

REGOLAMENTO DI ESECUZIONE (UE) 2020/1227 DELLA COMMISSIONE**del 12 novembre 2019****che stabilisce norme tecniche di attuazione per quanto riguarda i moduli per fornire le informazioni conformemente ai requisiti di notifica STS****(Testo rilevante ai fini del SEE)**

LA COMMISSIONE EUROPEA,

visto il trattato sul funzionamento dell'Unione europea,

visto il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 12 dicembre 2017, che stabilisce un quadro generale per la cartolarizzazione, instaura un quadro specifico per cartolarizzazioni semplici, trasparenti e standardizzate e modifica le direttive 2009/65/CE, 2009/138/CE e 2011/61/UE e i regolamenti (CE) n. 1060/2009 e (UE) n. 648/2012 ⁽¹⁾, in particolare l'articolo 27, paragrafo 7,

considerando quanto segue:

- (1) Per facilitare notifiche efficaci e armonizzate è opportuno che le informazioni riguardanti le cartolarizzazioni che soddisfano i requisiti in materia di criteri semplici, trasparenti e standardizzati (STS) di cui agli articoli da 19 a 22 e agli articoli da 23 a 26 del regolamento (UE) 2017/2402 siano segnalate all'Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati (ESMA) in un formato coerente e in conformità a norme uniformi.
- (2) La comunicazione delle informazioni in un formato armonizzato consente la raccolta efficiente dei dati da parte dell'ESMA e facilita i controlli di coerenza e la valutazione della completezza da parte degli investitori e delle autorità competenti. Pertanto è opportuno specificare il formato di ciascuno dei campi da segnalare nella notifica STS e le informazioni da comunicare all'ESMA dovrebbero essere trasmesse per via elettronica.
- (3) Il presente regolamento è basato sul progetto di norme tecniche di attuazione presentato dall'ESMA alla Commissione a norma dell'articolo 15 del regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio ⁽²⁾.
- (4) L'ESMA ha condotto una consultazione pubblica aperta sul progetto di norme tecniche di attuazione sul quale è basato il presente regolamento, ha analizzato i potenziali costi e benefici collegati e ha chiesto il parere del gruppo delle parti interessate nel settore degli strumenti finanziari e dei mercati istituito dall'articolo 37 del regolamento (UE) n. 1095/2010,

HA ADOTTATO IL PRESENTE REGOLAMENTO:

*Articolo 1***Moduli per la notifica STS**

1. Le informazioni di cui all'articolo 1, paragrafo 1, lettera a), e all'articolo 1, paragrafo 2, lettera a), del regolamento delegato (UE) 2020/1226 della Commissione ⁽³⁾ sono fornite mediante il modulo di cui all'allegato I del presente regolamento.
2. Le informazioni di cui all'articolo 1, paragrafo 1, lettera b), e all'articolo 1, paragrafo 2, lettera b), del regolamento delegato (UE) 2020/1226 sono fornite mediante il modulo di cui all'allegato II del presente regolamento.

⁽¹⁾ GUL 347 del 28.12.2017, pag. 35.

⁽²⁾ Regolamento (UE) n. 1095/2010 del Parlamento europeo e del Consiglio, del 24 novembre 2010, che istituisce l'Autorità europea di vigilanza (Autorità europea degli strumenti finanziari e dei mercati), modifica la decisione n. 716/2009/CE e abroga la decisione 2009/77/CE della Commissione (GUL 331 del 15.12.2010, pag. 84).

⁽³⁾ Regolamento delegato (UE) 2020/1226 della Commissione, del 12 novembre 2019, che integra il regolamento (UE) 2017/2402 del Parlamento europeo e del Consiglio e che stabilisce norme tecniche di regolamentazione per specificare le informazioni da fornire conformemente ai requisiti di notifica STS (Cfr. pagina 285 della presente Gazzetta ufficiale).

3. Le informazioni di cui all'articolo 1, paragrafo 1, lettera c), e all'articolo 1, paragrafo 2, lettera c), del regolamento delegato (UE) 2020/1226 sono fornite mediante il modulo di cui all'allegato III del presente regolamento.
4. Se le informazioni da comunicare a norma del presente articolo non sono disponibili o non sono richieste in ragione dell'applicazione delle disposizioni transitorie di cui all'articolo 43 del regolamento (UE) 2017/2402, la notifica riporta la dizione «Non applicabile in ragione dell'applicazione delle disposizioni transitorie» nel campo o nei campi pertinenti degli allegati del presente regolamento.
5. Le informazioni di cui al presente articolo sono trasmesse in formato elettronico a lettura automatica.
6. Le «Informazioni supplementari» di cui all'articolo 2 del regolamento delegato (UE) 2020/1226 sono incluse nel campo «Casella da compilare» degli allegati da I a III del presente regolamento.

