der Ausdruck

- a) „meldende Einrichtung“ die gemäß Artikel 7 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 benannte Einrichtung;
- b) „Datenstichtag“ den Stichtag für Meldungen gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission<sup>(\*)</sup>.

<sup>(?)</sup> Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1).

<sup>(?)</sup> Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

<sup>(\*)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (siehe Seite 1 dieses Amtsblatts).

## Artikel 2

**Tagesabschlussbericht**

(1) Verbriefungsregister erstellen täglich einen einzigen aggregierten Tagesabschlussbericht für sämtliche ihnen gemeldeten Verbriefungen, in dem jedoch keine gemeldeten Verbriefungen berücksichtigt werden, die nach Maßgabe des Artikels 4 Absatz 6 zurückgewiesen worden sind. Ein solcher Bericht stützt sich auf die neuesten gemeldeten Informationen, wobei sämtliche gemeldeten Verbriefungen, die nach Maßgabe des Artikels 4 Absatz 6 zurückgewiesen wurden, unberücksichtigt bleiben, und enthält mindestens folgende Informationen:

- a) die eindeutige Kennung, die im Einklang mit Anhang XI der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesen wird;
- b) die ISIN-Codes der Tranchen oder Anleihen oder nachrangigen Darlehen der Verbriefung, sofern verfügbar;
- c) die Summe der aktuellen Kapitalsalden aller Tranchen, Anleihen oder nachrangigen Darlehen der Verbriefung in EUR, wobei die auf der Website der Europäischen Zentralbank für den vorangegangenen Arbeitstag veröffentlichten Wechselkurse zugrunde gelegt werden;
- d) die Bezeichnung der Verbriefung;
- e) die Angabe, ob es sich um eine ABCP-Verbriefung oder eine Nicht-ABCP-Verbriefung handelt;
- f) die Angabe, ob für die Art der Verbriefungsstruktur als Kennung „M“ für Master-Trust-Strukturen im Einklang mit der Angabe in Feld SESS9 des Anhangs XIV der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 oder „S“ für alle sonstigen Verbriefungen verwendet wird;
- g) die Angabe, ob für die Methode zur Risikoübertragung bei Verbriefungen als Kennung „T“ für eine „True-Sale“-Verbriefung im Einklang mit der Angabe in Feld IVSS11 des Anhangs XII der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 oder „S“ für eine synthetische Verbriefung im Einklang mit der Angabe in Feld SESV11 des Anhangs XIV dieser Verordnung oder „ABCP“ für ABCP-Verbriefungen verwendet wird;
- h) die Bezeichnung und die Rechtsträgerkennung (LEI) des Originators, des Sponsors und der Verbriefungszweckgesellschaft;
- i) das aktuelle Zinszahlungsdatum im Datumsformat nach ISO 8601;
- j) den sekundengenauen Zeitstempel im Datums- und Zeitformat nach ISO 8601 (UTC) für die neueste beim Verbriefungsregister eingegangene Datenübermittlung oder, falls es mehrere Datenübermittlungen gibt, die sich auf denselben Datenstichtag beziehen, die Zeitstempel im Datums- und Zeitformat nach ISO 8601 (UTC) für die zuerst eingegangenen und neuesten Datenübermittlungen mit demselben Datenstichtag;
- k) den Datenstichtag im Datums- und Zeitformat nach ISO 8601 für die neuesten Datenübermittlungen, die beim Verbriefungsregister eingegangen sind;
- l) die Anzahl der beim Verbriefungsregister eingegangenen Datenübermittlungen, die sich auf denselben Datenstichtag nach Buchstabe k beziehen;
- m) die Bewertung der Vollständigkeit der Daten im Sinne des Artikels 3 für die neuesten Datenübermittlungen, die beim Verbriefungsregister eingegangen sind;
- n) bei Nicht-ABCP-Verbriefungen das Land, in dem der Originator oder der ursprüngliche Kreditgeber niedergelassen ist;
- o) bei ABCP-Verbriefungen das Land, in dem der Sponsor niedergelassen ist;
- p) das Land, in dem gemessen am aktuellen Kapitalsaldo der zugrunde liegenden Risikopositionen die meisten der zugrunde liegenden Risikopositionen belegen sind;
- q) die gemessen am aktuellen Kapitalsaldo wichtigste Art der zugrunde liegenden Risikopositionen der Verbriefung.
- r) Für die Zwecke von Buchstabe n ist das Land der Niederlassung des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers für den Fall, dass die zugrunde liegenden Verbriefungspositionen eine Kombination aus Risikopositionen mehrerer Originatoren oder ursprünglicher Kreditgeber umfassen, das Land des Originators oder ursprünglichen Kreditgebers, auf den gemessen am aktuellen Kapitalsaldo der Verbriefung die meisten Risikopositionen entfallen.

(2) Der Tagesabschlussbericht wird von den Verbriefungsregistern im XML-Format zur Verfügung gestellt.

(3) Die Zeitstempel, auf die in diesem Artikel verwiesen wird, dürfen maximal um eine Sekunde von der koordinierten Weltzeit (UTC) abweichen, die von einem der Zeitzentren aus dem aktuellsten Jahresbericht zu Zeitaktivitäten des Bureau International des Poids et Mesures (BIPM) festgelegt und aufrechterhalten wird.

## Artikel 3

**Bewertung der Vollständigkeit der Daten**

(4) Für jede Datenübermittlung nehmen die Verbriefungsregister anhand der Bewertungsmatrix in Tabelle 1 des Anhangs und der folgenden Angaben eine Bewertung der Vollständigkeit der Daten vor.

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

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

Dabei bezeichnet

$\sum_i^N \text{ND}x$  die Gesamtzahl der Felder einer Datenübermittlung mit den jeweiligen Werten der „No data“-Optionen („ND-

Werte“), die gemäß Artikel 9 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 gemeldet werden;

N die Gesamtzahl der Felder einer Datenübermittlung, bei der sämtliche Werte der „No data“-Optionen (ND1 bis ND4) gemäß Artikel 9 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 gemeldet werden können.

Bei der Berechnung der Bewertung der Datenvollständigkeit gelten Felder, die unter Verwendung des Formats „ND4-####-MM-TT“ ausgefüllt wurden, als „ND4“-Felder.

## Artikel 4

**Überprüfung der Vollständigkeit und Kohärenz der Informationen**

(1) Bei der Überprüfung der Vollständigkeit und Kohärenz der ihnen gemeldeten Informationen verifizieren die Verbriefungsregister Folgendes:

- a) die Bezeichnung der meldenden Einrichtung gemäß Feld IVSS4 des Anhangs XII oder Feld IVAS3 des Anhangs XIII der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224;
- b) die Korrektheit des in Tabelle 3 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 angegebenen Positionscodes für die Übermittlung.

(2) Darüber hinaus überprüfen die Verbriefungsregister die Vollständigkeit und Kohärenz der in Artikel 7 Absatz 1 Buchstaben a, e, f und g der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Informationen, indem sie

- a) verifizieren, ob die gemeldeten Informationen im Einklang mit der Struktur und dem Format der Meldebögen nach den Anhängen II bis XV der Durchführungsverordnung (EU) 2020/1225 der Kommission <sup>(2)</sup> stehen;
- b) die gemeldeten Informationen wie folgt vergleichen:
  - i) zwischen verschiedenen Feldern in Bezug auf denselben Datenstichtag und dieselbe zugrunde liegende Risikoposition, den Anlegerbericht, Insiderinformationen oder Informationen über signifikante Ereignisse;
  - ii) zwischen verschiedenen zugrunde liegenden Risikopositionen in Bezug auf dasselbe Feld und denselben Datenstichtag, den Anlegerbericht, Insiderinformationen oder Informationen über signifikante Ereignisse;
  - iii) im Rahmen derselben zugrunde liegenden Risikoposition in Bezug auf dasselbe Feld und verschiedene Datenstichtage, den Anlegerbericht, Insiderinformationen oder Informationen über signifikante Ereignisse;
  - iv) zwischen ähnlichen Verbriefungen;

<sup>(2)</sup> Durchführungsverordnung (EU) 2020/1225 der Kommission vom 29. Oktober 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format und die standardisierten Meldebögen, die vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft zur Bereitstellung der Einzelheiten von Verbriefungen zu verwenden sind (siehe Seite 217 dieses Amtsblatts).

- c) verifizieren, ob der Datenstichtag der gemeldeten Informationen und der Zeitstempel der Übermittlung im Einklang mit Artikel 10 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 stehen;
- d) verifizieren, ob die „No data“-Optionen nach Artikel 9 Absatz 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 nur dann verwendet werden, wenn dies gestattet ist, und nicht verhindern, dass die Datenübermittlung hinreichend repräsentativ für die zugrunde liegenden Risikopositionen ist.

Für ABCP-Verbriefungen gelten Verweise auf zugrunde liegende Risikopositionen in diesem Absatz als Verweise auf Arten von zugrunde liegenden Risikopositionen.

(3) Verbriefungsregister überprüfen die Vollständigkeit und Kohärenz der ihnen nach Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Verfügung gestellten Unterlagen, indem sie die meldenden Einrichtungen ersuchen, Folgendes schriftlich zu bestätigen:

- a) Dem Verbriefungsregister wurden alle in Tabelle 3 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 angegebenen Posten bereitgestellt, die nach Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Verfügung zu stellen sind;
- b) die Unterlagen entsprechen den tatsächlichen Modalitäten und Merkmalen der Verbriefung.

(4) Um die schriftliche Bestätigung nach Absatz 3 wird innerhalb folgender Fristen ersucht:

- a) binnen fünf Arbeitstagen nach der erstmaligen Begebung von Wertpapieren im Rahmen einer Verbriefung oder bei ABCP-Verbriefungen innerhalb von fünf Arbeitstagen nach der erstmaligen Begebung von Wertpapieren im Rahmen des ABCP-Programms;
- b) alle zwölf Monate ab dem Datum eines Ersuchens nach Buchstabe a;
- c) binnen fünf Arbeitstagen nach Bereitstellung eines neuen Dokuments gemäß Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402.

Ein Verbriefungsregister, das innerhalb von 14 Tagen nach dem Datum eines Ersuchens nach Unterabsatz 1 keine schriftliche Bestätigung erhalten hat, fordert die meldende Einrichtung auf, die schriftliche Bestätigung innerhalb von 14 Tagen zu übermitteln.

(5) Verbriefungsregister überprüfen, ob die STS-Meldung nach Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe d der Verordnung (EU) 2017/2402, die dem betreffenden Verbriefungsregister zur Verfügung gestellt wurde, der Struktur und dem Format der Meldebögen nach den Anhängen der Durchführungsverordnung (EU) 2020/1227 der Kommission <sup>(6)</sup> entspricht.

(6) Eine Übermittlung von Informationen, die im Sinne der Absätze 1, 2 und 5, ausgenommen Absatz 2 Buchstabe b Ziffern iii und iv, unvollständig oder inkohärent sind, wird vom Verbriefungsregister zurückgewiesen. Das Verbriefungsregister ordnet nach diesem Absatz zurückgewiesene Übermittlungen einer der in Tabelle 2 des Anhangs aufgeführten Kategorien zu.

(7) Das Verbriefungsregister unterrichtet die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen unverzüglich, wenn

- a) die übermittelten Informationen unvollständig oder inkohärent im Sinne von Absatz 2 Buchstabe b Ziffern iii und iv sind;
- b) das Verbriefungsregister keine schriftliche Bestätigung nach Absatz 3 erhalten hat.

(8) Die Verbriefungsregister übermitteln den meldenden Einrichtungen binnen einer Stunde nach Eingang der Informationen nach Artikel 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 eine ausführliche Rückmeldung zu den Ergebnissen der gemäß den Absätzen 1, 2, 3 und 5 durchgeführten Überprüfungen, einschließlich der nach Absatz 6 zugeordneten Kategorie bei einer etwaigen Ablehnung. Darüber hinaus umfasst diese Rückmeldung mindestens Folgendes:

- a) die eindeutige Kennung der Verbriefung, die gemäß Artikel 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesen wird;

---

<sup>(6)</sup> Durchführungsverordnung (EU) 2020/1227 der Kommission vom 12. November 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf Meldebögen für die Bereitstellung von Informationen gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung (siehe Seite 315 dieses Amtsblatts).

