

**EUROOPAN KESKUSPANKIN ASETUS (EU) 2015/1599,**  
**annettu 10 päivänä syyskuuta 2015,**  
**rahamarkkinatilastoista annetun asetuksen (EU) N:o 1333/2014 muuttamisesta (EKP/2015/30)**

EUROOPAN KESKUSPANKIN NEUVOSTO, joka

ottaa huomioon Euroopan keskuspankkijärjestelmän ja Euroopan keskuspankin perussäännön ja erityisesti sen 5 artiklan,

ottaa huomioon Euroopan keskuspankin valtuuksista kerätä tilastotietoja 23 päivänä marraskuuta 1998 annetun neuvoston asetuksen (EY) N:o 2533/98 <sup>(1)</sup> ja erityisesti sen 5 artiklan 1 kohdan ja 6 artiklan 4 kohdan,

sekä katsoo seuraavaa:

- (1) Euroopan keskuspankin asetuksessa (EU) N:o 1333/2014 (EKP/2014/48) <sup>(2)</sup> edellytetään tiedonantajien raportoivan tilastotietoja, jotta Euroopan keskuspankkijärjestelmä voi tehtäviensä suorittamiseksi tuottaa rahamarkkinataloustoimiin liittyviä tilastoja.
- (2) Kansallisille keskuspankeille tullaan antamaan joukko raportointiohjeita, joissa täsmennetään yksityiskohtaiset parametrit asetuksen (EU) N:o 1333/2014 (EKP/2014/48) mukaista tilastotietojen raportointia varten. Koska raportointiohjeissa tarkennetaan useita merkittäviä, mainitussa asetuksessa esiintyviä käsitteitä, näiden muutosten pitäisi johdonmukaisuuden vuoksi näkyä myös asetuksessa.
- (3) Näin ollen asetusta (EU) N:o 1333/2014 (EKP/2014/48) olisi vastaavasti muutettava,

ON HYVÄKSYNYT TÄMÄN ASETUKSEN:

*1 artikla*

**Muutokset**

1. Korvataan asetuksen (EU) N:o 1333/2014 (EKP/2014/48) liite I tämän asetuksen liitteellä I.
2. Muutetaan asetuksen (EU) N:o 1333/2014 (EKP/2014/48) liitteitä II ja III tämän asetuksen liitteen II mukaisesti.

*2 artikla*

**Loppusäännökset**

Tämä asetus tulee voimaan kahdentenakymmenentenä päivänä sen jälkeen, kun se on julkaistu *Euroopan unionin virallisessa lehdessä*.

Tämä asetus on kaikilta osiltaan velvoittava, ja sitä sovelletaan sellaisenaan jäsenvaltioissa perussopimusten mukaisesti.

Tehty Frankfurt am Mainissa 10 päivänä syyskuuta 2015.

*EKP:n neuvoston puolesta*

*EKP:n puheenjohtaja*

Mario DRAGHI

<sup>(1)</sup> EYVL L 318, 27.11.1998, s. 8.

<sup>(2)</sup> Euroopan keskuspankin asetus (EU) N:o 1333/2014, annettu 26 päivänä marraskuuta 2014, rahamarkkinatilastoista (EKP/2014/48) (EUVL L 359, 16.12.2014, s. 97).

## LIITE I

## "LIITE I

**Vakuudellisiin taloustoimiin liittyvien rahamarkkinatilastojen ilmoittaminen**

## 1 OSA

**INSTRUMENTIN TYYPPI**

Tiedonantajat raportoivat Euroopan keskuspankille (EKP) tai asianomaiselle kansalliselle keskuspankille kaikki euromääräiset takaisinostosopimukset sekä kaikki niiden mukaisesti sijoitustarkoituksessa suoritettut taloustoimet, kolmikantarepot mukaan luettuina, joiden juoksuaika on enintään yksi vuosi (eli taloustoimet, joiden erääntymispäivä on enintään 397 päivää suorituspäivästä) ja joiden osapuolina ovat toisaalta tiedonantaja ja toisaalta jokin toinen rahalaitos, muu rahoituksen välittäjä, vakuutuslaitos, eläkerahasto, julkisyhteisö tai keskuspankki taikka yritys, joka luokitellaan Basel III:n LCR-järjestelmässä tukkukaupan piiriin.