Articolo 2

Entrata in vigore

Il presente regolamento entra in vigore il ventesimo giorno successivo alla pubblicazione nella *Gazzetta ufficiale dell'Unione europea*.

Il presente regolamento è obbligatorio in tutti i suoi elementi e direttamente applicabile in ciascuno degli Stati membri.

Fatto a Bruxelles, il 12 novembre 2019

Per la Commissione
Il president
Jean Claude JUNCKER

ALLEGATO I

Formati dei campi da applicare nel modulo di notifica STS

| SIMBOLO | TIPO DI DATI | DEFINIZIONE |
|------------------|-------------------------------------|---|
| {ALPHANUM-n} | Fino a n caratteri alfanumerici | Campo di testo libero. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {COUNTRYCODE_2} | 2 caratteri alfanumerici | Codice del paese a 2 lettere secondo i codici paese alpha-2 di ISO 3166-1. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 caratteri alfanumerici | Codice della valuta a 3 lettere secondo i codici valuta di ISO 4217. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {DATEFORMAT} | Formato della data secondo ISO 8601 | Le date sono indicate con il formato seguente: AAAA-MM-GG |
| {Y/N} | 1 carattere alfanumerico | «vero»: Y «falso»: N |
| {ISIN} | 12 caratteri alfanumerici | Codice ISIN secondo ISO 6166 |
| {LEI} | 20 caratteri alfanumerici | Identificativo del soggetto giuridico secondo ISO 17442 |