- b) den/die Positionscode(s) nach Tabelle 3 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224;
  - c) den sekundengenauen Zeitstempel der Übermittlung der gemeldeten Informationen im Datums- und Zeitformat nach ISO 8601 (UTC).
- (9) Die Verbriefungsregister erstellen jeden Montag bis 19:00:00 UTC einen Bericht über alle Informationen, die sie seit dem vorangehenden Montag um 19:00:00 UTC zurückgewiesen haben. Der Bericht enthält mindestens folgende Angaben:
- a) die eindeutige Kennung der Verbriefung, die gemäß Artikel 11 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 zugewiesen wird;
  - b) die Bezeichnung der Verbriefung;
  - c) die ISIN-Codes der Tranchen oder Anleihen oder nachrangigen Darlehen der Verbriefung, sofern verfügbar;
  - d) die Bezeichnung und die LEI des Originators, des Sponsors und der Verbriefungszweckgesellschaft;
  - e) den sekundengenauen Zeitstempel der übermittelten Informationen im Datums- und Zeitformat nach ISO 8601 (UTC);
  - f) den Positionscode für die Übermittlung nach Tabelle 3 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224;
  - g) die einer Ablehnung zugeordnete Kategorie nach Tabelle 2 des Anhangs dieser Verordnung und die besonderen Umstände im Zusammenhang mit der Zuordnung dieser Kategorie;
  - h) jegliche Erklärung(en) der meldenden Einrichtung, die am Montag der Veröffentlichung des Berichts vor 17:00:00 UTC eingegangen ist/sind und aus der/denen hervorgeht, weshalb die gemeldeten Informationen unvollständig oder inkohärent sind oder weshalb keine schriftliche Bestätigung gemäß Absatz 3 vorgelegt wurde.

#### Artikel 5

##### **Einzelheiten der Informationen, zu denen Zugang zu gewähren ist**

Die Informationen nach Artikel 17 Absatz 2 Buchstabe c der Verordnung (EU) 2017/2402 enthalten folgende Einzelheiten:

- a) sämtliche Informationen, die das Verbriefungsregister von meldenden Einrichtungen gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 erhält;
- b) den Tagesabschlussbericht nach Artikel 2, die Bewertung der Vollständigkeit der Daten nach Artikel 3 sowie alle Informationen, die sich aus den gemäß Artikel 4 dieser Verordnung durchgeführten Überprüfungen ergeben;
- c) alle Formeln und Berechnungs- und Aggregierungsmethoden, die zur Erstellung der Informationen nach den Buchstaben a und b verwendet wurden.

#### Artikel 6

##### **Bedingungen für den Zugang zu Einzelheiten der Informationen**

(1) Der Zugang zu den in Artikel 5 aufgeführten Informationen wird auf Antrag gewährt. Der Antrag auf Zugang muss folgende Angaben enthalten:

- a) die Bezeichnung des Antragstellers;
- b) die Kontaktperson beim Antragsteller;
- c) die Art des um Zugang ersuchenden Antragstellers im Sinne von Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402;
- d) die Namen der Personen beim Antragsteller, die Zugang zu den angeforderten Informationen haben werden;
- e) Referenzen für eine sichere Verbindung für das SSH-Dateiübertragungsprotokoll gemäß Artikel 7 Absatz 2;
- f) die Angabe, ob es sich bei dem Antrag um einen Ad-hoc-Antrag oder einen Antrag in vordefinierten regelmäßigen Zeitabständen handelt;

- g) Identifizierung der angeforderten Informationen auf der Grundlage einer Kombination der Kriterien nach Absatz 4;
  - h) sonstige technische Informationen, die für den Zugang des Antragstellers relevant sind.
- (2) Für die Zwecke des Absatzes 1 müssen Verbriefungsregister
- a) eine oder mehrere Personen benennen, die für die Kontakte mit den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 aufgeführten Stellen zuständig ist/sind;
  - b) die Bedingungen für den Zugang zu Informationen sowie Anweisungen für die Übermittlung eines Antrags auf Zugang zu diesen Informationen auf ihrer Website veröffentlichen;
  - c) lediglich zu den im Antrag auf Zugang spezifizierten Informationen Zugang gewähren;
  - d) so bald wie möglich, spätestens jedoch innerhalb von 30 Tagen, nachdem ein Antrag auf Einrichtung eines Zugangs zu den betreffenden Informationen gestellt wurde, die technischen Vorkehrungen einrichten, die erforderlich sind, damit die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen Anträge auf Zugang zu diesen Informationen stellen können.
- (3) Zu den in Artikel 5 genannten Informationen wird innerhalb der folgenden Zeitrahmen Zugang gewährt:
- a) bei einem Ad-hoc-Antrag oder einem Antrag in vordefinierten regelmäßigen Zeitabständen auf einen Tagesabschlussbericht gemäß Artikel 2 spätestens um 19:00:00 UTC an dem Tag, auf den sich der Bericht bezieht;
  - b) bei Informationen, die eine Verbriefung betreffen, für die noch kein Preis festgesetzt wurde oder die noch nicht fällig ist oder die in Bezug auf das Datum der Antragstellung vor weniger als einem Jahr fällig war, spätestens um 12:00:00 UTC am ersten Tag nach dem Tag des Eingangs des Antrags auf Zugang;
  - c) bei Informationen, die eine Verbriefung betreffen, die in Bezug auf das Datum der Antragstellung vor mehr als einem Jahr fällig war, spätestens drei Arbeitstage nach dem Tag des Eingangs des Antrags auf Zugang;
  - d) bei Informationen, die mehrere Verbriefungen betreffen, die unter die Buchstaben b und c fallen, spätestens drei Arbeitstage nach dem Tag des Eingangs des Antrags auf Zugang.
- (4) Verbriefungsregister gewähren den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen Zugang zu den Informationen nach Artikel 5 auf der Grundlage einer beliebigen Kombination der folgenden Kriterien:
- a) Verbriefungsart: Nicht-ABCP-Verbriefung oder ABCP-Verbriefung;
  - b) Art der Verbriefungsstruktur: entweder „M“ für Master-Trust-Strukturen im Einklang mit der Angabe in Feld SESS9 des Anhangs XIV der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 oder „S“ für alle sonstigen Verbriefungen;
  - c) Verfahren der Risikübertragung bei Verbriefungen: entweder „Y“ für eine „True-Sale“-Verbriefung im Einklang mit der Angabe in Feld IVSS11 des Anhangs XII der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224, „Y“ für eine synthetische Verbriefung im Einklang mit der Angabe in Feld SESV11 des Anhangs XIV dieser Verordnung oder „ABCP“ für ABCP-Verbriefungen;
  - d) Positionscode der Verbriefung;
  - e) Art der zugrunde liegenden Risikoposition der Verbriefung;
  - f) Abschnitt zur zugrunde liegenden Risikoposition der Verbriefung;
  - g) Abschnitt zum Meldebogen für den Anlegerbericht im Zusammenhang mit der Verbriefung;
  - h) Abschnitt zum Meldebogen für signifikante Ereignisse oder für Insiderinformationen im Zusammenhang mit der Verbriefung;
  - i) Kennung:
    - i) eindeutige Kennung;
    - ii) Transaktionskennung;
    - iii) Internationale Wertpapierkennnummer;

- iv) neue oder ursprüngliche Kennung der Tranche/Anleihe;
  - v) neue oder ursprüngliche Kennung der zugrunde liegenden Risikoposition;
  - vi) neue oder ursprüngliche Kennung des Schuldners;
  - vii) Rechtsträgerkennung des Originators;
  - viii) Rechtsträgerkennung des Sponsors;
  - ix) Rechtsträgerkennung der Verbriefungszweckgesellschaft;
  - x) Rechtsträgerkennung des ursprünglichen Kreditgebers;
  - xi) Rechtsträgerkennung des CLO-Managers;
- j) geografische Angaben:
- i) geografisches Gebiet;
  - ii) anwendbares Recht;
- k) Datum und Uhrzeit:
- i) Zeitstempel der Übermittlung;
  - ii) Datenstichtag;
  - iii) Ausgabedatum der Tranche/Anleihe;
  - iv) gesetzliche Fälligkeit der Tranche/Anleihe;
  - v) Datum der Originierung der zugrunde liegenden Risikoposition;
  - vi) Fälligkeitsdatum der zugrunde liegenden Risikoposition;
- l) Währung:
- i) Währung der Tranche/Anleihe;
  - ii) Währung der zugrunde liegenden Risikoposition.
- (5) Folgende Informationen werden von den Verbriefungsregistern im XML-Format zur Verfügung gestellt:
- a) die Informationen, auf die in Artikel 7 Absatz 1 Buchstabe a und Buchstaben d bis g der Verordnung (EU) 2017/2402 verwiesen wird;
  - b) die Informationen, die von Verbriefungsregistern im Einklang mit den Artikeln 2 und 4 dieser Verordnung erstellt wurden, ausgenommen nach Artikel 4 Absatz 3 eingegangene schriftliche Bestätigungen.

#### Artikel 7

### Standards für Datenerhebung und Datenzugang

- (1) Verbriefungsregister verwenden elektronische Signaturen und Datenverschlüsselungsprotokolle für die Entgegennahme von Daten meldender Einrichtungen oder anderer Verbriefungsregister und die Übermittlung von Daten an die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen.
- (2) Für die Zwecke des Absatzes 1 richten Verbriefungsregister eine sichere Machine-to-machine-Schnittstelle ein, halten diese aufrecht und stellen sie den meldenden Einrichtungen und den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen zur Verfügung. Bei dieser Schnittstelle wird das SSH-Dateiübertragungsprotokoll eingesetzt.
- (3) Verbriefungsregister verwenden standardisierte XML-Mitteilungen, um über die in Absatz 2 genannte Schnittstelle zu kommunizieren und um die in Artikel 6 Absatz 5 der vorliegenden Verordnung genannten Informationen den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen zur Verfügung zu stellen.

*Artikel 8***Aufbewahrungspflichten**

- (1) Verbriefungsregister zeichnen Folgendes auf:
- a) Überprüfungen gemäß dieser Verordnung und jegliche sonstige Validierung durch das Verbriefungsregister;
  - b) die beim Verbriefungsregister eingegangenen schriftlichen Bestätigungen nach Artikel 4 Absatz 3;
  - c) die Ergebnisse, die das Verbriefungsregister der meldenden Einrichtung gemäß Artikel 4 Absatz 6 bereitgestellt hat;
  - d) jegliche Erklärung der meldenden Einrichtung, weshalb die übermittelten Informationen unvollständig oder inkohärent sind oder weshalb keine schriftliche Bestätigung nach Artikel 4 Absatz 7 vorliegt;
  - e) die Einzelheiten etwaiger von der meldenden Einrichtung vorgelegter Berichtigungen oder Annullierungen, in einem Meldeprotokoll;
  - f) alle sonstigen nach dieser Verordnung erstellten oder übermittelten Informationen.
- (2) Jede Aufzeichnung wird für einen Zeitraum von zehn Jahren nach Beendigung der Verbriefung, auf die sich die Aufzeichnung bezieht, aufbewahrt.
- (3) Das Meldeprotokoll nach Absatz 1 Buchstabe d enthält die eindeutige Kennung der Verbriefung, den Positionscode, den Zeitstempel der betreffenden Übermittlung, den Zeitstempel der Änderungen und eine klare Beschreibung der Änderungen der übermittelten Informationen, einschließlich des vorherigen und neuen Inhalts dieser Informationen.

