

DEN EUROPÆISKE CENTRALBANKS FORORDNING (EU) 2015/1599
af 10. september 2015
om ændring af forordning (EU) nr. 1333/2014 om pengemarkedsstatistik (ECB/2015/30)

STYRELSESRÅDET FOR DEN EUROPÆISKE CENTRALBANK HAR —

under henvisning til statuten for Det Europæiske System af Centralbanker og Den Europæiske Centralbank, særlig artikel 5,

under henvisning til Rådets forordning (EF) nr. 2533/98 af 23. november 1998 om Den Europæiske Centralbanks indsamling af statistisk information ⁽¹⁾, særlig artikel 5, stk. 1, og artikel 6, stk. 4, og

ud fra følgende betragtninger:

- (1) I henhold til Den Europæiske Centralbanks forordning (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) ⁽²⁾ skal rapporteringsenhederne rapportere statistiske data, således at Det Europæiske System af Centralbanker kan udarbejde statistik over pengemarkedstransaktioner for at kunne varetage sine opgaver.
- (2) Der vil blive udstedt rapporteringsinstrukser til de nationale centralbanker, som fastsætter detaljerede parametre for rapporteringen af statistisk information i henhold til forordning (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48). Da rapporteringsinstrukserne præciserer en række væsentlige begreber, som fremgår af forordningen, bør denne af hensyn til konsistens også afspejle disse ændringer.
- (3) Forordning (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) bør derfor ændres i overensstemmelse hermed —

VEDTAGET DENNE FORORDNING:

Artikel 1

Ændringer

1. Bilag I til forordning (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) erstattes af bilag I til denne forordning.
2. Bilag II og III til forordning (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) ændres i overensstemmelse med bilag II til denne forordning.

Artikel 2

Endelige bestemmelser

Denne forordning træder i kraft på tyvendedagen efter dens offentliggørelse i *Den Europæiske Unions Tidende*.

Denne forordning er bindende i alle enkeltheder og gælder umiddelbart i medlemsstaterne i henhold til traktaterne.

Udfærdiget i Frankfurt am Main, den 10. september 2015.

For ECB's Styrelsesråd

Mario DRAGHI

Formand for ECB

⁽¹⁾ EFT L 318 af 27.11.1998, s. 8.

⁽²⁾ Den Europæiske Centralbanks forordning (EU) nr. 1333/2014 af 26. november 2014 om pengemarkedsstatistik (ECB/2014/48) (EUT L 359 af 16.12.2014, s. 97).

BILAG I

»BILAG I

Rapporteringsordning for pengemarkedsstatistikker vedrørende sikrede transaktioner

DEL 1

INSTRUMENTTYPE

Rapporteringsenhederne rapporterer til Den Europæiske Centralbank (ECB) eller den relevante nationale centralbank, alle indgåede genkøbsforretninger og -transaktioner, herunder triparty-genkøbstransaktioner, som er denominerede i euro med en løbetid på til og med et år (defineret som transaktioner med en løbetid på maksimalt 397 dage efter afviklingsdagen) mellem rapporteringsenheden og andre monetære finansielle institutioner (MFI'er), andre finansielle formidlere (OFI'er), forsikringselskaber, pensionskasser, offentlig forvaltning og service eller centralbanker i investeringsøjemed samt med ikke-finansielle selskaber, der klassificeres som »engros« i henhold til Basel III LCR-regelsættet.

DEL 2

DATATYPE

1. Typen af transaktionsbaserede data ⁽¹⁾, der skal rapporteres for hver transaktion

Felt	Beskrivelse af data	Alternativ rapporteringsmulighed (hvis en sådan findes) og andre kvalifikationer
Transaktionsidentifikator	Den interne entydige transaktionsidentifikator, som rapporteringsenheden anvender for hver transaktion.	Transaktionsidentifikatoren er entydig for alle rapporterede transaktioner på en given rapporteringsdato for et givent pengemarkedssegment.
Rapporteringsdatoen	Datoen, hvor dataene indberettes til ECB eller den nationale centralbank.	
Elektronisk tidsstempel	Tidspunktet, på hvilket en transaktion er indgået eller bogført.	
Modpartskode	En identifikationskode, der anvendes til at genkende rapporteringsenhedens modpart til den rapporterede transaktion.	Hvis transaktioner udføres gennem en central clearingmodpart (CCP), skal CCPens legal entity identifier (LEI) angives. Hvis transaktioner indgås med ikke-finansielle selskaber, OFI'er, forsikringselskaber, pensionskasser, offentlig forvaltning og service og centralbanker og for alle andre rapporterede transaktioner, for hvilke modpartens LEI ikke angives, skal modpartens klasse angives.
Modpartens ID-kode	En attribut, der specificerer den individuelle modpartskodetype, der overføres.	Anvendes i alle tilfælde. En individuel modpartskode angives.

