

Dokument ten służy wyłącznie do celów dokumentacyjnych i instytucje nie ponoszą żadnej odpowiedzialności za jego zawartość

► **B**

**WYTYCZNE EUROPEJSKIEGO BANKU CENTRALNEGO**

**z dnia 20 lutego 2014 r.**

**w sprawie krajowych operacji zarządzania aktywami i pasywami przez krajowe banki centralne**

**(EBC/2014/9)**

**(2014/304/UE)**

**(Dz.U. L 159 z 28.5.2014, s. 56)**

zmienione przez:

Dziennik Urzędowy

		nr	strona	data
► <b><u>M1</u></b>	Wytyczne Europejskiego Banku Centralnego EBC/2014/22 z dnia 5 czerwca 2014 r.	L 168	118	7.6.2014
► <b><u>M2</u></b>	Wytyczne Europejskiego Banku Centralnego (UE) 2015/1575 z dnia 4 września 2015 r.	L 245	13	22.9.2015

**WYTYCZNE EUROPEJSKIEGO BANKU CENTRALNEGO****z dnia 20 lutego 2014 r.****w sprawie krajowych operacji zarządzania aktywami i pasywami  
przez krajowe banki centralne****(EBC/2014/9)**

(2014/304/UE)

RADA PREZESÓW EUROPEJSKIEGO BANKU CENTRALNEGO,

uwzględniając Traktat o funkcjonowaniu Unii Europejskiej, w szczególności art. 127 ust. 2 tiret pierwsze,

uwzględniając Statut Europejskiego Systemu Banków Centralnych i Europejskiego Banku Centralnego, w szczególności art. 12 ust. 1 i art. 14 ust. 3,

a także mając na uwadze, co następuje:

- (1) Osiągnięcie jednolitej polityki pieniężnej wymaga określenia przez Europejski Bank Centralny (EBC) ogólnych zasad, których przestrzegać powinny krajowe banki centralne państw członkowskich, których walutą jest euro (zwane dalej „KBC”) przy podejmowaniu krajowych operacji dotyczących aktywów i pasywów z własnej inicjatywy. Operacje takie nie powinny zakłócać jednolitej polityki pieniężnej.
- (2) Wykonanie umów z przyrzeczeniem odkupu zawieranych przez KBC z krajowymi bankami centralnymi spoza Eurosystemu może wywierać wpływ na płynność w strefie euro, a tym samym na jednolitą politykę pieniężną. Dlatego też, w celu zapewnienia lepszej ochrony spójności jednolitej polityki pieniężnej, Rada Prezesów podjęła w dniu 22 października 2009 r. decyzję, zgodnie z którą niektóre operacje dotyczące płynności zawierane przez KBC z bankami centralnymi spoza Eurosystemu będą wymagały jej uprzedniej zgody.
- (3) Należy wprowadzić ograniczenia oprocentowania depozytów sektora publicznego utrzymywanych w KBC jako agentach skarbowych na podstawie art. 21 ust. 2 Statutu Europejskiego Systemu Banków Centralnych i Europejskiego Banku Centralnego (zwanego dalej „Statutem ESBC”) w celu utrzymania spójności jednolitej polityki pieniężnej oraz wprowadzenia zachęt do utrzymywania depozytów sektora publicznego na rynku, tak aby wesprzeć zarządzanie płynnością Eurosystemu oraz realizację polityki pieniężnej. Dodatkowo wprowadzenie górnego limitu oprocentowania depozytów sektora publicznego w oparciu o stawki rynkowe sprzyja monitorowaniu stosowania się przez KBC do zakazu finansowania ze środków banku centralnego, które EBC prowadzi stosownie do art. 271 lit. d) Traktatu.