*Artikel 9***Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 29. November 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER

## ANHANG

**Matrix für die Bewertung der Datenvollständigkeit und Kategorien für Ablehnungen**

Tabelle 1

**Matrix für die Bewertung der Datenvollständigkeit**

		Input 1: Anteil der als „ND1“ ausgewiesenen Felder			
		Input 1 = 0 %	0 % < Input 1 ≤ 10 %	10 % < Input 1 ≤ 30 %	Input 1 > 30 %
Input 2: Anteil der als „ND2“, „ND3“, oder „ND4-YYYY-MM-DD“ ausgewiesenen Felder	Input 2 = 0 %	A1	B1	C1	D1
	0 % < Input 2 ≤ 20 %	A2	B2	C2	D2
	20 % < Input 2 ≤ 40 %	A3	B3	C3	D3
	Input 2 > 40 %	A4	B4	C4	D4

Tabelle 2

**Kategorien für Ablehnungen**

<b>Kategorien für Ablehnungen</b>	<b>Grund</b>
Schema	Schema nicht vorschriftsmäßig
Berechtigung	Die meldende Einrichtung ist nicht zur Meldung im Namen des Originators, des Sponsors oder der Verbriefungszweckgesellschaft berechtigt.
Logik	Der Positionscode entspricht nicht den verfügbaren Werten in Tabelle 3 des Anhangs I der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission.
Geschäft	Die Datenübermittlung entspricht in einem oder mehreren Punkten nicht den Vorgaben.
Repräsentativität	Ablehnung der Datenübermittlung nach Artikel 4 Absatz 6.

**DELEGIERTE VERORDNUNG (EU) 2020/1230 DER KOMMISSION****vom 29. November 2019****zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Einzelheiten des Antrags auf Registrierung als Verbriefungsregister und der Einzelheiten des vereinfachten Antrags auf Ausweitung der Registrierung als Transaktionsregister****(Text von Bedeutung für den EWR)**

DIE EUROPÄISCHE KOMMISSION —

gestützt auf den Vertrag über die Arbeitsweise der Europäischen Union,

gestützt auf die Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. Dezember 2017 zur Festlegung eines allgemeinen Rahmens für Verbriefungen und zur Schaffung eines spezifischen Rahmens für einfache, transparente und standardisierte Verbriefung und zur Änderung der Richtlinien 2009/65/EG, 2009/138/EG, 2011/61/EU und der Verordnungen (EG) Nr. 1060/2009 und (EU) Nr. 648/2012<sup>(1)</sup>, insbesondere auf Artikel 10 Absatz 7 Unterabsatz 3, sofern sich dieser auf Unterabsatz 1 Buchstaben b und c bezieht,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Nach Artikel 7 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 sind die Informationen für eine Verbriefungstransaktion mittels eines Verbriefungsregisters oder, falls kein Verbriefungsregister nach Artikel 10 der genannten Verordnung registriert ist, auf einer Website zur Verfügung zu stellen, die bestimmte Anforderungen erfüllt. Artikel 10 der Verordnung (EU) 2017/2402 legt die Bedingungen und das Verfahren für die Registrierung von Verbriefungsregistern fest und verlangt von einem Verbriefungsregister entweder einen Antrag auf Registrierung oder einen Antrag auf eine Ausweitung der Registrierung für die Zwecke des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402, wenn es bereits gemäß Titel VI Kapitel 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(2)</sup> oder gemäß Kapitel III der Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates<sup>(3)</sup> registriert ist.
- (2) Damit den Marktteilnehmern möglichst wenig zusätzliche operative Kosten entstehen, sollten sich die Vorschriften für die Registrierung von Verbriefungsregistern, insbesondere auch die Vorschriften für die Registrierung durch Ausweitung der Registrierung für die Zwecke des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402, auf die bereits vorhandenen Infrastrukturen, operativen Verfahren und Formate stützen, die für die Meldung von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Derivatekontrakten eingeführt wurden. Die Verbriefungsvorschriften sollten jedoch auch die Besonderheiten von Verbriefungen, insbesondere die mit dem Hosting von Verbriefungsdaten und -dokumenten verbundene Komplexität, und die jüngsten Marktentwicklungen widerspiegeln, wie den einheitlichen Gebrauch von Rechtsträgerkennungen (LEI), der eine bessere Ordnung und Klassifizierung der im Antrag anzugebenden Informationen über juristische Personen ermöglicht. Der Übersichtlichkeit und Einfachheit für die Antragsteller halber ist es außerdem wünschenswert, dass die Registrierungsvorschriften in derselben Reihenfolge angeordnet werden die betreffenden Anforderungen in der Verordnung (EU) 2017/2402.
- (3) Verbriefungen sind hochkomplexe Instrumente, die eine Vielzahl unterschiedlichster Informationen beinhalten, etwa zu den Merkmalen der zugrunde liegenden Risikopositionen, deren Cashflows, der Struktur der Verbriefung oder auch den rechtlichen und operativen Vereinbarungen, die mit Dritten geschlossen wurden. Daher ist es wichtig, dass angehende Verbriefungsregister ausreichende Kenntnisse und praktische Erfahrung mit Verbriefungen sowie die Fähigkeit nachweisen können, die in der Verordnung (EU) 2017/2402 festgelegten einschlägigen Informationen entgegenzunehmen, zu verarbeiten und zur Verfügung zu stellen. Angehende Verbriefungsregister sollten auch nachweisen können, dass ihr Personal, ihre Systeme, ihre Kontrollen und ihre Verfahren angemessen sind, um die Erfüllung der Anforderungen der Verordnung (EU) 2017/2402 sicherzustellen.

<sup>(1)</sup> ABl. L 347 vom 28.12.2017, S. 35.

<sup>(2)</sup> Verordnung (EU) Nr. 648/2012 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 4. Juli 2012 über OTC-Derivate, zentrale Gegenparteien und Transaktionsregister (ABl. L 201 vom 27.7.2012, S. 1).

<sup>(3)</sup> Verordnung (EU) 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung sowie zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 (ABl. L 337 vom 23.12.2015, S. 1).

- (4) Verbriefungsregister können so genannte „Verbriefungs-Nebendienstleistungen“ erbringen, die mit der Erbringung der Dienstleistungen, für die gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 eine Registrierung als Verbriefungsregister vorgeschrieben ist (so genannte „Verbriefungs-Kerndienstleistungen“), unmittelbar zusammenhängen und sich daraus ergeben. Beispielsweise können Verbriefungsregister Recherche- oder Beratungsdienstleistungen für einen angehenden Verbriefungsemittenten erbringen und dafür die dem Verbriefungsregister vorliegenden Verbriefungsdaten nutzen. Verbriefungsregister können auch Nebendienstleistungen erbringen, die weder unmittelbar mit der Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen zusammenhängen noch sich daraus ergeben (im Folgenden „verbriefungsfremde Nebendienstleistungen“). Werden jedoch Ressourcen innerhalb eines Verbriefungsregisters sowohl für die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen als auch die Erbringung von Verbriefungs-Nebendienstleistungen oder gar verbiefungsfremden Nebendienstleistungen genutzt, so könnte dies bei operationellen Risiken zu einer Ansteckung zwischen den genannten Dienstleistungen führen. Bei Dienstleistungen, die die Validierung, den Abgleich, die Verarbeitung oder die Aufzeichnung von Informationen beinhalten, könnte daher eine wirksame operative Trennung erforderlich sein, um eine solche Ansteckung zu vermeiden. Dagegen könnten Praktiken wie gemeinsame Front-End-Systeme, ein gemeinsamer Informationszugangspunkt oder der Einsatz derselben Mitarbeiter in Vertrieb, Compliance oder einem Kunden-Helpdesk als weniger ansteckungsanfällig betrachtet werden und werden somit nicht unbedingt eine operative Trennung erfordern. Antragstellende Verbriefungsregister sollten daher nachweisen müssen, dass sie zwischen den Ressourcen, Systemen und Verfahren, die in ihren an der Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beteiligten Geschäftsbereichen verwendet werden, und den Ressourcen, Systemen und Verfahren, die in anderen, an der Erbringung von Nebendienstleistungen beteiligten Geschäftsbereichen verwendet werden, für ein angemessenes Maß an operativer Trennung gesorgt haben, und zwar unabhängig davon, ob diese anderen Geschäftsbereiche von dem Verbriefungsregister, einer verbundenen Einrichtung oder einer anderen Einrichtung geführt werden.
- (5) Artikel 10 Absatz 5 der Verordnung (EU) 2017/2402 sieht einen vereinfachten Antrag auf Ausweitung der Registrierung für den Fall vor, dass Transaktionsregister, die bereits gemäß der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 oder der Verordnung (EU) 2015/2365 registriert sind, beantragen, dass ihre bestehende Registrierung als Transaktionsregister für die Zwecke des Artikels 7 der Verordnung (EU) 2017/2402 ausgeweitet wird. Um Doppelaufgaben zu vermeiden, sollten daher die Informationen, die von einem Transaktionsregister bei einem Antrag auf Ausweitung der Registrierung zur Verfügung zu stellen sind, auf Einzelheiten zu den Anpassungen beschränkt werden, die notwendig sind, um die Konformität mit der Verordnung (EU) 2017/2402 sicherzustellen.
- (6) Diese Verordnung beruht auf dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, der der Kommission von der Europäischen Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde (ESMA) vorgelegt wurde.
- (7) Gemäß Artikel 10 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und Rates (\*) hat die ESMA zu dem Entwurf technischer Regulierungsstandards, auf dem diese Verordnung beruht, eine öffentliche Konsultation durchgeführt, die damit verbundenen potenziellen Kosten- und Nutzeneffekte analysiert und die Stellungnahme der nach Artikel 37 der Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 eingesetzten Interessengruppe Wertpapiere und Wertpapiermärkte eingeholt —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

#### Artikel 1

### Begriffsbestimmungen

Für die Zwecke dieser Verordnung bezeichnet der Ausdruck

1. „Nutzer“ in Bezug auf ein Verbriefungsregister eines von Folgendem:
  - a) eine der in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 aufgeführten Stellen;
  - b) eine meldende Einrichtung in Bezug auf dieses Verbriefungsregister;
  - c) jeden anderen Kunden des Verbriefungsregisters, der die vom Verbriefungsregister erbrachten Verbriefungs-Kerndienstleistungen nutzt;

(\*) Verordnung (EU) Nr. 1095/2010 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 24. November 2010 zur Errichtung einer Europäischen Aufsichtsbehörde (Europäische Wertpapier- und Marktaufsichtsbehörde), zur Änderung des Beschlusses Nr. 716/2009/EG und zur Aufhebung des Beschlusses 2009/77/EG der Kommission (ABl. L 331 vom 15.12.2010, S. 84).

2. „meldende Einrichtung“ die gemäß Artikel 7 Absatz 2 Unterabsatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 benannte Einrichtung;
3. „Verbriefungs-Kerndienstleistungen“ Dienstleistungen, für die gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 eine Registrierung als Verbriefungsregister vorgeschrieben ist;
4. „Verbriefungs-Nebendienstleistungen“ von einem Verbriefungsregister erbrachte Dienstleistungen, die unmittelbar mit den von diesem Verbriefungsregister erbrachten Verbriefungs-Kerndienstleistungen zusammenhängen und sich aus diesen ergeben;
5. „verbriefungsfremde Nebendienstleistungen“ Dienstleistungen, bei denen es sich weder um Verbriefungs-Kerndienstleistungen noch um Verbriefungs-Nebendienstleistungen handelt;
6. für die folgenden Ausdrücke gelten die in Artikel 2 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 festgelegten Begriffsbestimmungen:
  - a) „Gruppe“;
  - b) „Mutterunternehmen“;
  - c) „Tochterunternehmen“;
  - d) „Eigenkapital“;
  - e) „enge Verbindung“;
  - f) „Leitungsorgan“;
7. „Geschäftsleitung“ die Person(en), die die Geschäfte des Verbriefungsregisters tatsächlich leitet/leiten, und das oder die geschäftsführende(n) Mitglied(er) seines Leitungsorgans.