## 2 OSA

**TIEDON TYYPPI****1. Kunkin taloustoimen osalta ilmoitetaan taloustoimeen liittyvän tiedon <sup>(1)</sup> tyyppi:**

Kenttä	Tiedon kuvaus	Mahdollinen vaihtoehtoinen tiedonantomenetelmä ja muut huomautukset
Transaction identifier (tapahtumatunnus)	Yksilöllinen sisäinen tapahtumatunnus, jota tiedonantaja käyttää kunkin taloustoimen yhteydessä.	Tietyinä raportointipäivänä kultakin rahamarkkinasegmentiltä raportoidun taloustoimen tapahtumatunnus on yksilöllinen.
Reporting date (raportointipäivämäärä)	Päivä, jona tiedot toimitetaan EKP:lle tai kansalliselle keskuspankille.	
Electronic time stamp (sähköinen aikaleima)	Taloustoimen toteuttamisen tai kirjaamisen ajankohta.	
Counterparty code (vastapuolikoodi)	Tunnistekoodi, jonka avulla voidaan tunnistaa tiedonantajan vastapuoli raportoidussa transaktiossa.	Jos taloustoimet toteutetaan keskusvastapuolen välityksellä, keskusvastapuolen yhteisötunnus (LEI-tunnus) on toimitettava.  Vastapuoliryhmä toimitetaan yritysten, muiden rahoituksen välittäjien, vakuutuslaitosten, eläkerahastojen, julkisyhteisöjen ja keskuspankkien osalta sekä sellaisten mahdollisten muiden raportoitujen taloustoimien osalta, joista vastapuolen LEI-tunnusta ei toimiteta.
Counterparty code ID (vastapuolikoodin ID)	Attribuutti, joka määrittää toimitetun yksilöllisen vastapuolikoodin tyyppin.	Käytetään aina. Annetaan yksilöllinen vastapuolikoodi.

<sup>(1)</sup> Tietojen sähköistä toimittamista koskevat standardit ja tekniset eritelmät vahvistetaan erikseen. Ne ovat saatavissa EKP:n verkkosivuilla [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

Kenttä	Tiedon kuvaus	Mahdollinen vaihtoehtoinen tiedonantomenetelmä ja muut huomautukset
Counterparty location (vastapuolen sijainti)	Sen maan ISO-maakoodi, jossa vastapuolella on kotipaikka.	Pakollinen, jos yksilöllistä vastapuolikoodia ei ole toimitettu. Muuten valinnainen.
Transaction nominal amount (taloustoimen nimellisarvo)	Alkuperäisen anto- tai ottolainauksen määrä.	
Collateral nominal amount (vakuuden nimellisarvo)	Vakuudeksi annetun arvopaperin nimellisarvo.	Ei koske kolmikantarepoja tai muita mahdollisia taloustoimia, joiden kohdalla vakuudeksi annettua arvopaperia ei voida yksilöidä ISIN-koodilla (International Securities Identification Number).
Trade date (kaupantekopäivä)	Päivä, jona osapuolet tekevät raportoidun rahoitustaloustoimen.	
Settlement date (suorituspäivä)	Ostopäivä eli päivä, jona lainanantajan on maksettava käteinen lainanottajalle ja lainanottajan on toimitettava arvopaperi lainanantajalle.	Jos kyseessä on avoin takaisinostotaloustoimi, päivämäärä, jona uusimiseen liittyvät suoritukset tehdään (vaikka käteissiirtoja ei tehtäisi).
Maturity date (erääntymispäivä)	Takaisinostopäivä eli päivä, jona lainanottajan on maksettava käteinen takaisin lainanantajalle.	Jos kyseessä on avoin takaisinostotaloustoimi, päivämäärä, jona pääoma ja korko on maksettava takaisin, jos sopimusta ei enää uusita.
Transaction sign (taloustoimen merkki)	Käteisen ottolainaus repojen tapauksessa ja käteisen antolainaus käänteisoperaatioiden tapauksessa.	
ISIN of the collateral (vakuuden ISIN-koodi)	Rahoitusmarkkinoilla liikkeeseen laskeville arvopapereille annettu 12 aakkosnumeerisesta merkistä koostuva kansainvälinen koodi, jonka avulla yksittäinen arvopaperi tunnistetaan (ISO 6166 -standardissa tarkoitettulla tavalla).	Ilmoitetaan tiettyjä vakuustyyppisiä lukuun ottamatta.
Collateral type (vakuuden tyyppi)	Vakuudeksi annetun omaisuuserän tunnistamiseksi tapauksissa, joissa yksilöllistä ISIN-koodia ei ole annettu.	Toimitetaan aina jos yksilöllistä ISIN-koodia ei ole toimitettu.
Vakuuden liikkeeseen laskeva sektori	Vakuudeksi liikkeeseen laskevan sektorin tunnistamiseksi tapauksissa, joissa yksilöllistä ISIN-koodia ei ole annettu.	Toimitetaan, jos yksilöllistä ISIN-koodia ei ole toimitettu.
Special collateral flag (erityisen vakuuden merkki)	Sellaisten takaisinostotaloustoimien erottelun vuoksi, jotka toteutetaan yleisvakuutta vastaan ja jotka toteutetaan erityistä vakuutta vastaan. Valinnainen kenttä, joka toimitetaan vain jos se on tiedonantajan kannalta tarkoituksenmukaista.	Tämän kentän raportointi on vapaaehtoista.