Modulo di notifica STS per le cartolarizzazioni non ABCP

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSS0 | Primo referente | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS1 | Codice di identificazione dello strumento | | {ISIN} |
| STSS2 | LEI del cedente, del promotore o del prestatore originario | | {LEI} |
| STSS3 | Identificativo della notifica | | {ALPHANUM-100} |
| STSS4 | Identificativo unico | | {ALPHANUM-100} |
| STSS5 | Identificativo del prospetto | | {ALPHANUM-100} |
| STSS6 | Repertorio di dati sulle cartolarizzazioni | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS7 | Nome della cartolarizzazione | | {ALPHANUM-100} |
| STSS8 | Paese di stabilimento | | {COUNTRYCODE_2} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|---|----------------------|------------------------------------|
| STSS9 | Classificazione della cartolarizzazione | | {LIST} |
| STSS10 | Tipo di esposizioni sottostanti | | {LIST} |
| STSS11 | Data di emissione | | {DATEFORMAT} |
| STSS12 | Data di notifica | | {DATEFORMAT} |
| STSS13 | Terzo autorizzato | | {ALPHANUM-100} |
| STSS14 | Terzo autorizzato (nome e paese di stabilimento) | | {ALPHANUM-1000} {COUNTRYCODE_2} |
| STSS15 | Autorità competente che ha autorizzato il terzo | | {ALPHANUM-100} |
| STSS16 | Status STS | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS17 | Cedente (o prestatore originario) non ente creditizio UE | | {Y/N} |
| STSS18 | Conferma dei criteri di concessione dei crediti | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS19 | Dichiarazione che i criteri di concessione dei crediti sono soggetti a vigilanza | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS20 | Esposizioni sottostanti acquisite mediante vendita effettiva | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS21 | Nessuna disposizione rigida in tema di revocatoria | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS22 | Esenzione per le disposizioni in tema di revocatoria dei diritti fallimentari nazionali | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS23 | Trasferimento quando il venditore non è il prestatore originario | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS24 | Trasferimento mediante cessione perfezionato in un momento successivo | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS25 | Dichiarazioni e garanzie | | {ALPHANUM-10000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSS26 | Criteri per la gestione attiva del portafoglio | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS27 | Omogeneità delle attività | | {ALPHANUM} |
| STSS28 | Obblighi relativi alle esposizioni sottostanti/nessuna ricartolarizzazione | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS29 | Solidità dei parametri di sottoscrizione | | {ALPHANUM} |
| STSS30 | Esperienza del cedente/del prestatore | | {ALPHANUM} |
| STSS31 | Attività in stato di default | | {ALPHANUM} |
| STSS32 | Almeno un pagamento al momento del trasferimento | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS33 | Rimborso dei detentori/vendita delle attività | | {ALPHANUM} |
| STSS34 | Conformità all'obbligo di mantenimento del rischio | | {LIST} |
| STSS35 | Attenuazione del rischio di tasso di interesse (IR) e del rischio di cambio (FX) | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS36 | Derivati acquistati/venduti dalla SSPE | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS37 | Derivati che utilizzano regole comuni | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS38 | Pagamenti di interessi legati a un tasso di riferimento basati su tassi di interesse di uso generale | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS39 | Nessun blocco di contante in seguito ad avvio di azione esecutiva o a notifica di messa in mora | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS40 | Nessun quantitativo di contante è bloccato | | {ALPHANUM-1000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|---|----------------------|-------------------|
| STSS41 | Gli introiti in capitale sono trasferiti agli investitori | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS42 | Il rimborso non è invertito rispetto al rango | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS43 | Nessuna disposizione impone la liquidazione automatica delle esposizioni sottostanti al valore di mercato | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS44 | Cartolarizzazioni caratterizzate da una priorità di pagamento non sequenziale | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS45 | Cartolarizzazione rotativa con eventi determinanti il rimborso anticipato per la conclusione del periodo rotativo sulla base di eventi attivatori prestabiliti | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS46 | Deterioramento della qualità creditizia delle esposizioni sottostanti | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS47 | Evento di insolvenza riguardante il cedente o il gestore | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS48 | Calo del valore delle esposizioni sottostanti detenute dalla SSPE al di sotto di una data soglia | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS49 | Incapacità di creare in quantità sufficiente nuove esposizioni sottostanti che soddisfano la qualità creditizia prestabilita (evento attivatore della conclusione del periodo rotativo) | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS50 | Informazioni relative agli obblighi contrattuali del gestore, del fiduciario e dei prestatori di altri servizi accessori | | {ALPHANUM-1000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSS51 | Disposizioni sulla continuità del servizio del debito | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS52 | Disposizioni sulla continuità delle controparti dei derivati | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS53 | Disposizioni sulla continuità dei fornitori di liquidità e della banca del conto | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS54 | Esperienza richiesta al gestore e politiche e procedure e controlli adeguati di gestione del rischio messi in atto | | {ALPHANUM} |
| STSS55 | Definizioni chiare e coerenti (prestiti problematici) | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS56 | Priorità di pagamento ed eventi attivatori | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS57 | Pronta risoluzione dei contenziosi tra classi di investitori e responsabilità dei fiduciari | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS58 | Dati storici in termini di inadempienza e di perdite | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS59 | Campione delle esposizioni sottostanti sottoposto a verifiche esterne | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS60 | Disponibilità per i potenziali investitori di un modello di flusso di cassa delle passività | | {ALPHANUM-1000} |
| STSS61 | Performance ambientale/prestiti su immobili residenziali o prestiti per veicoli o leasing auto | | {ALPHANUM-10000} |
| STSS62 | Cedente e promotore responsabili dell'osservanza dell'articolo 7 del regolamento (UE) 2017/2402 | | {ALPHANUM-1000} |

ALLEGATO II

Formati dei campi da applicare nel modulo di notifica STS

| SIMBOLO | TIPO DI DATI | DEFINIZIONE |
|------------------|-------------------------------------|---|
| {ALPHANUM-n} | Fino a n caratteri alfanumerici | Campo di testo libero. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {COUNTRYCODE_2} | 2 caratteri alfanumerici | Codice del paese a 2 lettere secondo i codici paese alpha-2 di ISO 3166-1. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 caratteri alfanumerici | Codice della valuta a 3 lettere secondo i codici valuta di ISO 4217. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {DATEFORMAT} | Formato della data secondo ISO 8601 | Le date sono indicate con il formato seguente: AAAA-MM-GG |
| {Y/N} | 1 carattere alfanumerico | «vero»: Y «falso»: N |
| {ISIN} | 12 caratteri alfanumerici | Codice ISIN secondo ISO 6166 |
| {LEI} | 20 caratteri alfanumerici | Identificativo del soggetto giuridico secondo ISO 17442 |