## Artikel 2

### **Identität, Rechtsform und Art der Verbriefung**

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält Angaben zur Identität des Antragstellers und zu dessen geplanten Tätigkeiten, für die eine Registrierung als Verbriefungsregister vorgeschrieben ist.
- (2) Für die Zwecke von Absatz 1 enthält der Antrag insbesondere Folgendes:
  - a) die Unternehmensbezeichnung des Antragstellers, seine Geschäftsanschrift in der Union sowie die Unternehmensbezeichnung und Geschäftsanschrift etwaiger Tochterunternehmen und Zweigniederlassungen des Antragstellers;
  - b) die bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI) des Antragstellers;
  - c) den Uniform Resource Locator (URL) der Website des Antragstellers;
  - d) einen zum Zeitpunkt der Stellung des Antrags auf Registrierung als Verbriefungsregister gültigen Auszug aus dem einschlägigen Handels- oder Gerichtsregister, aus dem der Ort der Erlangung der Rechtsfähigkeit und der Umfang der Geschäftstätigkeit des Antragstellers ersichtlich sind, oder einen anderen zum Zeitpunkt der Antragstellung gültigen urkundlichen Nachweis für den Ort der Erlangung der Rechtsfähigkeit und den Umfang der Geschäftstätigkeit des Antragstellers;
  - e) die Verbriefungsarten (ABCP-Transaktion oder Nicht-ABCP-Transaktion), die Risikoubertragungsmethoden (traditionelle Verbriefung oder synthetische Verbriefung) und die Arten von zugrunde liegenden Risikopositionen (Wohnimmobilien, Gewerbeimmobilien, Leasingverträge, Konsumentenkredite, Kfz-Darlehen, Kreditkarten, sonstige („esoteric exposures“)), für die sich der Antragsteller registrieren lassen möchte;
  - f) die Angabe, ob der Antragsteller von einer zuständigen Behörde des Mitgliedstaats, in dem er seinen Sitz hat, zugelassen oder registriert wurde, und wenn ja, den Namen der zuständigen Behörde und eine etwaige Referenznummer der Zulassung oder Registrierung;
  - g) die Satzung des Antragstellers oder gleichwertige Gründungsverträge und, sofern relevant, sonstige satzungsmäßige Unterlagen, aus denen hervorgeht, dass der Antragsteller Verbriefungs-Kerndienstleistungen erbringen wird;

- h) den Namen und die Kontaktdaten der Person(en), die in Bezug auf die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen für die Compliance verantwortlich ist/sind, oder aller anderen Mitarbeiter, die in Bezug auf die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen an den Compliance-Bewertungen beteiligt sind;
  - i) den Namen und die Kontaktdaten der für den Antrag zuständigen Ansprechperson;
  - j) den Geschäftsplan mit Angaben zum Standort der Hauptgeschäftsbereiche des Antragstellers;
  - k) jede etwaige Verbriefungs-Nebendienstleistung oder verbriefungsfremde Nebendienstleistung, die der Antragsteller erbringt oder erbringen will;
  - l) sämtliche Informationen zu etwaigen anhängigen Gerichts-, Verwaltungs- oder Schiedsverfahren oder sonstigen Rechtsstreitigkeiten gleich welcher Art, insbesondere in Steuer- oder Insolvenzsachen, bei denen der Antragsteller Partei ist und die mit erheblichen Kosten oder erheblichem Imageschaden verbunden sein könnten, sowie sämtliche Informationen zu etwaigen nicht mehr anhängigen Verfahren, die für das Verbriefungsregister aber immer noch mit erheblichen Kosten verbunden sein könnten.
- (3) Auf Verlangen übermittelt der Antragsteller der ESMA während der Prüfung des Registrierungsantrags zusätzliche Informationen, wenn diese benötigt werden, damit die Fähigkeit des Antragstellers zur Erfüllung der anwendbaren Anforderungen der Verordnung (EU) 2017/2402 beurteilt werden kann und damit die ESMA die vorzulegenden oder bereits vorgelegten Unterlagen gebührend interpretieren und analysieren kann.
- (4) Ist eine Anforderung dieser Verordnung nach Auffassung des Antragstellers auf ihn nicht anwendbar, gibt er in seinem Antrag klar an, um welche Anforderung es sich handelt, und begründet, warum diese nicht anwendbar ist.

### Artikel 3

#### Organisationsplan

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält einen Organisationsplan, der über die Organisationsstruktur des Antragstellers sowie etwaiger Verbriefungs-Nebendienstleistungen und verbriefungsfremder Nebendienstleistungen Aufschluss gibt.
- (2) Der in Absatz 1 genannte Organisationsplan enthält Informationen über die Identität der für jede einzelne wichtige Funktion verantwortlichen Personen, insbesondere auch über die Identität jedes Mitglieds der Geschäftsleistung sowie die Identität der Personen, die die Geschäfte etwaiger Tochterunternehmen und Zweigniederlassungen tatsächlich leiten.

### Artikel 4

#### Unternehmensführung

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält Informationen über die internen Unternehmensführungsstrategien des Antragstellers und über Verfahren und Mandate, denen die Geschäftsleitung, einschließlich des Leitungsorgans, seiner nicht geschäftsführenden Mitglieder und gegebenenfalls Ausschüsse, unterliegt.
- (2) Die in Absatz 1 genannten Informationen beinhalten eine Beschreibung der Verfahren für die Auswahl, Ernennung, Leistungsbewertung und Abberufung der Geschäftsleitung.
- (3) Hält ein Antragsteller einen anerkannten Verhaltenskodex für die Unternehmensführung ein, so wird dieser im Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister genannt und dargelegt, weshalb der Antragsteller in bestimmten Situationen von diesem Kodex abweicht.

### Artikel 5

#### Interne Kontrolle

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält detaillierte Informationen über das interne Kontrollsystem des Antragstellers, insbesondere auch Informationen über seine Compliance-Funktion, seine Risikobewertung, seine internen Kontrollmechanismen und die von seiner Innenrevisionsfunktion getroffenen Vorkehrungen.

- (2) Die in Absatz 1 genannten detaillierten Informationen umfassen:
- a) die internen Kontrollstrategien des Antragstellers und die für deren konsistente und wirksame Umsetzung eingerichteten Verfahren;
  - b) alle etwaigen Strategien, Verfahren und Handbücher für die Überwachung und Bewertung der Angemessenheit und Wirksamkeit der Systeme des Antragstellers;
  - c) alle etwaigen Strategien, Verfahren und Handbücher für die Kontrolle und den Schutz der Informationsverarbeitungssysteme des Antragstellers;
  - d) die Bezeichnung der internen Stellen, die für die Bewertung der Ergebnisse der internen Kontrolle zuständig sind.
- (3) In Bezug auf die Innenrevisionstätigkeiten des Antragstellers enthält ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister die folgenden Informationen:
- a) bei Bestehen eines internen Prüfungsausschusses dessen Zusammensetzung, Kompetenzen und Zuständigkeiten;
  - b) das Regelwerk, die Methodik, die Standards und die Verfahren der Innenrevisionsfunktion des Antragstellers;
  - c) eine Erläuterung, wie das Regelwerk, die Methodik und die Verfahren, die der Antragsteller in Bezug auf seine Innenrevisionsfunktion eingerichtet hat, unter Berücksichtigung der Art und des Umfangs seiner Geschäfte, komplexen Gegebenheiten und Risiken entwickelt und angewandt werden;
  - d) ein Programm für die Arbeit des internen Prüfungsausschusses für den Dreijahreszeitraum ab Antragstellung, in dem auf die Art und den Umfang der Geschäfte, komplexen Gegebenheiten und Risiken des Antragstellers eingegangen wird.

#### Artikel 6

#### Interessenkonflikte

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält die folgenden Informationen über die vom Antragsteller eingeführten Strategien und Verfahren für die Handhabung von Interessenkonflikten:
- a) Strategien und Verfahren für die unverzügliche Feststellung, Handhabung, Beseitigung, Minderung und Offenlegung von Interessenkonflikten;
  - b) eine Beschreibung des Verfahrens, mit dem sichergestellt wird, dass die einschlägigen Personen die unter Buchstabe a genannten Strategien und Verfahren kennen;
  - c) eine Beschreibung des Maßes und der Form der Trennung zwischen den verschiedenen Unternehmensfunktionen innerhalb der Organisation des Antragstellers, insbesondere auch eine Beschreibung
    - i) der Maßnahmen, die ergriffen wurden, um den Informationsaustausch zwischen Funktionen für den Fall, dass Interessenkonflikte auftreten könnten, zu verhindern oder zu kontrollieren;
    - ii) der Beaufsichtigung von Personen, aus deren Hauptfunktionen Interessen entstehen, die mit den Interessen eines Kunden in Konflikt geraten könnten;
  - d) aller sonstigen Maßnahmen und Kontrollen, die eingeführt wurden, um sicherzustellen, dass die unter Buchstabe a genannten Strategien und Verfahren für die Handhabung von Interessenkonflikten und das unter Buchstabe b genannte Verfahren eingehalten werden.
- (2) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält ein zum Zeitpunkt der Antragstellung aktuelles Verzeichnis bestehender und potenzieller wesentlicher Interessenkonflikte in Bezug auf alle etwaigen Verbriefungs-Kerndienstleistungen oder Verbriefungs-Nebendienstleistungen sowie verbiefungsfremde Nebendienstleistungen, die vom Antragsteller erbracht oder in Anspruch genommen werden, sowie eine Beschreibung, wie diese Konflikte gehandhabt werden oder gehandhabt werden sollen. Das Verzeichnis der Interessenkonflikte enthält auch Interessenkonflikte, die aus folgenden Situationen erwachsen:
- a) jeder Situation, in der der Antragsteller zum Schaden eines Kunden einen finanziellen Gewinn erzielt oder einen finanziellen Verlust vermeidet;
  - b) jeder Situation, in der der Antragsteller ein Interesse am Ergebnis einer für einen Kunden erbrachten Dienstleistung hat, das sich vom Interesse des Kunden am Ergebnis der Dienstleistung unterscheidet;

- c) jeder Situation, in der der Antragsteller ein Interesse daran haben könnte, den eigenen Interessen oder den Interessen eines anderen Nutzers oder einer Gruppe von Nutzern Vorrang gegenüber den Interessen des Kunden einzuräumen, für den die Dienstleistung erbracht wird;
  - d) jeder Situation, in der der Antragsteller für die für einen Kunden erbrachte Dienstleistung von einer anderen Person als dem Kunden einen Anreiz in Form von Geld, Waren oder Dienstleistungen erhält oder erhalten könnte, wobei aber die für die Dienstleistung erhaltenen Provisionen oder Gebühren unberücksichtigt bleiben.
- (3) Ist der Antragsteller Teil einer Gruppe, so enthält das Verzeichnis alle bestehenden und potenziellen wesentlichen Interessenkonflikte, die sich aus anderen Unternehmen der Gruppe ergeben, und Angaben dazu, wie diese Konflikte gehandhabt und gemindert werden.

#### Artikel 7

### Eigentumsverhältnisse des Verbriefungsregisters

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält:
- a) eine Liste aller Personen oder Einrichtungen, die direkt oder indirekt mindestens 5 % des Kapitals oder der Stimmrechte des Antragstellers halten oder deren Beteiligung einen maßgeblichen Einfluss auf die Geschäftsführung des Antragstellers ermöglicht;
  - b) eine Liste sämtlicher Unternehmen, bei denen eine unter Buchstabe a genannte Person mindestens 5 % des Kapitals oder der Stimmrechte hält oder einen maßgeblichen Einfluss auf die Geschäftsführung ausübt.
- (2) Hat der Antragsteller ein Mutterunternehmen oder ein oberstes Mutterunternehmen, so gibt er
- a) die bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierte Rechtsträgerkennung (LEI) und die Geschäftsanschrift des Mutterunternehmens bzw. des obersten Mutterunternehmens an;
  - b) an, ob das Mutterunternehmen bzw. das oberste Mutterunternehmen zugelassen oder registriert ist und einer Aufsicht unterliegt, und teilt — sollte dies der Fall sein — jede etwaige Referenznummer sowie den Namen der zuständigen Aufsichtsbehörde mit.