**▼B**

- (4) Mając na uwadze wyjątkowy i tymczasowy charakter depozytów sektora publicznego związanych z programem wsparcia finansowego Unii Europejskiej/Międzynarodowego Funduszu Walutowego oraz innymi porównywalnymi programami, stosowne procedury nie powinny ograniczać możliwości utrzymywania przez krajowe instytucje sektora publicznego depozytów w KBC, w szczególności że utrzymywanie takich depozytów może być jednym z warunków danego programu. Niewzglądanie takich depozytów w kwotach progowych nie zakłada jednolitej polityki pieniężnej w takim samym stopniu, jak utrzymywanie depozytów sektora publicznego w innych państwach członkowskich, których walutą jest euro,

PRZYJMUJE NINIEJSZE WYTYCZNE:

*Artykuł 1***Zakres zastosowania**

1. Niniejsze wytyczne mają zastosowanie do operacji KBC dotyczących kwot w euro, w tym operacji prowadzonych przez KBC jako zleceniodawcę we własnym imieniu lub jako agenta w imieniu podmiotu trzeciego, bądź jako zleceniodawcę i agenta w tym samym czasie. Niniejsze wytyczne nie mają zastosowania do następujących operacji:

- a) operacji kredytowo-depozytowych i operacji prowadzonych przez KBC z inicjatywy EBC, w szczególności operacji prowadzonych zgodnie z wytycznymi EBC/2011/14 <sup>(1)</sup>;
- b) transakcji na metalach szlachetnych oraz transakcji walutowych z użyciem euro, do których odnoszą się wytyczne EBC/2003/12 <sup>(2)</sup>;
- c) operacji KBC dotyczących awaryjnego wsparcia płynności.

2. Art. 7 i 8 nie mają zastosowania do operacji, których KBC dokonują:

- a) działając jako agenci skarbowi na podstawie art. 21 ust. 2 Statutu ESBC;
- b) na potrzeby swojej infrastruktury administracyjnej lub na rzecz swojego personelu na podstawie art. 24 Statutu ESBC;
- c) zarządzając funduszem emerytalnym na rzecz swojego personelu;
- d) prowadząc system depozytów na rzecz swojego personelu lub innych klientów;
- e) przekazując swój zysk sektorowi publicznemu.

<sup>(1)</sup> Wytyczne EBC/2011/14 z dnia 20 września 2011 r. w sprawie instrumentów i procedur polityki pieniężnej Eurosystemu (Dz.U. L 331 z 14.12.2011, s. 1).

<sup>(2)</sup> Wytyczne EBC/2003/12 z dnia 23 października 2003 r. dla transakcji uczestniczących państw członkowskich z udziałem walutowych kapitałów obrotowych na podstawie art. 31.3 Statutu Europejskiego Systemu Banków Centralnych i Europejskiego Banku Centralnego (Dz.U. L 283 z 31.10.2003, s. 81).

**▼B**

Art. 6 i 9 nie mają zastosowania do operacji prowadzonych przez fundusze emerytalne personelu KBC, które zarządzane są przez niezależne instytucje. Dodatkowo wymogi sprawozdawcze *ex post*, o których mowa w art. 6 i 9, nie znajdują zastosowania do operacji prowadzonych przez KBC na potrzeby swojej infrastruktury administracyjnej lub transakcji depozytowych dotyczących rachunków bieżących utrzymywanych w KBC przez ich personel lub innych klientów.

3. Z wyjątkiem wymogów sprawozdawczych *ex post*, o których mowa w art. 6 ust. 1, niniejsze wytyczne nie znajdują zastosowania do operacji prowadzonych w ramach usług w zakresie zarządzania rezerwami Eurosystemu.