Kenttä	Tiedon kuvaus	Mahdollinen vaihtoehtoinen tiedonantomenetelmä ja muut huomautukset
Deal rate (taloustoimen korko)	ACT/360-rahamarkkinakonvention mukaisesti ilmaistu korko, jonka mukaisesti repo toteutettiin ja lainaksi annettu käteinen on maksettava takaisin.	
Collateral haircut (vakuuden aliarvostus)	Vakuuksiin sovellettava riskienhallintatoimi, jonka yhteydessä vakuuden arvo lasketaan vähentämällä tietty prosenttiosuus (haircut) omaisuuserän markkina-arvosta. Raportoinnissa vakuuden aliarvostus (haircut) lasketaan vähentämällä luvusta 100 lainaksi annetun tai otetun käteisen ja vakuuden markkina-arvon (ml. kertyneet korot) suhde.	Tämä kenttä raportoidaan ainoastaan yhden vakuuden taloustoimissa.
Counterparty code of the tri-party agent (kolmikantasopimusagentin vastapuolikoodi)	Kolmikantasopimusagentin vastapuolikoodi.	Raportoidaan kolmikantarepojen osalta.
Tri-party agent code ID (kolmikantasopimusagentin koodin ID)	Attribuutti, joka määrittää toimitetun yksilöidyn kolmikantasopimusagentin koodin tyyppin.	Käytetään aina, kun yksilöity kolmikantasopimusagentin koodi toimitetaan.

## 2. Olennaisuuskynnys

Yritysten kanssa toteutetut taloustoimet raportoidaan vain, jos ne on toteutettu Basel III:n LCR-järjestelmässä tukkukaupan piiriin luokiteltavien yritysten kanssa <sup>(1)</sup>.

## 3. Poikkeukset

Ryhmittymänsisäisiä taloustoimia ei raportoida.”

<sup>(1)</sup> Ks. 'Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools', Baselin pankkivalvontakomitea, tammikuu 2013, s. 23–27, saatavissa kansainvälisen järjestelypankin verkkosivuilla [www.bis.org](http://www.bis.org)

## LIITE II

Muutetaan asetuksen (EU) N:o 1333/2014 (EKP/2014/48) liitteitä II ja III seuraavasti:

1. Korvataan liitteessä II oleva 1 osa seuraavasti:

”1 OSA

## INSTRUMENTIN TYYPPI

1. Tiedonantajat raportoivat Euroopan keskuspankille (EKP) tai asianomaiselle kansalliselle keskuspankille seuraavat tiedot:
  - a) tiedonantajan jäljempänä olevassa taulukossa määriteltyjä instrumentteja käyttäen sijoitustarkoituksessa ottamat, maturiteetiltaan enintään yhden vuoden pituiset (eli erääntymispäivä on enintään 397 päivää suorituspäivästä) euomääräiset lainat muilta rahalaitoksilta, muilta rahoituksen välittäjiltä, vakuutuslaitoksilta, eläkerahastoilta, julkisyhteisöiltä tai keskuspankeilta taikka yrityksiltä, jotka luokitellaan Basel III LCR-järjestelmässä tukkukaupan piiriin.
  - b) kaikki muille luottolaitoksille annetut lainat, joiden maturiteetti on enintään yksi vuosi (eli erääntymispäivä on enintään 397 päivää suorituspäivästä) ja jotka annettu vakuudettomina talletuksina tai avistatilien kautta, tai ostamalla liikkeeseenlaskevien luottolaitosten yritystodistuksia, talletustodistuksia, vaihtuvakorkoisia instrumentteja tai muita velkapapereita, joiden maturiteetti on enintään yksi vuosi.
2. Jäljempänä olevassa taulukossa esitetään yksityiskohtaiset vakiokuvaukset instrumenttiluokista, joihin kuuluvista taloustoimista tiedonantajien on raportoitava EKP:lle. Jos tiedonantajien on raportoitava nämä taloustoimet kansalliselle keskuspankilleen, asianomainen kansallinen keskuspankki muokkaa nämä yksityiskohtaiset vakiokuvaukset instrumenttiluokista kansallisella tasolla sovellettaviksi luokiksi tämän asetuksen mukaisesti.