#### Artikel 8

### Eigentümerübersicht

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält eine Übersicht über die Eigentumsverhältnisse innerhalb der Gruppe des Antragstellers, insbesondere auch zwischen dem obersten Mutterunternehmen, dem Mutterunternehmen, den Tochterunternehmen und jeglichen anderen verbundenen Unternehmen oder Zweigniederlassungen.
- (2) In der in Absatz 1 genannten Übersicht werden die Unternehmen mit ihrer vollständigen Bezeichnung, ihrer Rechtsform, ihrer Geschäftsanschrift und ihrer bei der Global Legal Entity Identifier Foundation registrierten LEI aufgeführt.

#### Artikel 9

### Strategien und Verfahren

Die in einem Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister verlangten Angaben zu Strategien und Verfahren beinhalten Folgendes:

- a) Belege dafür, dass die Strategien vom Leitungsorgan und die Verfahren von der Geschäftsleitung gebilligt werden und die Geschäftsleitung für die Umsetzung und Beibehaltung dieser Strategien und Verfahren verantwortlich ist;
- b) eine Beschreibung, wie diese Strategien und Verfahren innerhalb der Organisation des Antragstellers kommuniziert werden, wie die Einhaltung dieser Strategien und Verfahren im täglichen Geschäftsbetrieb sichergestellt und überwacht wird, und wer für die Einhaltung dieser Strategien und Verfahren verantwortlich ist;
- c) alle etwaigen Aufzeichnungen, aus denen hervorgeht, dass die Mitarbeiter sowie im Rahmen von Auslagerungsvereinbarungen tätige Mitarbeiter diese Strategien und Verfahren kennen;

- d) eine Beschreibung der Maßnahmen, die bei einem Verstoß gegen die Strategien und Verfahren ergriffen werden sollen;
- e) eine Beschreibung des Verfahrens, nach dem der ESMA jeder wesentliche Verstoß gegen die Strategien oder Verfahren gemeldet wird, der dazu führen kann, dass die Bedingungen für die Registrierung nicht mehr erfüllt sind;
- f) eine Beschreibung der Vorkehrungen für die umgehende Unterrichtung der ESMA über etwaige geplante wesentliche Änderungen an den IT-Systemen des Antragstellers, bevor diese implementiert werden.

#### Artikel 10

### Rechtskonformität

Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält in Bezug auf die Strategien und Verfahren, mit denen der Antragsteller die Einhaltung der Verordnung (EU) 2017/2402 gewährleisten will, Folgendes:

- a) eine Beschreibung der Aufgaben der Compliance-Beauftragten sowie sämtlicher anderer an den Compliance-Bewertungen beteiligter Mitarbeiter, einschließlich einer Beschreibung, wie die Unabhängigkeit der Compliance-Funktion vom Rest des Unternehmens sichergestellt wird;
- b) die internen Strategien und Verfahren, die sicherstellen sollen, dass der Antragsteller samt seiner Manager und Beschäftigten die Verordnung (EU) 2017/2402 einhält, einschließlich einer Beschreibung der Aufgaben des Leitungsorgans und der Geschäftsleitung;
- c) sofern verfügbar, den jüngsten internen Bericht über die Einhaltung der Verordnung (EU) 2017/2402, der von den Compliance-Beauftragten oder anderen an den Compliance-Bewertungen beteiligten Mitarbeitern innerhalb der Organisation des Antragstellers erstellt wurde.

#### Artikel 11

### Strategien und Verfahren für die Mitarbeiter

Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält:

- a) eine Kopie der auf die Geschäftsleitung, die Mitglieder des Leitungsorgans und die mit Risiko- und Kontrollfunktionen betrauten Mitarbeiter des Antragstellers angewandten Vergütungspolitik;
- b) eine Beschreibung der Maßnahmen, die der Antragsteller zur Minderung des Risikos einer zu starken Abhängigkeit von einzelnen Mitarbeitern ergriffen hat.

#### Artikel 12

### Informationen über die Mitarbeiter des Antragstellers, die an der Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beteiligt sind

Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält folgende Informationen über die an der Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beteiligten Mitarbeiter des Antragstellers:

- a) eine allgemeine Liste der vom Antragsteller unmittelbar beschäftigten Mitarbeiter, einschließlich ihrer jeweiligen Aufgaben und ihrer Qualifikationen für die jeweilige Aufgabe;
- b) eine spezifische Beschreibung der für die Informationstechnologie zuständigen Mitarbeiter, die unmittelbar für die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen beschäftigt werden, einschließlich der Aufgaben und Qualifikationen der einzelnen Mitarbeiter;
- c) eine Beschreibung der Aufgaben und Qualifikationen jeder einzelnen für Innenrevision, interne Kontrollen, Compliance, Risikobewertung und interne Überprüfung zuständigen Person;

- d) die Namen der Mitarbeiter und der im Rahmen etwaiger Auslagerungsvereinbarungen tätigen Mitarbeiter;
- e) Einzelheiten zu den Schulungen, die die Mitarbeiter zu den Strategien und Verfahren des Antragstellers sowie zum Verbriefungsregistergeschäft erhalten haben, insbesondere auch zu jeder etwaigen Prüfung oder anderen Art formaler Bewertung, die für die Mitarbeiter im Hinblick auf die Durchführung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen vorgeschrieben sind.

Die in Absatz 1 Buchstabe b genannte Beschreibung muss für mindestens ein Mitglied des IT-Teams schriftliche Nachweise der Erfahrung im Bereich Informationstechnologie enthalten.

### Artikel 13

#### Finanzberichte und Geschäftspläne

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält die folgenden Finanzinformationen:
  - a) einen kompletten Abschluss des Antragstellers, der auf eine der beiden folgenden Weisen erstellt wurde:
    - i) nach den gemäß Artikel 3 der Verordnung (EG) Nr. 1606/2002 des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(<sup>5</sup>)</sup> übernommenen internationalen Rechnungslegungsstandards;
    - ii) nach den nationalen Rechnungslegungsgrundsätzen des Mitgliedstaats, in dem der Antragsteller seinen Sitz hat, nach Maßgabe der Richtlinie 2013/34/EU des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(<sup>6</sup>)</sup>;
  - b) wenn die Abschlüsse des Antragstellers einer Abschlussprüfung im Sinne von Artikel 2 Absatz 1 der Richtlinie 2006/43/EG des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(<sup>7</sup>)</sup> unterzogen werden müssen, enthalten die Abschlüsse den Bestätigungsvermerk zum Jahres- und zum konsolidierten Abschluss;
  - c) wenn beim Antragsteller eine Abschlussprüfung durchgeführt wird, den Namen und die nationale Registernummer des externen Prüfers.
- (2) Liegen die in Absatz 1 genannten Finanzinformationen nicht vor, enthält ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister die folgenden Informationen über den Antragsteller:
  - a) einen Pro-Forma-Abschluss, aus dem die Angemessenheit der Ressourcen und die erwartete Geschäftslage in den sechs Monaten nach der Registrierung als Verbriefungsregister hervorgehen;
  - b) einen Zwischenbericht, wenn für den verlangten Zeitraum noch kein Abschluss nach den in Absatz 1 genannten Rechtsakten vorliegt;
  - c) einen Überblick über die Finanzlage, wie eine Bilanz, eine Gewinn- und Verlustrechnung, Änderungen bei Eigenkapital und Cashflows, eine Zusammenfassung der Rechnungslegungsgrundsätze und andere nach den in Absatz 1 genannten Rechtsakten vorgeschriebene Erläuterungen.
- (3) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält einen finanziellen Geschäftsplan, in dem für einen mindestens dreijährigen Referenzzeitraum unterschiedliche Geschäftsszenarien für die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen dargelegt werden und der für jedes Szenario die folgenden Informationen enthält:
  - a) die erwarteten Einnahmen aus jeder vom Antragsteller erbrachten Dienstleistungskategorie, getrennt aufgeführt nach folgenden Kategorien:
    - i) Verbriefungs-Kerndienstleistungen;
    - ii) Verbriefungs-Nebendienstleistungen;

<sup>(5)</sup> Verordnung (EG) Nr. 1606/2002 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 19. Juli 2002 betreffend die Anwendung internationaler Rechnungslegungsstandards (ABl. L 243 vom 11.9.2002, S. 1).

<sup>(6)</sup> Richtlinie 2013/34/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über den Jahresabschluss, den konsolidierten Abschluss und damit verbundene Berichte von Unternehmen bestimmter Rechtsformen und zur Änderung der Richtlinie 2006/43/EG des Europäischen Parlaments und des Rates und zur Aufhebung der Richtlinien 78/660/EWG und 83/349/EWG des Rates (ABl. L 182 vom 29.6.2013, S. 19).

<sup>(7)</sup> Richtlinie 2006/43/EG des Europäischen Parlaments und des Rates vom 17. Mai 2006 über Abschlussprüfungen von Jahresabschlüssen und konsolidierten Abschlüssen, zur Änderung der Richtlinien 78/660/EWG und 83/349/EWG des Rates und zur Aufhebung der Richtlinie 84/253/EWG des Rates (ABl. L 157 vom 9.6.2006, S. 87).

- iii) Transaktionsregister-Kerndienstleistungen, die in der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Derivaten nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bestehen;
  - iv) Transaktionsregister-Nebendienstleistungen, die unmittelbar mit der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Derivaten nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 zusammenhängen und sich daraus ergeben;
  - v) Transaktionsregister-Kerndienstleistungen, die in der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften nach der Verordnung (EU) 2015/2365 bestehen;
  - vi) Transaktionsregister-Nebendienstleistungen, die unmittelbar mit der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften nach der Verordnung (EU) 2015/2365 zusammenhängen und sich daraus ergeben;
  - vii) kombinierte Nebendienstleistungen, die unmittelbar mit einer der folgenden Dienstleistungskombinationen zusammenhängen und sich daraus ergeben:
    - sowohl Verbriefungs-Kerndienstleistungen als auch Transaktionsregister-Kerndienstleistungen, die in der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Derivaten nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bestehen;
    - sowohl Verbriefungs-Kerndienstleistungen als auch Transaktionsregister-Kerndienstleistungen, die in der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften nach der Verordnung (EU) 2015/2365 bestehen;
    - sowohl Transaktionsregister-Kerndienstleistungen, die in der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Derivaten nach der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 bestehen, als auch Transaktionsregister-Kerndienstleistungen, die in der zentralen Sammlung und Verwahrung von Aufzeichnungen zu Wertpapierfinanzierungsgeschäften nach der Verordnung (EU) 2015/2365 bestehen;
  - viii) verbriefungsfremde Nebendienstleistungen, die der behördlichen Registrierung und Aufsicht unterliegen, unabhängig davon, ob sie in der Union erbracht werden oder nicht;
- b) die Anzahl der Verbriefungstransaktionen, die der Antragsteller den in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Nutzern zur Verfügung zu stellen erwartet;
- c) die festen und die variablen Kosten für die Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen.

Die im finanziellen Geschäftsplan dargelegten verschiedenen Geschäftsszenarien beinhalten ein Einnahmen-Basisszenario, positive und negative Abweichungen um mindestens 20 % von diesem Einnahmen-Basisszenario sowie positive und negative Abweichungen um mindestens 20 % von der im finanziellen Geschäftsplan angegebenen Basisanzahl der erwarteten Verbriefungstransaktionen.

(4) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält den geprüften Jahresabschluss jedes Mutterunternehmens für die drei dem Antragsdatum vorausgehenden Geschäftsjahre, sofern verfügbar.

(5) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält die folgenden Informationen über den Antragsteller:

- a) eine Beschreibung etwaiger künftiger Pläne für die Errichtung von Tochterunternehmen und deren Standort;
- b) eine Beschreibung der geplanten Geschäftstätigkeiten, einschließlich der Tätigkeiten etwaiger Tochterunternehmen oder Zweigniederlassungen.