⁽¹⁾ De elektroniske rapporteringsstandarder og tekniske specifikationer for dataene fastlægges særskilt. Disse findes på ECB's websted www.ecb.europa.eu.

Felt	Beskrivelse af data	Alternativ rapporteringsmulighed (hvis en sådan findes) og andre kvalifikationer
Modpartens beliggenhed	ISO (International Organisation for Standardisering)-landekode for det land, i hvilket modparten er registreret.	Obligatorisk hvis den individuelle modpartskode ikke angives. Ellers valgfri.
Transaktionens nominelle beløb	Det beløb, der oprindeligt blev lånt eller udlånt.	
Sikkerhedsstillelsens nominelle beløb	Det nominelle beløb for det værdipapir, der pantsættes som sikkerhedsstillelse.	Undtagen for triparty-genkøbsforretninger eller andre transaktioner, for hvilke det pantsatte værdipapir ikke er identificeret ved et ISIN (International Securities Identification Number)-nummer.
Handelsdag	Datoen, på hvilken parterne indgår den finansielle transaktion.	
Afviklingsdag	Købsdatoen, dvs. datoen, på hvilken långiver skal betale kontantbeløbet til låntager, og låntager skal overføre værdipapiret til långiver.	For så vidt angår open basis-genkøbstransaktioner, er det datoen, på hvilken forlængelsen afvikles (selvom der ikke sker en udveksling af kontanter).
Indfrielsesdato	Genkøbsdatoen, dvs. datoen på hvilken låntager skal tilbagebetale kontantbeløbet til långiver.	For så vidt angår open basis-genkøbstransaktioner, er det datoen på hvilken skyldig hovedstol og renter skal betales tilbage, hvis transaktionen ikke er blevet forlænget yderligere.
Transaktionstegn	Kontantlån for så vidt angår genkøbsforretninger eller kontantudlån for så vidt angår omvendte genkøbsforretninger.	
Sikkerhedsstillelsens ISIN	Det ISIN-nummer, som er blevet tildelt værdipapirer, der udstedes på de finansielle markeder, og som består af 12 alfa-numeriske tegn, der entydigt identificerer et værdipapir (som defineret af ISO 6166).	Rapporteres, undtagen for visse typer af sikkerhedsstillelse.
Type af sikkerhedsstillelse	Identificerer den aktivklasse, der er pantsat som sikkerhedsstillelse, hvis et individuelt ISIN-nummer ikke er angivet.	Angives i alle tilfælde, hvor et individuelt ISIN-nummer ikke er angivet.
Sektor som udsteder af sikkerhedsstillelsen tilhører	Identificerer den sektor, som udstederen af sikkerhedsstillelsen tilhører, hvis et individuelt ISIN-nummer ikke er angivet.	Angives, hvor et individuelt ISIN-nummer ikke er angivet.
Særlig identifikator for sikkerhedsstillelsen	Identificerer alle genkøbstransaktioner, der gennemføres mod generel sikkerhedsstillelse, og de genkøbstransaktioner, der gennemføres mod særlig sikkerhedsstillelse. Valgfrit felt, der kun angives, hvis det er muligt for rapporteringsenheden.	Rapportering af dette felt er valgfrit.

Felt	Beskrivelse af data	Alternativ rapporteringsmulighed (hvis en sådan findes) og andre kvalifikationer
Handelsrenten	Den rente udtrykt i overensstemmelse med ACT/360-pengemarkedskonventionen, til hvilken genkøbsforretningen blev indgået, og til hvilken det udlånte kontantbeløb er blevet betalt tilbage.	
Sikkerhedsstillelsens haircut	En foranstaltning til risikokontrol, der anvendes på den underliggende sikkerhedsstillelse, hvorved værdien af den underliggende sikkerhedsstillelse beregnes som aktiverens markedsværdi fratrukket en vis procentdel (haircut). I rapporteringsøjemed beregnes sikkerhedsstillelsens haircut som 100 minus forholdet mellem det udlånte/lånte kontantbeløb og markedsværdien, herunder påløbne renter for den pantsatte sikkerhedsstillelse.	Rapportering af dette felt kræves kun for enkeltvise sikkerhedsstillelsestransaktioner.
Triparty-enhedens modpartskode	Triparty-enhedens modpartskodeidentifikator.	Rapporteres for triparty-genkøbsforretninger.
Triparty-enhedens ID-kode	En attribut, der specificerer den individuelle triparty-enheds kodetype, der overføres.	Anvendes i alle tilfælde, hvor en kode for en individuel triparty-enhed angives.