Instrument type (instrumentin tyyppi)	Kuvaus
Deposits (talletukset)	Vakuudettomat korolliset talletukset (mukaan lukien avistatilit, mutta pois lukien sekkitilit), jotka ovat joko irtisanomisehtoisia tai joiden maturiteetti on enintään yksi vuosi ja jotka tiedonantaja joko vastaanottaa (lainaa) tai tallettaa.
Call accounts (avistatilit)	Käteistilit, joihin sovellettava korko vaihtuu päivittäin ja joille kertyvä korko maksetaan tai lasketaan säännöllisin väliajoin sekä joilta voidaan nostaa rahaa irtisanomisaajan jälkeen.
Certificate of deposit (talletustodistus)	Rahalaitoksen liikkeeseen laskema velkainstrumentti, jolla on kiinteä määräaika, ja joka oikeuttaa haltijan yksilöityyn kiinteään korkoon tietyn kiinteän, enintään yhden vuoden pituisen ajanjakson ajan.
Commercial paper (yritystodistus)	Velkainstrumentti, joka on joko vakuudeton tai jonka vakuutena on liikkeeseenlaskejan antama vakuus sekä jonka maturiteetti on enintään yksi vuosi ja joka on joko korollinen tai diskontattu.
Floating rate note (vaihtuvakorkoinen instrumentti)	Velkainstrumentti, jolle määräajoin maksettava korko lasketaan arvon perusteella, eli tarkistamalla viitekorko (esim. euribor) tiettyinä päivinä (korontarkistuspäivät) ja jossa maturiteetti on enintään yksi vuosi.

Instrument type (instrumentin tyyppi)	Kuvaus
Other short-term debt securities (muut lyhytaikaiset velkapaperit)	<p>Muut kuin etuoikeusasemaltaan toissijaiset arvopaperit, jotka eivät ole osakkeita tai osuuksia ja joiden maturiteetti on enintään yksi vuosi; nämä instrumentit ovat yleensä jälkimarkkinakelpoisia ja niillä käydään kauppaa jälkimarkkinoilla, tai ne voidaan vaihtaa markkinoilla; instrumentit eivät tuota haltijalleen omistusoikeutta liikkeeseenlaskevaan laitokseen. Tämä erä sisältää:</p> <p>a) arvopapereita, jotka antavat haltijalleen ehdottoman oikeuden kiinteään tai sopimusperusteiseen tuloon kuponkimaksujen muodossa ja/tai ilmoitetun kiinteän summan tiettyinä päivinä (tai tiettyinä päivinä) tai liikkeeseenlaskuhetkellä määritetystä päivästä lukien;</p> <p>b) tiedonantajien liikkeeseen laskemia ei-jälkimarkkinakelpoisia instrumentteja, jotka myöhemmin tulevat jälkimarkkinakelpoisiksi ja joiden luokitus muuttuu 'velkainstrumenteiksi'."</p>

2. Korvataan liitteessä III oleva 1 osa seuraavasti:

"1 OSA

#### INSTRUMENTIN TYYPPI

Tiedonantajat raportoivat Euroopan keskuspankille (EKP) tai asianomaiselle kansalliselle keskuspankille seuraavat tiedot:

- a) kaikki sijoitustarkoituksessa tehdyt valuutanvaihtosopimukset, joissa euroja ostetaan/myydään avistapäivänä ulkomaan valuuttaa vastaan ja joissa eurot myydään tai ostetaan takaisin termiinipäivänä etukäteen sovittuun termiinikurssiin sekä joiden maturiteetti on enintään yksi vuosi (eli erääntymispäivä on enintään 397 päivää valuuttaswap-kaupan avistaosan suorituspäivästä) ja joiden osapuolina ovat toisaalta tiedonantaja ja toisaalta jokin toinen rahalaitos, muu rahoituksen välittäjä, vakuutuslaitos, eläkerahasto, julkisyhteisö tai kansallinen keskuspankki taikka sellaisten yritys, joka luokitellaan Basel III:n LCR-järjestelmässä tukkukaupan piiriin;
- b) euromääräiset sijoitustarkoituksessa tehdyt yliyön indeksivaihtosopimukset, joiden osapuolina ovat toisaalta tiedonantaja ja toisaalta jokin toinen rahalaitos, muu rahoituksen välittäjä, vakuutuslaitos, eläkerahasto, julkisyhteisö tai kansallinen keskuspankki taikka sellainen yritys, joka luokitellaan Basel III:n LCR-järjestelmässä on tukkukaupan piiriin.;"