#### Artikel 14

### Informationstechnologische Ressourcen

Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält die folgenden Informationen über die informationstechnologischen Ressourcen:

- a) eine detaillierte Beschreibung des Informationstechnologiesystems, das der Antragsteller für die Erbringung der Verbriefungs-Kerndienstleistungen nutzt, einschließlich der Angabe, welche Informationstechnologiesysteme für welche in Artikel 2 Absatz 2 Buchstabe e genannte Verbriefungsart und Art zugrunde liegender Risikoposition verwendet werden;

- b) die relevanten Geschäftsanforderungen, die funktionalen und technischen Spezifikationen, die Speicherkapazität, die Systemskalierbarkeit (sowohl für die Erfüllung der Systemfunktionen als auch für die Bewältigung von Informationszuwächsen bei der Verarbeitung von und dem Zugriff auf Anfragen), die Obergrenzen für die maximale Größe von Datenmeldungen nach der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1229 der Kommission <sup>(8)</sup>, die Systemarchitektur und die technische Ausführung des Systems, das Datenmodell und die Datenströme sowie die operativen und administrativen Verfahren und Handbücher;
- c) eine detaillierte Beschreibung der Nutzereinrichtungen, die der Antragsteller zur Erbringung von Dienstleistungen für die Nutzer entwickelt hat;
- d) die Strategien und Verfahren des Antragstellers für Investitionen und Erneuerungen im Bereich der informationstechnologischen Ressourcen, einschließlich des Überprüfungs- und Entwicklungszyklus der Systeme des Antragstellers sowie seiner Versionierungs- und Teststrategien;
- e) ein Dokument mit einer detaillierten Beschreibung, wie der Antragsteller mittels eines XML-Schemas (XML: erweiterbare Auszeichnungssprache) die in den Anhängen der Durchführungsverordnung (EU) 2020/1225 der Kommission <sup>(9)</sup>, den Anhängen der Durchführungsverordnung (EU) 2020/1227 der Kommission <sup>(10)</sup> und in jeglichen zusätzlichen XML-Nachrichten enthaltenen Meldebögen unter Verwendung von der ESMA gestellter Spezifikationen implementiert hat;
- f) die Strategien und Verfahren für den Umgang mit Änderungen an den Meldebögen in den Anhängen der Durchführungsverordnung (EU) 2020/1225.

#### Artikel 15

### Mechanismen für die Sammlung und Verfügbarmachung von Informationen

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält:
  - a) eine detaillierte Beschreibung des Verfahrens sowie der Ressourcen, Methoden und Kanäle, die der Antragsteller nutzen wird, um die zeitnahe strukturierte und umfassende Sammlung von Daten von den meldenden Einrichtungen sicherzustellen, einschließlich einer Kopie etwaiger Meldehandbücher, die den meldenden Einrichtungen zur Verfügung gestellt werden sollen;
  - b) eine Beschreibung der Ressourcen, Methoden und Kanäle, die der Antragsteller nutzen wird, um einen direkten und sofortigen Zugang der in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen zu den in den Artikeln 2 bis 8 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission <sup>(11)</sup> genannten Informationen sicherzustellen, einschließlich einer Kopie etwaiger Benutzerhandbücher und interner Verfahren, die benötigt werden, um einen derartigen Zugang zu erhalten;
  - c) eine Beschreibung der Verfahren, die der Antragsteller nutzen wird, um die in Artikel 3 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1229 genannten Punktwerte für die Vollständigkeit der Daten zu berechnen, sowie eine Beschreibung der Ressourcen, Methoden und Kanäle, die der Antragsteller nutzen wird, um einen direkten und sofortigen Zugang der in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen entsprechend den Vorgaben der vorgenannten Verordnung zu diesen Daten sicherzustellen, einschließlich einer Kopie etwaiger Benutzerhandbücher und interner Verfahren, die benötigt werden, um einen derartigen Zugang zu erhalten.
- (2) In der in Absatz 1 Buchstabe a genannten detaillierten Beschreibung wird
  - a) zwischen automatisierten und manuellen Ressourcen, Methoden und Kanälen unterschieden;

<sup>(8)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2020/1229 der Kommission vom 29. November 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards für die operativen Standards von Verbriefungsregistern für die Sammlung, die Aggregation und den Vergleich von Daten, den Zugang zu Daten sowie die Überprüfung der Vollständigkeit und der Konsistenz von Daten (siehe Seite 335 dieses Amtsblatts).

<sup>(9)</sup> Durchführungsverordnung (EU) 2020/1225 der Kommission vom 29. Oktober 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für das Format und die standardisierten Meldebögen, die vom Originator, vom Sponsor und von der Verbriefungszweckgesellschaft zur Bereitstellung der Einzelheiten von Verbriefungen zu verwenden sind (siehe Seite 217 dieses Amtsblatts).

<sup>(10)</sup> Durchführungsverordnung (EU) 2020/1227 der Kommission vom 12. November 2019 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf Meldebögen für die Bereitstellung von Informationen gemäß den Anforderungen an die STS-Meldung (siehe Seite 315 dieses Amtsblatts).

<sup>(11)</sup> Delegierte Verordnung (EU) 2020/1224 der Kommission vom 16. Oktober 2019 zur Ergänzung der Verordnung (EU) 2017/2402 des Europäischen Parlaments und des Rates durch technische Regulierungsstandards zur Festlegung der Informationen, die von Originator, Sponsor und Verbriefungszweckgesellschaft zu den Einzelheiten von Verbriefungen bereitzustellen sind (siehe Seite 1 dieses Amtsblatts).

- b) bei manuellen Ressourcen, Methoden und Kanälen
  - i) beschrieben, wie diese Ressourcen, Methoden oder Kanäle im Sinne von Artikel 14 Buchstabe b dieser Verordnung skalierbar sind;
  - ii) beschrieben, welche spezifischen Verfahren der Antragsteller eingeführt hat, um sicherzustellen, dass diese Ressourcen, Methoden und Kanäle dem Artikel 24 dieser Verordnung genügen.

#### Artikel 16

### Nebendienstleistungen

Wenn der Steller eines Antrags auf Registrierung als Verbriefungsregister, ein Unternehmen seiner Gruppe oder ein Unternehmen, mit dem der Antragsteller eine Vereinbarung über Verbriefungs-Kerndienstleistungen geschlossen hat, Verbriefungs-Nebendienstleistungen oder verbriefungsfremde Nebendienstleistungen anbietet oder anzubieten plant, enthält der Antrag auf Registrierung

- a) eine Beschreibung der Verbriefungs-Nebendienstleistungen oder verbriefungsfremden Nebendienstleistungen, die der Antragsteller oder das Unternehmen seiner Gruppe erbringt oder zu erbringen plant, sowie eine Beschreibung jeder etwaigen Vereinbarung des Antragstellers mit Unternehmen, die solche Dienstleistungen anbieten, sowie Kopien dieser Vereinbarungen;
- b) die Verfahren und Strategien, die ein angemessenes Maß an operativer Trennung der Ressourcen, Systeme, Informationen und Verfahren zwischen den Verbriefungs-Kerndienstleistungen des Antragstellers und allen etwaigen Verbriefungs-Nebendienstleistungen oder verbriefungsfremden Nebendienstleistungen gewährleisten, unabhängig davon, ob die betreffende Dienstleistung von dem Antragsteller, einem Unternehmen seiner Gruppe oder jedweden anderen Unternehmen erbracht wird, mit dem er eine Vereinbarung geschlossen hat.

#### Artikel 17

### Geschäftsleitung und Mitglieder des Leitungsorgans

Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält für jedes Mitglied der Geschäftsleitung Folgendes:

- a) eine Kopie des Lebenslaufs des Mitglieds mit den folgenden Informationen, sofern sie für die Beurteilung, ob die Erfahrungen und Kenntnisse des Mitglieds für die Erfüllung seiner Aufgaben ausreichen, relevant sind:
  - i) einer Übersicht über den postsekundären Bildungsweg des Mitglieds;
  - ii) dem beruflichen Werdegang des Mitglieds unter Angabe der betreffenden Daten, der bekleideten Positionen und einer Beschreibung der damit verbundenen Aufgaben;
  - iii) jeder Berufsqualifikation des Mitglieds unter Angabe des Datums, an dem diese erworben wurde, sowie dem Status einer Mitgliedschaft in einer einschlägigen Berufsorganisation;
- b) detaillierte Informationen über die Kenntnisse und Erfahrungen in Bezug auf Verbriefungen sowie auf IT-Management, IT-Operationen und IT-Entwicklung;
- c) Einzelheiten zu etwaigen strafrechtlichen Verurteilungen in Verbindung mit der Erbringung von Finanz- oder Datendienstleistungen oder wegen betrügerischer Handlungen oder Veruntreuungen, insbesondere in Form einer amtlichen Urkunde, sollte diese innerhalb des betreffenden Mitgliedstaats verfügbar sein;
- d) eine vom Mitglied unterzeichnete Erklärung, aus der hervorgeht, ob das Mitglied
  - i) in Verbindung mit der Erbringung von Finanz- oder Datendienstleistungen oder wegen betrügerischer Handlungen oder Veruntreuungen strafrechtlich verurteilt wurde;
  - ii) bei einem von einer Regulierungsbehörde, staatlichen Stelle oder Agentur angestregten Disziplinarverfahren gleich welcher Art eine nachteilige Entscheidung erhalten hat oder noch Gegenstand eines solchen Verfahrens ist;

- iii) in einem zivilrechtlichen Verfahren in Verbindung mit der Erbringung von Finanz- oder Datendienstleistungen oder wegen Unregelmäßigkeiten oder Betrugs bei der Führung eines Geschäfts von einem Gericht für schuldig befunden wurde;
  - iv) dem Leitungsorgan oder der Geschäftsleitung eines Unternehmens angehört hat, dem von einer Regulierungsstelle die Registrierung oder Zulassung entzogen wurde;
  - v) das Recht zur Ausübung von Tätigkeiten, die eine Registrierung oder Zulassung durch eine Regulierungsstelle erfordern, verweigert erhielt;
  - vi) dem Leitungsorgan oder der Geschäftsleitung eines Unternehmens angehört hat, das in der Zeit, in der das Mitglied mit dem Unternehmen verbunden war, oder innerhalb eines Jahres nach Ausscheiden des Mitglieds aus dem Unternehmen Insolvenz angemeldet hat oder liquidiert wurde;
  - vii) dem Leitungsorgan oder der Geschäftsleitung eines Unternehmens angehört hat, das von einer Regulierungsstelle eines Fehlverhaltens für schuldig befunden oder einer Sanktion unterworfen wurde;
  - viii) wegen Betrugs, Veruntreuung oder in Verbindung mit der Erbringung von Finanz- oder Datendienstleistungen von einer staatlichen Stelle, einer Regulierungsstelle oder einer Berufsorganisation mit einer Geldstrafe belegt, suspendiert, für ungeeignet erklärt oder einer anderen Sanktion unterworfen wurde;
  - ix) infolge von Fehlverhalten oder missbräuchlichen Praktiken in einem Unternehmen eines Geschäftsleitungspostens oder einer Führungsposition enthoben, entlassen oder einer anderen Position enthoben wurde;
- e) eine Erklärung über alle potenziellen Interessenkonflikte, denen das Mitglied bei der Wahrnehmung seiner Aufgaben ausgesetzt sein könnte, sowie eine Erläuterung, wie diese gehandhabt werden.