4. Z zastrzeżeniem ust. 1, art. 5 i 11 stosuje się do depozytów sektora publicznego w euro lub w walucie obcej.

*Artykuł 2***Definicje**

Użyte w niniejszych wytycznych określenia oznaczają:

- a) „umowa z przyrzeczeniem odkupu” — umowę, na mocy której KBC lub krajowy bank centralny spoza strefy euro zobowiązuje się do zawarcia jednej lub większej ilości określonych transakcji odkupu. W transakcji z przyrzeczeniem odkupu jedna ze stron zobowiązuje się do nabycia od drugiej strony (lub dokonania sprzedaży drugiej stronie) papierów wartościowych denominowanych w euro w zamian za zapłatę ustalonej ceny wyrażonej w euro w dniu transakcji, z jednoczesnym zobowiązaniem do sprzedaży drugiej stronie (lub nabycia od drugiej strony) odpowiadających papierów wartościowych w zamian za zapłatę innej ustalonej ceny w euro w dacie wymagalności;
- b) „sektor publiczny” — instytucje publiczne państw członkowskich lub instytucje publiczne Unii, o których mowa w art. 123 Traktatu, rozumiane zgodnie z rozporządzeniem Rady (WE) nr 3603/93 <sup>(1)</sup>, z wyjątkiem publicznych instytucji kredytowych, które na potrzeby utrzymywania rezerw przez KBC traktowane są przez KBC i EBC w taki sam sposób, jak prywatne instytucje kredytowe;
- c) „depozyty sektora publicznego” — depozyty overnight oraz depozyty terminowe przyjmowane przez KBC od dowolnych jednostek sektora publicznego, w tym depozyty utrzymywane w walutach obcych;
- d) „rynkowa stopa overnight dla depozytów niezabezpieczonych” — a) w odniesieniu do depozytów overnight w walucie krajowej — referencyjną stopę międzybankowych operacji depozytowych typu overnight w euro (EONIA); b) w odniesieniu do depozytów overnight w walucie obcej — inną porównywalną stopę;

<sup>(1)</sup> Rozporządzenie Rady (WE) nr 3603/93 z dnia 13 grudnia 1993 r. określające definicje w celu zastosowania zakazów określonych w art. 104 i 104b ust. 1 Traktatu (Dz.U. L 332 z 31.12.1993, s. 1).

**▼ M2**

- e) „stopa rynkowa dla depozytów zabezpieczonych” — a) w odniesieniu do depozytów terminowych w walucie krajowej – wskaźnik STOXX EUR GC Pooling z porównywalnym terminem wymagalności; oraz b) w odniesieniu do depozytów terminowych w walucie obcej — inną porównywalną stopę;

**▼ B**

- f) „produkt krajowy brutto” — wartość wszystkich towarów i usług wytworzonych przez gospodarkę pomniejszoną o zużycie pośrednie oraz powiększoną o wartość netto podatków od produktów i importu w określonej jednostce czasu;
- g) „stopa depozytu w banku centralnym” — określoną z góry stopę procentową stosowaną wobec kontrahentów korzystających z depozytu w banku centralnym Eurosystemu w celu utrzymywania depozytów overnight w KBC.

*Artykuł 3***Kwestie organizacyjne**

1. KBC przyjmują a Zarząd monitoruje odpowiednie rozwiązania mające na celu umożliwienia kontrahentom rozróżnienia pomiędzy operacjami prowadzonymi przez KBC na podstawie niniejszych wytycznych a operacjami Europejskiego Systemu Banków Centralnych prowadzonymi zgodnie z instrumentami i procedurami określonymi w wytycznych EBC/2011/14.
2. KBC przyjmują odpowiednie rozwiązania mające na celu zapewnienie, aby poufne informacje dotyczące polityki pieniężnej nie były wykorzystywane przez KBC podczas prowadzenia operacji, do których zastosowanie mają niniejsze wytyczne.
3. KBC poinformują EBC o rozwiązaniach przyjętych zgodnie z ust. 1 i 2.