2. Væsentlighedstærskel

Transaktioner, der indgås med ikke-finansielle selskaber bør kun rapporteres, hvis de indgås med ikke-finansielle selskaber, der klassificeres som engros på grundlag af Basell III LCR-regelsættet ⁽¹⁾.

3. Undtagelser

Koncerninterne transaktioner rapporteres ikke.»

⁽¹⁾ Jf. Basel III: »The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools«, Baselkomiteen for Banktilsyn, januar 2013, s. 23-27, findes på Den Internationale Betalingsbanks websted: www.bis.org.

BILAG II

Bilag II og III til forordning (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) ændres som følger:

1. I bilag II, erstattes Del 1 af følgende:

»DEL 1

INSTRUMENTTYPE

1. Rapporteringsenheder rapporterer til Den Europæiske Centralbank (ECB) eller den relevante nationale centralbank:

- a) rapporteringsenhedens låntagning ved brug af de instrumenter, der fremgår af tabellen nedenfor, som er denominerede i euro med en løbetid på til og med et år (defineret som transaktioner med en løbetid på maksimalt 397 dage efter afviklingsdagen) fra andre monetære finansielle institutioner (MFI'er), andre finansielle formidlere (OFI'er), forsikringselskaber, pensionskasser, offentlig forvaltning og service eller centralbanker i investeringsøjemed samt med ikke-finansielle selskaber, der klassificeres som »engros« i henhold til Basel III LCR-regelsættet.
- b) rapporteringsenhedens långivning til andre kreditinstitutter med en løbetid på til og med et år (defineret som transaktioner med en løbetid på maksimalt 397 dage efter afviklingsdagen) gennem usikrede indskud eller anfordringskonti, eller ved køb af commercial papers, indskudsbeviser, gældsbeviser med variabel rente og andre gældsværdipapirer med en løbetid på op til et år fra de udstedende kreditinstitutter.

2. Tabellen nedenfor angiver en detaljeret standardbeskrivelse af de instrumentkategorier for transaktioner, som rapporteringsenhederne skal rapportere til ECB. Hvis rapporteringsenhederne skal rapportere transaktionerne til deres nationale centralbank, skal den relevante nationale centralbank gennemføre disse beskrivelser af instrumentkategorier på nationalt plan i overensstemmelse med denne forordning.

Instrumenttype	Beskrivelse
Indlån	Usikrede rentebærende indlån (herunder anfordringskonti men undtagen løbende konti), enten med opsigelsesvarsel eller som har en løbetid på maksimalt et år, og som rapporteringsenheden enten optager (låner) eller placerer.
Anfordringskonti	Kontantkonti med daglige ændringer i den gældende rente, der giver ret til regelmæssige rentebetalinger eller -beregninger og med en frist for udbetaling.
Indskudsbevis	Et tidsindskudt gældsinstrument, der er udstedt af en MFI, og som berettiger indehaveren til en specifik fast rente over en defineret fast periode på op til et år.
Commercial paper	Et gældsinstrument, som enten er usikret eller med sikkerhedsstillelse fra udstederen, som har en løbetid på maksimalt et år, og som enten er rentebærende eller diskonteret.
Gældsbevis med variabel rente	Et gældsinstrument, hvor de løbende rentebetalinger beregnes på grundlag af værdien, dvs. ved at fastsætte en underliggende referencerente, som f.eks. Euribor, på forud definerede datoer, benævnt »fixing dates«, og hvor gældsinstrumentet har en maksimal løbetid på et år.

Instrumenttype	Beskrivelse
Andre kortfristede gældsværdipapirer	Ikke-efterstillede værdipapirer undtagen aktier med en løbetid på op til et år udstedt af rapporteringsenhederne, som normalt er omsættelige instrumenter og handlet på de sekundære markeder, eller som kan modregnes på markedet, og som ikke giver indehaveren nogen ejendomsret over den udstedende institution. Denne post omfatter: <ol style="list-style-type: none"> værdipapirer, som giver indehaveren en fuld og ubetinget ret til et fast eller ved aftale fastsat afkast i form af kuponbetalinger og/eller en fastlagt sum på en given dato (eller datoer) eller regnet fra en dato, der er defineret på udstedelsestidspunktet. ikke-omsættelige instrumenter udstedt af rapporteringsenhederne, som efterfølgende bliver omsættelige og omklassificeres som »gældsværdipapirer«.