3. Korvataan liitteessä III olevan 2 osan 1 kohdassa oleva taulukko seuraavasti:

"Kenttä	Tiedon kuvaus	Mahdollinen vaihtoehtoinen tiedonantomenetelmä ja muut huomautukset
Transaction identifier (tapahtumatunnus)	Yksilöllinen sisäinen tapahtumatunnus, jota tiedonantaja käyttää kunkin taloustoimen yhteydessä.	Tiettyinä raportointipäivinä kultakin rahamarkkinasegmentiltä raportoidun taloustoimen tapahtumatunnus on yksilöllinen.
Reporting date (raportointipäivämäärä)	Päivä, jona tiedot toimitetaan EKP:lle tai kansalliselle keskuspankille.	
Electronic time stamp (sähköinen aikaleima)	Taloustoimen toteuttamisen tai kirjaamisen ajankohta.	

"Kenttä	Tiedon kuvaus	Mahdollinen vaihtoehtoinen tiedonantomenetelmä ja muut huomautukset
Counterparty code (vastapuolikoodi)	Tunnistekoodi, jonka avulla voidaan tunnistaa tiedonantajan vastapuoli raportoidussa transaktiossa.	Jos taloustoimet toteutetaan keskusvastapuolen välityksellä, keskusvastapuolen yhteisötunnus (LEI-tunnus) on toimitettava.  Vastapuoliryhmä toimitetaan yritysten, muiden rahoituksen välittäjien, vakuutuslaitosten, eläkerahastojen, julkisyhteisöjen ja keskuspankkien osalta sekä sellaisten mahdollisten muiden raportoitujen taloustoimien osalta, joista vastapuolen LEI-tunnusta ei toimiteta.
Counterparty code ID (vastapuolikoodin ID)	Attribuutti, joka määrittää toimitetun yksilöllisen vastapuolikoodin tyyppin.	Käytetään aina. Annetaan yksilöllinen vastapuolikoodi.
Counterparty location (vastapuolen sijainti)	Sen maan ISO-maakoodi, jossa vastapuolella on kotipaikka.	Pakollinen, jos yksilöllistä vastapuolikoodia ei ole toimitettu. Muuten valinnainen.
Trade date (kaupantekopäivä)	Päivä, jona osapuolet tekevät raportoidun rahoitustaloustoimen.	
Spot value date (avistapäivä)	Päivä, jona osapuoli myy toiselle osapuolelle tietyn määrän tiettyä valuuttaa sovitua määrää tiettyä toista valuuttaa vastaan sovitettuun valuuttakurssiin eli valuuttan avistakurssiin.	
Maturity date (erääntymispäivä)	Päivä, jona valuuttavaihtosopimus erääntyy ja valuuttakaupan avistapäivänä myyty valuutta ostetaan takaisin.	
Transaction sign (taloustoimen merkki)	Merkin avulla tunnistetaan, onko taloustoimen nimellisarvona raportoitu euromäärä ostettu vai myyty avistapäivänä.	Tämän tulisi viitata maksettuun euromäärään, eli siihen, onko euroja myyty vai ostettu avistapäivänä.
Transaction nominal amount (taloustoimen nimellisarvo)	Avistapäivänä myytyjen tai ostettujen eurojen määrä.	
Foreign currency code (valuuttakoodi)	Euroa vastaan ostetun/myydyin valuuttan kansainvälinen kolmimerkkinen ISO-koodi.	

"Kenttä	Tiedon kuvaus	Mahdollinen vaihtoehtoinen tiedonantomenetelmä ja muut huomautukset
Foreign exchange spot rate (valuuttakaupan avistakurssi)	Valuuttavaihtosopimuksen avistaosaan sovellettava euron ja ulkomaisen valuutan välinen valuuttakurssi.	
Foreign exchange forward points (valuuttatermiinit)	Valuuttakaupan avistakurssin ja valuuttakaupan termiinikurssin välinen ero peruspisteinä ilmaistuna ja laskettuna valuuttaparin senhetkisen markkinakäytännön mukaisesti."	