*Artykuł 4***Upřednia zgoda na zawarcie umów z przyrzeczeniem odkupu z krajowymi bankami centralnymi spoza Eurosystemu**

1. Przed zawarciem umowy z przyrzeczeniem odkupu z krajowym bankiem centralnym spoza Eurosystemu KBC przedstawiają taką umowę EBC celem wyrażenia upředniej zgody na jej zawarcie przez Radę Prezesów.
2. KBC występują do EBC z wnioskiem o wyrażenie upředniej zgody na zawarcie umowy z przyrzeczeniem odkupu z możliwie dużym wyprzedzeniem przed przewidywaną datą jej zawarcia. Wniosek powinien zawierać co najmniej:
  - a) oznaczenie stron umowy z przyrzeczeniem odkupu;
  - b) cel zawarcia umowy z przyrzeczeniem odkupu;
  - c) w zakresie, w jakim są one znane — wartość i daty poszczególnych transakcji odkupu; przewidywaną wartość całkowitą tych transakcji;

**▼ B**

- d) wymagalność umowy z przyrzeczeniem odkupu oraz, w zakresie, w jakim jest ona znana, wymagalność poszczególnych transakcji z przyrzeczeniem odkupu, które mają zostać zawarte;
- e) wszelkie dodatkowe informacje, które KBC występujący z wnioskiem uzna za istotne.
3. Rada Prezesów rozpatrzy wniosek tak szybko, jak to możliwe, lecz nie później niż w terminie 40 dni roboczych od otrzymania wniosku.
4. Rozpatrując wniosek o wyrażenie uprzedniej zgody na zawarcie transakcji, Rada Prezesów bierze pod uwagę:
- a) podstawowy cel zapewnienia spójności polityki pieniężnej;
- b) utrzymanie efektywności zarządzania przez Eurosystem płynnością w strefie euro;
- c) skoordynowane podejście Eurosystemu do prowadzenia transakcji z przyrzeczeniem odkupu z krajowymi bankami centralnymi spoza Eurosystemu;
- d) równe warunki konkurencji dla instytucji kredytowych z siedzibą w państwach członkowskich, których walutą jest euro.
5. W przypadku stwierdzenia przez Radę Prezesów, że umowa z przyrzeczeniem odkupu nie byłaby zgodna z celami określonymi w ust. 4, Rada Prezesów może zażądać, aby umowa z przyrzeczeniem odkupu przedstawiona do akceptacji:
- a) została zawarta w terminie późniejszym niż planowany; lub
- b) została zawarta przez KBC po wprowadzeniu określonych zmian i ponownym wystąpieniu z wnioskiem o wyrażenie zgody na jej zawarcie.
6. Rada Prezesów podejmuje starania w celu rozpatrzenia składanych przez KBC wniosków o wyrażenie uprzedniej zgody z uwzględnieniem zasad proporcjonalności i niedyskryminacji.

*Artykuł 5***Ograniczenie oprocentowania depozytów sektora publicznego**

1. Oprocentowanie depozytów sektora publicznego jest ograniczone następującymi limitami górnymi:
- a) w przypadku depozytów overnight — rynkową stopą overnight dla depozytów niezabezpieczonych;
- b) w przypadku depozytów terminowych — stopą rynkową dla depozytów zabezpieczonych albo, jeśli nie jest ona dostępna, rynkową stopą overnight dla depozytów niezabezpieczonych.

**▼ M1**

2. W dowolnym dniu kalendarzowym całkowita wartość depozytów overnight i depozytów terminowych wszystkich jednostek sektora publicznego w danym KBC, która przekracza wartość: a) 200 milionów euro; albo b) 0,04 % produktu krajowego brutto państwa członkowskiego siedziby KBC, podlega oprocentowaniu zgodnie ze stopą procentową wynoszącą zero procent. Jeżeli stopa depozytu w banku centralnym ma w tym dniu wartość ujemną, zastosowanie znajduje stopa procentowa nie wyższa niż stopa depozytu w banku centralnym. Niniejszy przepis stosuje się z zastrzeżeniem art. 11, który znajduje zastosowanie wyłącznie do salda oraz pozostałego okresu wymagalności depozytów terminowych utrzymywanych w KBC w dniu kalendarzowym poprzedzającym dzień, w którym Rada Prezesów zdecydowała o obniżeniu stopy depozytu w banku centralnym do poziomu poniżej zera procent. Ujemna stopa procentowa oznacza obowiązek dokonania przez deponenta zapłaty na rzecz właściwego KBC, włączając prawo tego KBC do dokonania stosownego obciążenia rachunku danego depozytu sektora publicznego.

