



## IS UW RAPPORTAGE AFGEWEZEN? DEZE FOUTEN MOET U VERMIJDEN

In juni 2021, meer dan drie jaar nadat de Europese Securitatie Verordening (EU 2017/2402) van kracht is geworden, wordt het laatste gat in het disclosure framework gedicht door middel van de officiële registratie van de eerste Securitisation Repository.

Sinds september 2020 is het gebruik van de nieuwe rapportagetemplates, die door de European Securities & Market Authority (ESMA) zijn ontwikkeld in een verplichte XML-indeling, voorgeschreven voor alle Europese securitisaties waarvan de effecten zijn uitgegeven na 1 januari 2019.

Rapporterende entiteiten zijn verplicht om regelmatig een volledig rapport -voor publieke niet-ABCP transacties- in te dienen, dat bestaat uit:

- een template voor de underlying exposures;
- een template voor een investor report;
- en een template voor significante gebeurtenissen/voorwetenschap.

In zijn rol als Securitisation Repository van het Eurosysteem heeft European DataWarehouse (EDW) complete rapporten ontvangen voor meer dan 240 securitisaties,. Hiermee anticipeert het op toestemming voor het EDW om in juni 2021 een door ESMA geregistreerde Securitisation Repository in werking te laten treden.

Om rapporterende entiteiten in Nederland en België voor te bereiden op de komende verandering in de disclosure requirements heeft EDW in nauwe samenwerking met Hypoport en dataprovider LBL gewerkt aan het in kaart brengen en verhelpen van mogelijke fouten in de bestandsstructuur en/of de inhoud van de nieuwe rapportagetemplates.

*» We werken als toonaangevende provider van diensten voor verplichte rapportage op de Nederlandse en Belgische markt, nauw samen met European DataWarehouse, alsook met uitgevende instellingen uit beide landen. Dit met als doel om de introductie van het sluitstuk van het disclosure regime soepel te laten verlopen.«*

### **Jacco Samuels**

Managing Director bij Hypoport en dataprovider LBL

Om te voorkomen dat emittenten problemen krijgen met afgewezen rapportages, hebben we alle ingediende templates geverifieerd aan de hand van de ruim 1000 validatieregels van ESMA.

Een rapportage wordt volledig afgewezen als het document niet de verplichte XML-bestandsindeling heeft, of als de securitisatie één van de validatieregels overtreedt. De afwijzingen worden wekelijks gerapporteerd aan ESMA. Bij de analyse van de ingediende rapportages van Nederlandse en Belgische emittenten heeft EDW vastgesteld dat de meest voorkomende problemen te maken hebben met de nieuwe identificaties die zijn toegevoegd aan de rapportagetemplates, zoals:

- de naam van de tegenpartij (SESP3) komt niet overeen met de naam die hoort bij de rechtspersoon-ID van de tegenpartij (SESP2), afkomstig uit de GLEIF-database;
- de naam van de ratingbron van de tegenpartij (SESP9) komt niet overeen met de naam die hoort bij de rechtspersoon-ID van de ratingbron (SESP8), afkomstig uit de GLEIF-database;

of met inconsistenties in de data, zoals:

- de huidige coupon (SEST13) is groter dan 100;
- de huidige rentemarge/-spread (SEST14) is groter dan 100.

Door deze veel voorkomende problemen te verhelpen, kunnen indieners de kans op afwijzing door de Securitisation Repository aanzienlijk verkleinen.

Behalve dat we emittenten ondersteunen bij het rechtzetten van dit soort fouten, stelt EDW ook een CSV/XML-converter beschikbaar om het risico van fouten in de bestandsstructuur en daarmee de kans op automatische afwijzing te verkleinen.

Voor meer informatie over onze CSV/XML-converter, of om te praten over uw aankomende rapportages, kunt u ons team bellen op nummer +49 (0)69 50986 9017 of een e-mail sturen naar [enquiries@eurodw.eu](mailto:enquiries@eurodw.eu)

*» In januari 2018 hebben we al aangekondigd dat we als eerste Europese Securitisation Repository onder ESMA geregistreerd wilden worden. We hebben er alle vertrouwen in dat we dankzij nauwe samenwerking met partners zoals Hypoport en dataprovider LBL, emittenten in Nederland en België kunnen helpen met het voldoen aan de disclosure requirements.«*

### **Christian Thun**

CEO, European DataWarehouse

#### **European DataWarehouse GmbH**

Walther-von-Cronberg-Platz 2  
60594 Frankfurt am Main

✉ [www.eurodw.eu](http://www.eurodw.eu)

🌐 [enquiries@eurodw.eu](mailto:enquiries@eurodw.eu)

☎ +49 (0) 69 50986 9017