Modulo di notifica STS per le cartolarizzazioni ABCP

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSAT0 | Primo referente | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT1 | Codice di identificazione dello strumento | | {ISIN} |
| STSAT2 | LEI del cedente, del promotore o del prestatore originario | | {LEI} |
| STSAT3 | Identificativo della notifica | | {ALPHANUM-100} |
| STSAT4 | Identificativo unico | | {ALPHANUM-100} |
| STSAT5 | Identificativo del prospetto | | {ALPHANUM-100} |
| STSAT6 | Repertorio di dati sulle cartolarizzazioni | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT7 | Nome della cartolarizzazione | | {ALPHANUM-100} |
| STSAT8 | Luogo di stabilimento | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT9 | Tipo di cartolarizzazione | | {LIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|---|----------------------|------------------------------------|
| STSAT10 | Tipo di esposizioni sottostanti | | {LIST} |
| STSAT11 | Data di emissione | | {DATEFORMAT} |
| STSAT12 | Data di notifica | | {DATEFORMAT} |
| STSAT13 | Terzo autorizzato | | {ALPHANUM-100} |
| STSAT14 | Terzo autorizzato (nome e paese di stabilimento) | | {ALPHANUM-1000} {COUNTRYCODE_2} |
| STSAT15 | Autorità competente che ha autorizzato il terzo | | {ALPHANUM-100} |
| STSAT16 | Status STS | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT17 | Cedente (o prestatore originario) non ente creditizio UE | | {Y/N} |
| STSAT18 | Conferma dei criteri di concessione dei crediti | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT19 | Dichiarazione che i criteri di concessione dei crediti sono soggetti a vigilanza | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT20 | Esposizioni sottostanti acquisite mediante vendita effettiva | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT21 | Nessuna disposizione rigida in tema di revocatoria | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT22 | Esenzione per le disposizioni in tema di revocatoria dei diritti fallimentari nazionali | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT23 | Trasferimento quando il venditore non è il prestatore originario | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT24 | Trasferimento mediante cessione perfezionato in un momento successivo | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT25 | Dichiarazioni e garanzie | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT26 | Criteri per la gestione attiva del portafoglio | | {ALPHANUM-10000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSAT27 | Nessuna ricartolarizzazione | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT28 | Esposizioni sottostanti trasferite senza esposizioni in stato di inadempienza | | {ALPHANUM} |
| STSAT29 | Almeno un pagamento al momento del trasferimento | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT30 | Rimborso dei detentori/vendita delle attività | | {ALPHANUM} |
| STSAT31 | Attenuazione del rischio di tasso di interesse (IR) e del rischio di cambio (FX) | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT32 | Derivati acquistati/venduti dalla SSPE | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT33 | Derivati nelle esposizioni sottostanti | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT34 | Derivati che utilizzano regole comuni | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT35 | Definizioni chiare e coerenti relative al trattamento dei prestiti problematici | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT36 | Priorità di pagamento ed eventi attivatori | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT37 | Dati storici in termini di inadempienza e di perdite | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT38 | Omogeneità delle attività | | {ALPHANUM} |
| STSAT39 | Obblighi relativi alle esposizioni sottostanti | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT40 | Obblighi relativi alle esposizioni sottostanti | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT41 | Pagamenti di interessi legati a un tasso di riferimento basati su tassi di interesse di uso generale | | {ALPHANUM-10000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|---|----------------------|-------------------|
| STSAT42 | Nessun blocco dei flussi di cassa in seguito ad avvio di azione esecutiva o a notifica di messa in mora | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAT43 | Nessun blocco di contante/avvio di azione esecutiva o notifica di messa in mora | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT44 | Gli introiti in capitale sono trasferiti agli investitori | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT45 | Nessuna disposizione impone la liquidazione automatica delle esposizioni sottostanti al valore di mercato | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT46 | Solidità dei parametri di sottoscrizione | | {ALPHANUM} |
| STSAT47 | Esperienza del venditore | | {ALPHANUM} |
| STSAT48 | Operazione ABCP rotativa/evento attivatore della qualità creditizia | | {ALPHANUM} |
| STSAT49 | Obblighi dei partecipanti alla cartolarizzazione | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT50 | Disposizioni sulla continuità del servizio del debito | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT51 | Disposizioni sulla continuità delle controparti dei derivati e della banca del conto | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAT52 | Solidità del promotore | | {ALPHANUM-1000} |

ALLEGATO III

Formati dei campi da applicare nel modulo di notifica STS

| SIMBOLO | TIPO DI DATI | DEFINIZIONE |
|------------------|-------------------------------------|---|
| {ALPHANUM-n} | Fino a n caratteri alfanumerici | Campo di testo libero. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {COUNTRYCODE_2} | 2 caratteri alfanumerici | Codice del paese a 2 lettere secondo i codici paese alpha-2 di ISO 3166-1. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {CURRENCYCODE_3} | 3 caratteri alfanumerici | Codice della valuta a 3 lettere secondo i codici valuta di ISO 4217. Da inserire in formato ASCII (no caratteri accentati). |
| {DATEFORMAT} | Formato della data secondo ISO 8601 | Le date sono indicate con il formato seguente: AAAA-MM-GG |
| {Y/N} | 1 carattere alfanumerico | «vero»: Y «falso»: N |
| {ISIN} | 12 caratteri alfanumerici | Codice ISIN secondo ISO 6166 |
| {LEI} | 20 caratteri alfanumerici | Identificativo del soggetto giuridico secondo ISO 17442 |