3. Depozyty sektora publicznego dotyczące programu wsparcia finansowego Unii Europejskiej/Międzynarodowego Funduszu Walutowego oraz innych porównywalnych programów, które utrzymywane są na rachunkach prowadzonych przez KBC, podlegają oprocentowaniu według niższej z następujących wartości: jednej ze stóp procentowych, o których mowa w ust. 1, lub stopie wynoszącej zero procent, nie są jednak uwzględniane w kwotach progowych, o których mowa w ust. 2.

**▼ B***Artykuł 6***Sprawozdawczość**

1. KBC przekazują EBC *ex ante* informacje o całkowitym wpływie netto na płynność krajowych operacji zarządzania ich aktywami i pasywami, mając na uwadze ramy ogólne Eurosystemu dotyczące zarządzania płynnością. KBC powinny uwzględniać przekazanie swoich zysków sektorowi publicznemu w prognozach niezależnych czynników wpływających na płynność co najmniej na tydzień przed dokonaniem przekazania. Dodatkowo, KBC powinny zapewnić za pomocą odpowiednich środków, aby operacje inwestycyjne i systemy depozytów nie miały niedającego się w odpowiedni sposób przewidzieć wpływu na płynność.

2. Wykorzystując zawarty w załączniku II do niniejszych wytycznych formularz sprawozdawczy *ex post*, raz w miesiącu KBC przekazują EBC *ex post* informacje o operacjach przeprowadzonych w poprzednim miesiącu. W odniesieniu do comiesięcznej sprawozdawczości *ex post* do miesięcznego obrotu w każdej z kategorii wymienionych w załączniku II stosuje się ogólny próg w wysokości 500 milionów euro, przy czym w progu tym transakcje uwzględnia się w następujący sposób:

a) kwotę brutto zakupów, sprzedaży oraz umorzeń każdej z poniższych kategorii:

(i) operacje inwestycyjne;

(ii) zarządzanie funduszami emerytalnymi;

(iii) działalność agentów;

**▼B**

- b) kwotę brutto z tytułu udzielania i zaciągania pożyczek papierów wartościowych w każdej z poniższych kategorii:
- (i) pożyczki papierów wartościowych; oraz
  - (ii) transakcje z przyrzeczeniem odkupu;
- c) kwotę brutto udzielonych kredytów i przyjętych depozytów dla kategorii systemów kredytowych i depozytowych;
- d) kwotę dla każdej z poniższych kategorii:
- (i) zobowiązania wobec podmiotów trzecich; oraz
  - (ii) przekazania i dotacje.

Jeżeli kwota brutto transakcji w danej kategorii jest niższa od odpowiedniej kwoty progowej, KBC wpisuje zero w formularzu sprawozdawczym, tak jak w przypadku, gdy nie dokonano żadnych transakcji. KBC mogą zdecydować o przekazywaniu EBC informacji o wszystkich dokonanych przez nie transakcjach nawet jeżeli kwoty progowe dla jednej lub kilku kategorii nie zostały osiągnięte (pełna sprawozdawczość).

W odniesieniu do transakcji w euro zawieranych w ramach usług Eurosystemu w zakresie zarządzania rezerwami KBC przestrzegają również innych mających zastosowanie wymogów sprawozdawczych.

3. W zakresie, w jakim w wymogi sprawozdawcze ujawnia, że operacje zarządzania aktywami lub pasywami danego KBC stoją w sprzeczności z wymogami jednolitej polityki pieniężnej, EBC może wydać szczegółowe instrukcje w odniesieniu do czynności zarządzania aktywami i pasywami dokonywanych przez dany KBC.