2. I bilag III, erstattes Del 1 af følgende:

»DEL 1

INSTRUMENTTYPE

Rapporteringsenheder rapporterer til Den Europæiske Centralbank (ECB) eller den relevante nationale centralbank:

- alle valutaswaptransaktioner, hvor euro købes/sælges spot mod en fremmed valuta og gensælges eller -købes ved en terminsforretning på en fremtidig dato til en forud aftalt terminskurs med en løbetid på til og med et år (defineret som transaktioner med en løbetid på maksimalt 397 dage efter afviklingsdagen for spot-benet af valutaswaptransaktionen), mellem rapporteringsenheden og andre monetære finansielle institutioner (MFI'er), andre finansielle formidlere (OFI'er), forsikringselskaber, pensionskasser, offentlig forvaltning og service eller centralbanker i investeringsøjemed samt med ikke-finansielle selskaber, der klassificeres som »engros« i henhold til Basel III LCR-regelsættet.
- dag-til-dag indeksswap (OIS) transaktioner denomineret i euro mellem rapporteringsenheden og andre MFI'er, OFI'er, forsikringselskaber, pensionskasser, offentlig forvaltning og service eller centralbanker i investeringsøjemed samt med ikke-finansielle selskaber, der klassificeres som »engros« i henhold til Basel III LCR-regelsættet.«

3. I bilag III, erstattes tabellen i afsnit 1 i Del 2 af følgende:

»Felt	Beskrivelse af data	Alternativ rapporteringsmulighed (hvis en sådan findes) og andre kvalifikationer
Transaktionsidentifikator	Den interne entydige transaktionsidentifikator, som rapporteringsenheden anvender for hver transaktion.	Transaktionsidentifikatoren er entydig for alle rapporterede transaktioner på en given rapporteringsdato for et givent penge-markedssegment.
Rapporteringsdatoen	Datoen, hvor dataene indberettes til ECB eller den nationale centralbank.	
Elektronisk tidsstempel	Tidspunktet, på hvilket en transaktion er indgået eller bogført.	

»Felt	Beskrivelse af data	Alternativ rapporteringsmulighed (hvis en sådan findes) og andre kvalifikationer
Modpartskode	En identifikationskode, der anvendes til at genkende rapporteringsenhedens modpart til den rapporterede transaktion.	Hvis transaktioner udføres gennem en central clearingmodpart (CCP), skal CCP'ens legal entity identifier (LEI) angives. Hvis transaktioner indgås med ikke-finansielle selskaber, OFI'er, forsikringsselskaber, pensionskasser, offentlig forvaltning og service og centralbanker og for alle andre rapporterede transaktioner, for hvilke modpartens LEI ikke angives, skal modpartens klasse angives.
Modpartens ID-kode	En attribut, der specificerer den individuelle modpartskodetype, der overføres.	Anvendes i alle tilfælde. En individuel modpartskode angives.
Modpartens beliggenhed	ISO (International Organisation for Standardisering)-landekode for det land, i hvilket modparten er registreret.	Obligatorisk hvis den individuelle modpartskode ikke angives. Ellers valgfri.
Handelsdag	Datoen, på hvilken parterne indgår den rapporterede finansielle transaktion.	
Spotvalørdag (spot value date):	Datoen, på hvilken en part sælger et specifikt beløb i en specifik valuta til en anden part mod betaling af et aftalt beløb i en specifik anden valuta på grundlag af en aftalt valutakurs, den såkaldte valuta-spotkurs.	
Indfrielsesdato	Datoen, på hvilken valutaswaptransaktionen udløber og den valuta, der blev solgt på spotvalørdagen, købes tilbage.	
Transaktionstegn	Anvendes til at identificere, om eurobeløbet, der rapporteres i henhold til transaktionens nominelle beløb, er blevet købt eller solgt på spotvalørdagen.	Denne bør henvise til euro spot, dvs. om euro er blevet købt eller solgt på spotvalørdagen.
Transaktionens nominelle beløb	Eurobeløbet, der købes eller sælges på spotvalørdagen.	
Udenlandsk valutakode	Den internationale trecifrede ISO-kode for den valuta, der købes/sælges for euro.	

»Felt	Beskrivelse af data	Alternativ rapporteringsmulighed (hvis en sådan findes) og andre kvalifikationer
Valutaspotkurs	Valutakursen mellem euro og den udenlandske valuta, der finder anvendelse på spot-benet af valutaswaptransaktionen.	
Valutaterminspoint	Forskellen mellem valutaspotkursen og valutaterminskursen, udtrykt i noterede basispoint i overensstemmelse med de gældende markedskonventioner for valutaparret.«	