#### Artikel 18

#### **Transparenz hinsichtlich der Zugangsregeln**

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält:
- a) die Strategien und Verfahren, nach denen die verschiedenen Arten von Nutzern die Daten, die im Verbriefungsregister zentral gesammelt, erstellt und verwahrt werden, melden und darauf zugreifen, einschließlich eines jeden Prozesses, mit dem die Nutzer auf die vom Verbriefungsregister verwalteten Daten zugreifen, sie aufrufen, abfragen oder ändern können, sowie der Verfahren zur Authentifizierung der auf das Transaktionsregister zugreifenden Nutzer;
  - b) eine Kopie der Bedingungen, die die Rechte und Pflichten der verschiedenen Arten von Nutzern in Bezug auf die vom Verbriefungsregister verwahrten Daten festlegen;
  - c) eine Beschreibung der verschiedenen Zugangskategorien für Nutzer;
  - d) eine detaillierte Beschreibung der Zugangsstrategien und -verfahren, mit denen ein diskriminierungsfreier Zugang der Nutzer zu den Verbriefungsregisterdaten sichergestellt werden soll, einschließlich einer Beschreibung
    - i) etwaiger Zugangsbeschränkungen;
    - ii) etwaiger Unterschiede bei den Zugangsbedingungen oder -beschränkungen für die verschiedenen meldenden Einrichtungen und die verschiedenen in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Stellen;
    - iii) der Zugangsstrategien und -verfahren, die sicherstellen, dass der Zugang möglichst wenig beschränkt wird, und der Verfahren, die zur Verfügung stehen, um eine Zugangsbeschränkung oder -verweigerung in Frage zu stellen oder rückgängig zu machen;
  - e) eine detaillierte Beschreibung der Zugangsstrategien und -verfahren, nach denen anderen Dienstleistern ein diskriminierungsfreier Zugang zu den Verbriefungsregisterdaten eingeräumt wird, wenn die betreffende meldende Einrichtung hierzu ihre freiwillige und widerrufliche schriftliche Einwilligung erteilt hat, einschließlich einer Beschreibung
    - i) etwaiger Zugangsbeschränkungen;
    - ii) etwaiger Unterschiede bei den Zugangsbedingungen oder -beschränkungen;

- iii) der Zugangsstrategien und -verfahren, die sicherstellen, dass der Zugang möglichst wenig beschränkt wird, und der Verfahren, die zur Verfügung stehen, um eine Zugangsbeschränkung oder -verweigerung in Frage zu stellen oder rückgängig zu machen;
  - f) eine Beschreibung der Kanäle und Mechanismen, mit denen für potenzielle und tatsächliche Nutzer offengelegt wird, mittels welcher Verfahren Nutzer letztlich auf die vom Verbriefungsregister verwalteten Informationen zugreifen können, und mit denen für potenzielle und tatsächliche meldende Einrichtungen offengelegt wird, mittels welcher Verfahren sie letztlich über den Antragsteller Informationen zur Verfügung stellen können.
- (2) Die in Absatz 1 Buchstaben a bis d genannten Informationen werden für jede der folgenden Nutzerkategorien bereitgestellt:
- a) Mitarbeiter und anderes mit dem Antragsteller verbundenes Personal, insbesondere auch innerhalb derselben Gruppe;
  - b) Originatoren, Sponsoren und Verbriefungszweckgesellschaften (als ein und dieselbe Kategorie);
  - c) die in Artikel 17 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 aufgeführten Stellen;
  - d) sonstige Dienstleister;
  - e) jede sonstige vom Antragsteller ermittelte Nutzerkategorie (wobei die Informationen für jede dieser Kategorien getrennt anzugeben sind).

#### Artikel 19

### Transparenz hinsichtlich der Preispolitik

In einem Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister wird Folgendes beschrieben:

- a) die Preispolitik des Antragstellers, einschließlich etwaiger Nachlässe und Rabatte sowie der Bedingungen für die Inanspruchnahme solcher Vergünstigungen;
- b) die Struktur der vom Antragsteller für Verbriefungs-Kerndienstleistungen und Verbriefungs-Nebendienstleistungen erhobenen Gebühren, einschließlich der geschätzten Kosten jeder dieser Dienstleistungen, sowie Einzelheiten zu den Methoden, nach denen die gesonderten Kosten, die dem Antragsteller bei der Erbringung von Verbriefungs-Kerndienstleistungen und Verbriefungs-Nebendienstleistungen möglicherweise entstehen, verbucht werden, sowie die Gebühren, die der Antragsteller für die Übermittlung von Informationen an ein anderes Verbriefungsregister sowie für die Entgegennahme der von einem anderen Verbriefungsregister übermittelten Informationen erhebt;
- c) die Methoden, nach denen der Antragsteller die unter den Buchstaben a und b genannten Informationen öffentlich zugänglich macht, einschließlich einer Kopie der Gebührenstruktur, wobei nach Verbriefungs-Kerndienstleistungen und, sofern sie erbracht werden, Verbriefungs-Nebendienstleistungen getrennt wird.

#### Artikel 20

### Operationelles Risiko

- (1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält:
- a) eine detaillierte Beschreibung der verfügbaren Ressourcen und der Verfahren, mit denen die operationellen Risiken und alle anderen wesentlichen Risiken, denen der Antragsteller ausgesetzt ist, ermittelt und gemindert werden sollen, einschließlich einer Kopie aller maßgeblichen Strategien, Methodiken, internen Verfahren und hierfür erstellten Handbücher;
  - b) eine Beschreibung des eigenkapitalfinanzierten liquiden Nettovermögens, mit dem potenzielle allgemeine Geschäftsverluste gedeckt werden sollen, um unter Fortführung des Unternehmens weiterhin Verbriefungsdienstleistungen erbringen zu können;
  - c) eine Bewertung im Hinblick darauf, ob die finanziellen Ressourcen des Antragstellers ausreichen, um die operativen Kosten einer Abwicklung oder Sanierung kritischer Operationen und Dienstleistungen über einen Zeitraum von mindestens neun Monaten zu decken;

- d) den Plan des Antragstellers zur Fortführung des Geschäftsbetriebs und eine Beschreibung der Grundsätze für die Aktualisierung dieses Plans einschließlich
- i) aller Geschäftsprozesse, Ressourcen, Eskalationsverfahren und verbundener Systeme, die für die Gewährleistung der Verbriefungs-Kerndienstleistungen des Antragstellers von zentraler Bedeutung sind, einschließlich aller relevanten ausgelagerten Dienstleistungen und einschließlich der Strategie, der Grundsätze und der Ziele des Antragstellers für die Fortführung dieser Prozesse;
  - ii) jeglicher Vorkehrungen, die mit anderen Finanzmarktinfrastruktur-Anbietern, insbesondere auch anderen Verbriefungsregistern, getroffen wurden;
  - iii) der Vorkehrungen, die für die kritischen Funktionen einen Mindestdienstleistungsumfang gewährleisten sollen, und der für die vollständige Wiederherstellung dieser Funktionen erwartete Zeitbedarf;
  - iv) des für die Wiederherstellung von Geschäftsprozessen und -systemen maximal akzeptablen Zeitraums, der den in Artikel 7 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 festgelegten Meldefristen und den Datenmengen Rechnung tragen sollte, die der Antragsteller innerhalb des Quartalszeitraums verarbeiten muss;
  - v) der Verfahren für die Erfassung von Zwischenfällen und Überprüfungen;
  - vi) eines periodischen Testprogramms, das kurz- und mittelfristig ausreichende Tests über ein angemessenes Spektrum von Szenarien sicherstellt, die unter anderem, aber nicht nur Systemausfälle, Naturkatastrophen, Kommunikationsstörungen, den Verlust von wichtigen Mitarbeitern und die Unfähigkeit zur Nutzung der gewöhnlichen Räumlichkeiten beinhalten, und das Tests vorsieht, mit denen ermittelt wird, wie Hardware, Software und Kommunikationssysteme auf potenzielle Bedrohungen reagieren, nebst Testergebnissen und Folgemaßnahmen zu Tests sowie den Systemen, die bei den getesteten spezifischen Szenarien versagt haben;
  - vii) der Anzahl der verfügbaren alternativen technischen und operativen Räumlichkeiten, deren Adresse, der Ressourcen dieser Räumlichkeiten im Vergleich zum Hauptstandort und der Verfahren, die für den Fall, dass auf alternative Räumlichkeiten zurückgegriffen werden muss, zur Fortführung des Geschäftsbetriebs vorhanden sind;
  - viii) Informationen über den Zugang zu Ausweichräumlichkeiten des Unternehmens, damit die Mitarbeiter die Kontinuität der Verbriefungs-Kerndienstleistungen gewährleisten können, wenn ein Hauptstandort nicht zur Verfügung steht;
  - ix) der Pläne, Verfahren und Vorkehrungen für den Umgang mit Notfällen und die Gewährleistung der Sicherheit der Mitarbeiter;
  - x) der Pläne, Verfahren und Vorkehrungen für die Bewältigung von Krisen, für die Koordinierung der Gesamtmaßnahmen zur Fortführung des Geschäftsbetriebs und zur Bestimmung ihrer rechtzeitigen (innerhalb des vom Antragsteller für die Wiederherstellung angestrebten Zeitraums) und wirksamen Aktivierungs-, Mobilisierungs- und Eskalationsfähigkeit;
  - xi) der Pläne, Verfahren und Vorkehrungen zur Wiederherstellung der System-, Anwendungs- und Infrastrukturkomponenten des Antragstellers innerhalb des vom Antragsteller für die Wiederherstellung vorgesehenen Zeitraums;
  - xii) der Einzelheiten zur Schulung der Mitarbeiter im Umgang mit den Vorkehrungen zur Geschäftsfortführung und den in diesem Zusammenhang von jedem Einzelnen wahrzunehmenden Aufgaben, einschließlich eigener Sicherheitsmitarbeiter, die für eine sofortige Reaktion auf eine Störung der Dienstleistungen bereitstehen;
- e) eine Beschreibung der Vorkehrungen, die im Falle einer Störung die Verbriefungs-Kerndienstleistungen des Antragstellers gewährleisten sollen, und der Einbindung seiner Nutzer und anderer Dritter in diese Vorkehrungen;
- f) eine Beschreibung der Vorkehrungen des Antragstellers, mit denen etwaige Dienstleistungsunterbrechungen oder Verbindungsstörungen sowie der für die Wiederaufnahme der normalen Dienstleistungen erwartete Zeitbedarf auf seiner Website veröffentlicht und der ESMA sowie den anderen Nutzern umgehend zur Kenntnis gebracht werden;
- g) eine Beschreibung der Vorkehrungen des Antragstellers, die es seinen Mitarbeitern ermöglichen, die Leistung seiner IT-Systeme in Echtzeit kontinuierlich zu überwachen.

(2) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält eine Kopie der Strategien und Verfahren, mit denen die ordnungsgemäße Übermittlung von Informationen an andere Verbriefungsregister und die Umleitung von Meldungen an andere Verbriefungsregister sichergestellt werden.

## Artikel 21

### Auslagerung

(1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält den Nachweis, dass für den Fall, dass der Antragsteller Tätigkeiten in seinem Auftrag durch Dritte ausführen lässt, insbesondere auch durch Unternehmen, mit denen er enge Verbindungen unterhält, sichergestellt ist, dass der Dritte über die Fähigkeit und die Kapazität verfügt, diese Tätigkeiten verlässlich und professionell durchzuführen.

(2) Der Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält Folgendes:

- a) eine Beschreibung des Umfangs der auszulagernden Tätigkeiten sowie Angaben zu Details und Umfang dieser Auslagerung;
- b) eine Kopie der betreffenden Dienstgütevereinbarungen mit klaren Rollen und Zuständigkeiten, Kennzahlen und Zielen für jede ausgelagerte wesentliche Anforderung des Antragstellers, den Methoden zur Überwachung der Dienstgüte der ausgelagerten Funktionen und den Maßnahmen, die ergriffen werden, wenn die Dienstgüteziele nicht erreicht werden;
- c) eine Kopie der diese Dienstgütevereinbarungen regelnden Verträge, aus denen insbesondere auch die Identität des Drittdienstleisters hervorgeht;
- d) eine Kopie etwaiger externer Berichte über die ausgelagerten Tätigkeiten, sofern verfügbar;
- e) Einzelheiten zu den organisatorischen Maßnahmen und Strategien im Hinblick auf eine Auslagerung und deren Risiken im Sinne von Absatz 4.

(3) Der Registrierungsantrag enthält den Nachweis, dass die Auslagerung die Fähigkeit des Antragstellers zur Erfüllung der Aufgaben der Geschäftsleitung oder des Leitungsorgans nicht beeinträchtigt.