*Artykuł 7***Kwoty progowe**

1. Dokonywanie transakcji przekraczających wartość progową określoną w załączniku I wymaga uprzedniej zgody EBC. Wartość ta ma również zastosowanie do transakcji z przyrzeczeniem odkupu, z zastrzeżeniem procedury uprzedniej zgody na zawarcie umowy odkupu, o której mowa w art. 4.

2. Oprócz kwot progowych dotyczących operacji zagregowanych dla jednego dnia, o których mowa w załączniku I do niniejszych wytycznych, EBC może określić i wdrożyć dodatkowe kwoty progowe dla skumulowanych zakupów i sprzedaży aktywów i pasywów przez KBC w danym okresie.

3. Rada Prezesów może w dowolnym czasie zmienić kwoty progowe, o których mowa w załączniku I.





### *Artykuł 8*

#### **Procedura występowania z wnioskiem o uprzednią zgodę i udzielania uprzedniej zgody**

1. KBC występują z wnioskami o uprzednią zgodę z możliwie dużym wyprzedzeniem. W przypadku operacji, które mają zostać zawarte w tym samym dniu lub następnego dnia roboczego, EBC powinien otrzymać wniosek nie później niż o godz. 9.00 <sup>(1)</sup> w dniu przewidywanego zawarcia transakcji. W odniesieniu do pozostałych operacji EBC powinien otrzymać odpowiedni wniosek nie później niż o godz. 11.00 w dniu przewidywanego zawarcia transakcji.

2. KBC występują z wnioskami zgodnie z załącznikiem III do niniejszych wytycznych. Jeżeli transakcja, w odniesieniu do której wnioskowano o wyrażenie uprzedniej zgody i zgoda taka została udzielona, nie dochodzi do skutku na warunkach, na jakich udzielono zgody, KBC informują niezwłocznie EBC o tym fakcie.

3. W wyjątkowych sytuacjach KBC prowadzące zabezpieczone operacje pożyczki papierów wartościowych mogą, w przypadku gdy uczestnicy rynku nie są w stanie zapewnić określonych papierów wartościowych, wystąpić z wnioskiem o udzielenie uprzedniej zgody tego samego dnia późnym popołudniem.

4. EBC rozpatruje wnioski KBC o udzielenie uprzedniej zgody tak szybko jak to możliwe, a wnioski o udzielenie uprzedniej zgody tego samego dnia — w trybie natychmiastowym. W przypadku operacji, które mają być przeprowadzone w tym samym dniu lub następnego dnia roboczego, EBC rozpatruje wniosek do godz. 10.15 w dniu przewidywanego zawarcia transakcji. W przypadku innych operacji EBC rozpatruje wniosek do godz. 13.00 w dniu przewidywanego zawarcia transakcji. W przypadku gdy KBC nie otrzyma odpowiedzi w powyższym terminie, po upewnieniu się, że EBC otrzymał wniosek KBC i nie wysłał odpowiedzi, od godz. 13.15 należy przyjąć, że zgoda została udzielona.

5. Rozpatrując wnioski, EBC bierze pod uwagę zapewnienie spójności z jednolitą polityką pieniężną Eurosystemu, uwzględniając zarówno skutki poszczególnych operacji KBC, jak i zagregowane skutki takich operacji w państwach członkowskich, których walutą jest euro. Z zastrzeżeniem powyższego EBC poczyni starania, by uwzględniać wnioski KBC.

### *Artykuł 9*

#### **Monitorowanie**

1. Raz w roku Zarząd przedstawia Radzie Prezesów sprawozdanie z wdrożenia i stosowania niniejszych wytycznych. Sprawozdanie to powinno zawierać informacje o:

- a) stosowaniu procedury uprzedniej zgody;
- b) krajowych praktykach zarządzania aktywami i pasywami przez KBC;
- c) przestrzeganiu niniejszych wytycznych.