Modulo di notifica STS per i programmi ABCP

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSAP0 | Primo referente | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP1 | Codice identificativo dello strumento | | {ISIN} |
| STSAP2 | LEI del promotore | | {LEI} |
| STSAP3 | Identificativo della notifica | | {ALPHANUM-100} |
| STSAP4 | Identificativo unico | | {ALPHANUM-100} |
| STSAP5 | Identificativo del prospetto | | {ALPHANUM-100} |
| STSAP6 | Repertorio di dati sulle cartolarizzazioni | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP7 | Nome del programma ABCP | | {ALPHANUM-100} |
| STSAP8 | Paese di stabilimento | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP9 | Classificazione dello strumento | | {LIST} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|---|----------------------|------------------------------------|
| STSAP10 | Data di emissione | | {DATEFORMAT} |
| STSAP11 | Data di notifica | | {DATEFORMAT} |
| STSAP12 | Terzo autorizzato | | {ALPHANUM-100} |
| STSAP13 | Terzo autorizzato (nome e paese di stabilimento) | | {ALPHANUM-1000} {COUNTRYCODE_2} |
| STSAP14 | Autorità competente che ha autorizzato il terzo | | {ALPHANUM-100} |
| STSAP15 | Status STS | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP16 | Il promotore deve essere un ente creditizio soggetto a vigilanza | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP17 | Sostegno del promotore come fornitore di liquidità | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP18 | Dimostrazione all'autorità competente dell'ente creditizio | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP19 | Conformità agli obblighi di dovuta diligenza (due diligence) del promotore | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP20 | Conformità all'obbligo di mantenimento del rischio (livello dell'operazione/livello del programma) | | {LIST} |
| STSAP21 | Conformità all'articolo 7 del regolamento (UE) 2017/2402 a livello di programma ABCP | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP22 | Liquidità utilizzata laddove la linea di liquidità non è rinnovata | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAP23 | Conformità delle operazioni ABCP, nell'ambito di un programma ABCP, all'articolo 24, paragrafi da 1 a 8 e da 12 a 20 del regolamento (UE) 2017/2402 | | {ALPHANUM-1000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|---|----------------------|-------------------|
| STSAP24 | 5 % al massimo dell'importo aggregato delle esposizioni sottostanti temporaneamente non conforme | | {ALPHANUM} |
| STSAP25 | Durata residua media ponderata non superiore a due anni | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP26 | Programma ABCP interamente garantito (sostegno del promotore) | | {ALPHANUM-10000} |
| STSAP27 | Nessuna ricartolarizzazione e nessun supporto di credito determinante un secondo strato di segmentazione a livello di programma ABCP | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP28 | Nessuna opzione call | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP29 | Rischio di tasso di interesse e rischio di cambio a livello di programma ABCP adeguatamente attenuati e documentati | | {ALPHANUM} |
| STSAP30 | Requisiti per la documentazione riguardante il programma ABCP (responsabilità del fiduciario nei confronti degli investitori) | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP31 | Requisiti per la documentazione riguardante il programma ABCP (obblighi attribuiti per contratto al promotore) | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP32 | Requisiti per la documentazione riguardante il programma ABCP (procedure e responsabilità in caso di inadempienza del gestore) | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP33 | Requisiti per la documentazione riguardante il programma ABCP (disposizioni per la sostituzione delle controparti dei derivati e della banca del conto) | | {ALPHANUM-1000} |

| CODICE DEL CAMPO | NOME DEL CAMPO | CASELLA DA COMPILARE | FORMATO DEL CAMPO |
|------------------|--|----------------------|-------------------|
| STSAP34 | Requisiti per la documentazione riguardante il programma ABCP (procedure per assicurare la copertura della garanzia dell'impegno per l'apertura di credito) | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP35 | Requisiti per la documentazione riguardante il programma ABCP (linea di liquidità e titoli in scadenza da rimborsare quando il promotore non rinnova l'impegno per l'apertura di credito della linea di liquidità anteriormente alla scadenza) | | {ALPHANUM-1000} |
| STSAP36 | Esperienza del gestore | | {ALPHANUM} |