(4) Der Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält Informationen, mit denen hinreichend nachgewiesen wird, dass der Antragsteller für etwaige ausgelagerte Tätigkeiten verantwortlich bleibt, und eine Beschreibung der organisatorischen Maßnahmen des Antragstellers, mit denen sichergestellt wird,

- a) dass der Drittdienstleister die ausgelagerten Tätigkeiten effektiv und unter Einhaltung anwendbarer Gesetze und regulatorischer Anforderungen durchführt und dass der Drittdienstleister erkannte Mängel angemessen beseitigt;
- b) dass der Antragsteller Risiken im Zusammenhang mit ausgelagerten Tätigkeiten erkennt und diese Risiken in angemessener Weise periodisch überwacht werden;
- c) dass für ausgelagerte Tätigkeiten angemessene Kontrollverfahren eingerichtet wurden und diese Tätigkeiten und ihre Risiken beim Antragsteller insbesondere auch einer wirksamen Überwachung unterliegen;
- d) dass die Kontinuität ausgelagerter Tätigkeiten angemessen sichergestellt werden kann.

Für die Zwecke von Unterabsatz 1 Buchstabe d übermittelt der Antragsteller Informationen über die Vorkehrungen des Drittdienstleisters zur Geschäftsfortführung, einschließlich einer vom Antragsteller vorgenommenen Bewertung der Qualität dieser Vorkehrungen zur Geschäftsfortführung und erforderlichenfalls etwaiger vom Antragsteller verlangter Verbesserungen dieser Vorkehrungen zur Geschäftsfortführung.

(5) Wird der Drittdienstleister von einer Regulierungsbehörde beaufsichtigt, enthält der Registrierungsantrag auch Informationen, die nachweisen, dass der Drittdienstleister im Zusammenhang mit ausgelagerten Tätigkeiten mit dieser Behörde zusammenarbeitet.

## Artikel 22

### Sicherheit

(1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält Belege, dafür

- a) dass seine IT-Systeme gegen Missbrauch oder unbefugten Zugriff geschützt sind;

- b) dass seine Informationssysteme im Sinne von Artikel 2 Buchstabe a der Richtlinie 2013/40/EU des Europäischen Parlaments und des Rates <sup>(12)</sup> gegen Angriffe geschützt sind;
- c) dass eine unbefugte Weitergabe vertraulicher Informationen verhindert wird;
- d) dass die Sicherheit und Integrität der Informationen, die es im Rahmen der Verordnung (EU) 2017/2402 erhält, gewährleistet sind.

(2) Der Antrag enthält Belege dafür, dass der Antragsteller Vorkehrungen getroffen hat, um die in Absatz 1 genannten Risiken unverzüglich und zeitnah zu erkennen und zu handhaben.

(3) Im Hinblick auf Verstöße gegen die in den Absätzen 1 und 2 genannten physischen und elektronischen Sicherheitsmaßnahmen enthält der Antrag Belege dafür, dass der Antragsteller Vorkehrungen getroffen hat, um umgehend und zeitnah

- a) die ESMA über den Vorfall, der den Verstoß begründet, zu unterrichten;
- b) der ESMA einen Vorfallbericht zu übermitteln, der Art und Einzelheiten des Vorfalls, die zur Handhabung des Vorfalls getroffenen Maßnahmen und die zur Verhinderung ähnlicher Vorfälle unternommenen Vorstöße enthält;
- c) Nutzer, die vom Vorfall betroffen sind, über diesen zu unterrichten.

#### Artikel 23

### Verifizierungsverfahren

(1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält eine Beschreibung der Strategien und Verfahren, die der Antragsteller eingeführt hat, um

- a) die auf die Systeme des Antragstellers zugreifenden Nutzer zu authentifizieren;
- b) die Aufzeichnung der Informationen, die der Antragsteller gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 für die betreffende Verbiefung erhält, zu autorisieren und zu erlauben;
- c) den Artikeln 2 bis 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1229 zu genügen;
- d) Doppeleingaben zu überprüfen und kenntlich zu machen;
- e) anzugeben, welche Informationen er nicht erhalten hat, sofern diese Informationen gemäß Artikel 7 Absatz 1 der Verordnung (EU) 2017/2402 zur Verfügung gestellt werden müssen.

(2) Der Antrag enthält auch eine Dokumentation, in der mehrere detaillierte Testfallbeispiele, insbesondere auch mit Grafiken, dargestellt werden und die nachweist, dass der Antragsteller in der Lage ist, seine in Absatz 1 festgelegten Verpflichtungen zu erfüllen. Im Hinblick auf Absatz 1 Buchstabe c werden für jede der in Artikel 4 der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1229 aufgeführten Verifizierungen mehrere detaillierte Testfallbeispiele dargelegt.

#### Artikel 24

### Qualität der erstellten Informationen

Im Hinblick auf die vom Antragsteller gemäß der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1229 erstellten Informationen enthält ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister eine detaillierte Beschreibung der vom Antragsteller eingeführten Verfahren, mit denen sichergestellt werden soll, dass er die von den meldenden Einrichtungen erhaltenen Informationen korrekt zur Verfügung stellt, ohne selbst Fehler zu verursachen oder Informationen auszulassen.

<sup>(12)</sup> Richtlinie 2013/40/EU des Europäischen Parlaments und des Rates vom 12. August 2013 über Angriffe auf Informationssysteme und zur Ersetzung des Rahmenbeschlusses 2005/222/JI des Rates (ABl. L 218 vom 14.8.2013, S. 8).

*Artikel 25***Vertraulichkeit**

(1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält eine detaillierte Beschreibung der internen Strategien, Verfahren und Mechanismen, mit denen Folgendes verhindert wird:

- a) jede Verwendung der vom Antragsteller verwahrten Informationen für unrechtmäßige Zwecke;
- b) die Preisgabe vertraulicher Informationen;
- c) die kommerzielle Nutzung der vom Antragsteller verwahrten Informationen, wenn eine solche Nutzung verboten ist.

(2) Die in Absatz 1 genannte Beschreibung beinhaltet eine Beschreibung der internen Verfahren, nach denen Mitarbeiter die Erlaubnis erhalten, mit einem Passwort auf die Informationen zuzugreifen, wobei der Zweck, zu dem der Mitarbeiter auf die Informationen zugreift, der Umfang der eingesehenen Daten und alle etwaigen Beschränkungen für die Datennutzung anzugeben sind.

(3) Die Antragsteller unterrichten die ESMA über die Prozesse, mit denen jeder Mitarbeiter, der auf die vom Antragsteller verwahrten Informationen zugreift, der Zeitpunkt des Zugriffs, die Art der konsultierten Informationen und der Zweck des Informationszugriffs protokolliert werden.

*Artikel 26***Strategie für das Führen von Aufzeichnungen**

(1) Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält Folgendes:

- a) Informationen über die Systeme, Strategien und Verfahren für das Führen von Aufzeichnungen, die verwendet werden, um sicherzustellen, dass die von einer meldenden Einrichtung gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 über den Antragsteller verfügbar gemachten Informationen vom Antragsteller gemäß Artikel 80 Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 in der Anwendung des Artikels 10 Absatz 2 der Verordnung (EU) 2017/2402 aufgezeichnet und aufbewahrt werden;
- b) eine detaillierte Beschreibung der Systeme, Strategien und Verfahren für das Führen von Aufzeichnungen, die verwendet werden, um sicherzustellen, dass die von einer meldenden Einrichtung gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 über den Antragsteller verfügbar gemachten Informationen in angemessener Weise und gemäß den einschlägigen rechtlichen oder regulatorischen Anforderungen geändert werden;
- c) Informationen über den Empfang und die Verwaltung der von einer meldenden Einrichtung gemäß der Verordnung (EU) 2017/2402 über den Antragsteller verfügbar gemachten Informationen, einschließlich einer Beschreibung etwaiger Strategien und Verfahren, die der Antragsteller eingeführt hat, um Folgendes sicherzustellen:
  - i) die zeitnahe und korrekte Aufzeichnung der erhaltenen Informationen;
  - ii) die Aufzeichnung aller erhaltenen Informationen, die den Empfang, die Änderung oder die Beendigung einer Verbriefungstransaktion betreffen, in einem Meldeprotokoll;
  - iii) die Aufbewahrung der Daten sowohl online als auch offline;
  - iv) die angemessene Kopierung der Informationen für die Zwecke der Fortführung des Geschäftsbetriebs.

(2) Der Registrierungsantrag enthält auch die Strategien und Verfahren des Antragstellers, um die Verifizierungen, Validierungen und vom Antragsteller im Rahmen der Delegierten Verordnung (EU) 2020/1229 erstellten Informationen umgehend aufzuzeichnen und nach Beendigung der Verbriefung mindestens zehn Jahre lang aufzubewahren.

*Artikel 27***Zahlung von Gebühren**

Ein Antrag auf Registrierung als Verbriefungsregister enthält einen Beleg über die Zahlung der in Artikel 16 der Verordnung (EU) 2017/2402 genannten Gebühren für die Registrierung.

*Artikel 28***Überprüfung der Richtigkeit und Vollständigkeit des Antrags**

(1) Allen Informationen, die der ESMA im Laufe des Registrierungsverfahrens übermittelt werden, ist ein von einem Mitglied des Leitungsorgans des Antragstellers und einem Mitglied der Geschäftsleitung des Antragstellers unterzeichnetes Schreiben beizufügen, in dem bestätigt wird, dass die übermittelten Informationen nach ihrem Wissen zum Zeitpunkt der Antragstellung richtig und vollständig sind.

(2) Sofern verfügbar, werden diesen Informationen auch die einschlägigen Rechtsunterlagen des Unternehmens beigefügt, die die Richtigkeit der Daten bescheinigen.

*Artikel 29***Informationsanforderungen für ein registriertes Transaktionsregister, das Verbriefungs-Kerndienstleistungen erbringen will**

(1) Ein Antrag nach Artikel 10 Absatz 5 Buchstabe b der Verordnung (EU) 2017/2402 auf Ausweitung der Registrierung für die Zwecke von Artikel 7 der genannten Verordnung enthält die Informationen und Unterlagen, die nach den folgenden Bestimmungen der vorliegenden Verordnung vorgeschrieben sind:

- a) Artikel 2, außer Absatz 2 Buchstabe d;
- b) Artikel 3
- c) Artikel 5, außer Absatz 2 Buchstabe d;
- d) Artikel 6;
- e) Artikel 9;
- f) Artikel 10 Buchstabe b;
- g) Artikel 12;
- h) Artikel 13 Absatz 2;
- i) Artikel 14, 15 und 16;
- j) Artikel 17 Buchstabe b und Artikel 17 Buchstabe e;
- k) Artikel 18 bis 24;
- l) Artikel 25 Absatz 2;
- m) Artikel 26, 27 und 28.

(2) Informationen und Unterlagen, die aufgrund einer nicht in Absatz 1 genannten Bestimmung dieser Verordnung vorgeschrieben sind, werden in den Antrag nur insofern aufgenommen, als zwischen der betreffenden Information oder Unterlage zum Zeitpunkt der Antragstellung und zum Zeitpunkt der dieser Antragstellung vorausgehenden letzten Übermittlung an die ESMA nach Titel VI Kapitel 1 der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 oder Kapitel III der Verordnung (EU) 2015/2365, je nach Anwendbarkeit, ein inhaltlicher Unterschied besteht.

(3) Für die Zwecke dieses Artikels gelten die in Artikel 2 Absätze 3 und 4 und in den Artikeln 3 bis 28 enthaltenen Bezugnahmen auf einen Antrag auf Registrierung gleichzeitig als Bezugnahmen auf einen Antrag auf Ausweitung der Registrierung.

*Artikel 30***Inkrafttreten**

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

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

Brüssel, den 29. November 2019

*Für die Kommission*  
*Der Präsident*  
Jean-Claude JUNCKER

---



ISSN 1977-0642 (elektronische Ausgabe)  
ISSN 1725-2539 (Papierausgabe)



**Amt für Veröffentlichungen der Europäischen Union**  
2985 Luxemburg  
LUXEMBURG

**DE**