<sup>(1)</sup> Ilekroć w niniejszych wytycznych określa się dokładny czas, należy przez to rozumieć czas środkowoeuropejski przy uwzględnieniu zmian związanych z czasem środkowoeuropejskim letnim.

**▼B**

2. W razie wątpliwości dotyczących przestrzegania art. 5 ust. 1–3 EBC może zwracać się do KBC o udzielenie stosownych informacji.

*Artykuł 10***Poufność**

Informacje oraz wymianę danych dotyczących powyższych procedur, w tym sprawozdanie z monitorowania, o którym mowa w art. 9, traktuje się jako poufne.

*Artykuł 11***Przepisy przejściowe**

Do depozytów terminowych sektora publicznego utrzymywanych w KBC zastosowanie ma art. 5 ust. 1, przy czym depozyty te uwzględnia się w kwotach progowych, o których mowa w art. 5 ust. 2, od dnia 1 grudnia 2015 r.

*Artykuł 12***Skuteczność i implementacja**

1. Niniejsze wytyczne stają się skuteczne dwa dni po ich przyjęciu.
2. KBC podejmują środki konieczne do zapewnienia zgodności z postanowieniami niniejszych wytycznych do dnia 1 grudnia 2014 r. Najpóźniej do dnia 31 października 2014 r. KBC powiadamiają EBC o treści aktów prawnych i innych czynnościach związanych z tymi środkami.

*Artykuł 13***Adresaci**

Niniejsze wytyczna adresowane są do KBC.

**▼B***ZALĄCZNIK I***KWOTY PROGOWE DOTYCZĄCE KRAJOWYCH OPERACJI KBC  
Z WYKORZYSTANIEM AKTYWÓW I PASYWÓW  
PRZEPROWADZANYCH JEDNEGO DNIA**

---

**Stosowana kwota progowa**

---

**Efekt daty rozrachunku  
(zagregowane operacje netto) <sup>(1)</sup>**

---

200 milionów euro

---

<sup>(1)</sup> Wpływ na płynność netto planowanych operacji dla danego dnia, których rozrachunek ma nastąpić w ciągu jednego dnia, w dacie transakcji lub po tej dacie.

---

## ZAŁĄCZNIK II

## MIESIĘCZNE SPRAWOZDANIE EX POST O KRAJOWYCH OPERACJACH ZARZĄDZANIA AKTYWAMI I PASYWAMI

	Kategoria operacji										
	Operacje inwestycyjne	Zarządzanie funduszami emerytalnymi	Operacje agenta		Pożyczki papierów wartościowych	Transakcje z przyrzeczeniem odkupu		Systemy kredytowe i depozytowe		Zobowiązania wobec podmiotów trzecich	Przekazania i dotacje
Sposób prowadzenia operacji	1. Pozycja bilansowa 2. Pozycja pozabilansowa	1. Pozycja bilansowa 2. Pozycja pozabilansowa	1. Pozycja bilansowa 2. Pozycja pozabilansowa	Liczba transakcji	nnnnnn	nnnnnn	Liczba transakcji	nnnnnn	Rodzaj operacji	xxxxx	xxxxx
Liczba transakcji	nnnnnn	nnnnnn	nnnnnn	Udzielanie pożyczek papierów wartościowych	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro	Udzielanie kredytów	(XX) milionów euro	Sposób prowadzenia operacji	1. Pozycja bilansowa 2. Pozycja pozabilansowa	1. Pozycja bilansowa 2. Pozycja pozabilansowa
Zakup	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro	Zaciąganie pożyczek papierów wartościowych	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro	Przyjmowanie depozytów	(XX) milionów euro	Liczba transakcji	nnnnnn	nnnnnn
Sprzedaż	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro						Kwota	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro
Umorzenie	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro	(XX) milionów euro								



## ZAŁĄCZNIK III

## WZÓR WNIOSKU O UDZIELENIE UPRZEDNIEJ ZGODY NA ZAWARCIE ZNACZĄCEJ TRANSAKCJI

Nazwa zmiennej	Opis zmiennej	Kod	Pole obowiązkowe
Kod ID	Niepowtarzalny identyfikator grupy operacji (dotyczących papierów wartościowych lub innych) posiadający taką samą datę zawarcia transakcji i jej rozrachunku, składający się z kolejno po sobie następujących cyfr poprzedzonych dwuliterowym kodem kraju ISO.	ISnn	Wygenerowany automatycznie przez aplikację.
Data zawarcia transakcji	Data zawarcia transakcji dla planowanej grupy operacji	rrrr/mm/dd	Tak
Data rozrachunku	Data rozrachunku (lub data początkowa w przypadku transakcji forward) dla planowanej grupy operacji	rrrr/mm/dd	Tak
Zakupy i pożyczki	W przypadku zakupu papierów wartościowych lub innych instrumentów lub udzielenia kredytu lub pożyczki papierów wartościowych, należy podać całkowitą wartość transakcji	[YY] milionów euro	Nie (Należy pozostawić puste, jeżeli planowane są wyłącznie transakcje sprzedaży)
Sprzedaż i przyjmowanie depozytów	W przypadku sprzedaży papierów lub innych instrumentów wartościowych lub przyjęcia depozytu, należy podać całkowitą wartość transakcji	[XX] milionów euro	Nie (Należy pozostawić puste, jeżeli planowane są wyłącznie transakcje zakupu)
Wpływ na prognozy płynności	Wskazanie wpływu na prognozy płynności dla daty rozrachunku w przypadku wyrażenia zgody na zawarcie transakcji, w odniesieniu do ostatniej dziennej prognozy płynności przekazanej EBC o 8.00. W przypadku odmowy informacja ta ułatwi EBC identyfikację odwrotnego wpływu na prognozy płynności	[ZZ] milionów euro	Tak (W przypadku przekazania już EBC informacji o całkowitej prognozie płynności, w tym polu należy wpisać zero)
Rodzaj transakcji	Wskazanie rodzaju transakcji 1. Transakcje z wykorzystaniem papierów wartościowych 2. Inne transakcje	Rodzaj transakcji wybierany jest z listy dostarczonej przez system	Tak (Użytkownik musi wskazać rodzaj transakcji)
Zamierzony sposób przeprowadzenia operacji	Opis zamierzonego sposobu przeprowadzenia operacji przez odniesienie do jednego z poniższych określeń: 1. Operacja bilansowa 2. Operacja pozabilansowa	Zamierzony sposób przeprowadzenia operacji wybierany jest z listy dostarczonej przez system	Nie (Użytkownik może wskazać zamierzony sposób przeprowadzenia operacji)

**▼ B**

Nazwa zmiennej	Opis zmiennej	Kod	Pole obowiązkowe
Uwagi dodatkowe	Wszelkie informacje, które mogą ułatwić funkcji zarządzania płynnością w EBC ocenę wpływu na płynność netto w odniesieniu do właściwego okresu analiz płynności i najnowszej prognozy płynności. Przykładowo, jeżeli wpływ na prognozy płynności nie jest stały, ale ulegnie odwróceniu w dającej się przewidzieć przyszłości, użytkownik powinien w uwagach dodatkowych umieścić informację o wpływie na płynność po dacie rozrachunku. Użytkownik powinien również podać więcej danych o każdej operacji, takich jak rodzaj, wielkość oraz cel jej przeprowadzenia	Każda kombinacja cyfr i liter w zdefiniowanym uprzednio układzie znaków H1&H2 <sup>(1)</sup>	Nie

<sup>(1)</sup> Symbole, których użycie jest dozwolone w uwagach ogólnych zawarte są w rozdziale 1.1.4.7 załącznika nr 4 dokumentu „H1&H2 System Design” z 22 sierpnia 1997 r.