

UREDBA (EU) 2015/1599 EUROPSKE SREDIŠNJE BANKE**od 10. rujna 2015.****o izmjeni Uredbe (EU) br. 1333/2014 o statistici tržišta novca (ESB/2015/30)**

UPRAVNO VIJEĆE EUROPSKE SREDIŠNJE BANKE,

uzimajući u obzir Statut Europskog sustava središnjih banaka i Europske središnje banke, a posebno njegov članak 5.,

uzimajući u obzir Uredbu Vijeća (EZ) br. 2533/98 od 23. studenoga 1998. o prikupljanju statističkih podataka od strane Europske središnje banke ⁽¹⁾, a posebno njezin članak 5. stavak 1. i članak 6. stavak 4.,

budući da:

- (1) Uredba (EU) br. 1333/2014 Europske središnje banke (ESB/2014/48) ⁽²⁾ zahtijeva dostavljanje statističkih podataka od strane izvještajnih jedinica kako bi Europski sustav središnjih banaka u izvršavanju svojih zadaća mogao izraditi statistiku o transakcijama na tržištu novca.
- (2) Skup izvještajnih uputa koje utvrđuju iscrpne parametre za dostavljanje statističkih podataka u skladu s Uredbom (EU) br. 1333/2014 (ESB/2014/48) izdat će se nacionalnim središnjim bankama. Budući da izvještajne upute preciziraju niz bitnih uvjeta koji se pojavljuju u toj Uredbi, potrebno je, dosljednosti radi, unijeti te izmjene.
- (3) Uredbu (EU) br. 1333/2014 (ESB/2014/48) trebalo bi stoga na odgovarajući način izmijeniti,

DONIJELO JE OVU UREDBU:

Članak 1.**Izmjene**

1. Prilog I. Uredbi (EU) br. 1333/2014 (ESB/2014/48) zamjenjuje se Prilogom I. ovoj Uredbi.
2. Prilozi II. i III. Uredbi (EU) br. 1333/2014 (ESB/2014/48) mijenjaju se u skladu s Prilogom II. ovoj Uredbi.

Članak 2.**Završne odredbe**Ova Uredba stupa na snagu dvadesetog dana od dana objave u *Službenom listu Europske unije*.

Ova je Uredba u cijelosti obvezujuća i neposredno se primjenjuje u državama članicama u skladu s Ugovorima.

Sastavljeno u Frankfurtu na Majni 10. rujna 2015.

Upravno vijeće ESB-a

Predsjednik ESB-a

Mario DRAGHI

⁽¹⁾ SL L 318, 27.11.1998., str. 8.⁽²⁾ Uredba (EU) br. 1333/2014 Europske središnje banke od 26. studenoga 2014. o statistici tržišta novca (ESB/2014/48) (SL L 359, 16.12.2014., str. 97.).

PRILOG I.

„PRILOG I.

Izveštajna shema za statistiku tržišta novca koja se odnosi na osigurane transakcije

DIO 1.

VRSTA INSTRUMENTATA

Izveštajne jedinice izvještavaju Europsku središnju banku (ESB) ili odgovarajuću nacionalnu središnju banku (NSB) o svim repo ugovorima i poslovima sklopljenim na temelju tih repo ugovora i poslova, uključujući trostrane repo poslove nominirane u eurima s dospeljem do i uključujući jednu godinu (određene kao transakcije s datumom dospelja ne duljim od 397 dana nakon datuma namire) između izveštajne jedinice i drugih monetarnih financijskih institucija, ostalih financijskih posrednika, osiguravajućih društava, mirovinskih fondova, opće države ili središnjih banaka za potrebe ulaganja kao i s nefinancijskim društvima razvrstanim kao ‚veleprodajnim‘ prema okviru koeficijenta likvidnosne pokrivenosti Basel III.

DIO 2.

VRSTA PODATAKA**1. Vrsta podataka utemeljenih na transakcijama ⁽¹⁾ koji se trebaju dostaviti za svaku transakciju**

Polje	Opis podataka	Alternativna mogućnost izvješćivanja (ako postoji) i drugi elementi
Transaction identifier (Identifikator transakcije)	Interni jedinstveni identifikator transakcije koji koristi izveštajna jedinica za svaku transakciju.	Identifikator transakcije je jedinstven za svaku transakciju o kojoj se izvješćuje na određeni izvještajni datum za bilo koji segment tržišta novca.
Reporting date (Izveštajni datum)	Datum kada se podaci dostavljaju ESB-u ili NSB-u.	
Electronic time stamp (Elektronički vremenski žig)	Vrijeme kada je transakcija zaključena ili proknjižena.	
Counterparty code (Oznaka protustranke)	Identifikacijska oznaka koja se koristi radi prepoznavanja protustranke izveštajne jedinice za transakciju koja se iskazuje.	Kada su transakcije zaključene putem središnje klirinške protustranke, mora se dostaviti jedinstveni identifikator pravnih osoba (LEI) središnje klirinške protustranke. Kada se transakcije poduzimaju s nefinancijskim društvima, ostalim financijskim posrednicima, osiguravajućim društvima, mirovinskim fondovima, općom državom i središnjim bankama i za bilo koju drugu transakciju o kojoj se izvješćuje za koju nije dostavljen LEI druge ugovorne strane, mora se dostaviti razred druge ugovorne strane.
Counterparty code ID (Identifikator oznake protustranke)	Atribut koji određuje vrstu individualne oznake protustranke koja se prenosi.	Treba se koristiti u svim okolnostima. Osigurat će se pojedinačna oznaka protustranke.

⁽¹⁾ Standardi elektroničkog izvještavanja i tehničke specifikacije za podatke posebno su utvrđeni. Dostupno na internetskoj stranici ESB-a: www.ecb.europa.eu.

Polje	Opis podataka	Alternativna mogućnost izvješćivanja (ako postoji) i drugi elementi
Counterparty location (Mjesto gdje se protustranka nalazi)	Oznaka zemlje Međunarodne organizacije za normizaciju (ISO) za zemlju u kojoj je protustranka osnovana.	Obvezna ako nije osigurana pojedinačna oznaka protustranke. U suprotnom, neobavezna.
Transaction nominal amount (Nominalni iznos transakcije)	Iznos koji je prvotno uzet u zajam ili koji je prvotno pozajmljen.	
Collateral nominal amount (Nominalni iznos kolaterala)	Nominalni iznos vrijednosnog papira koji je založen kao kolateral.	Osim za trostrani repo i bilo koje druge transakcije u kojima založeni vrijednosni papir nije utvrđen putem jedinstvenog međunarodnog identifikacijskog broja vrijednosnih papira (ISIN).
Trade date (Datum trgovanja)	Datum kada stranke sklapaju financijsku transakciju.	
Settlement date (Datum namire)	Datum kupnje, tj. datum kada dospijeva plaćanje gotovine od strane zajmodavca zajmoprimcu, a zajmoprimac treba prenijeti vrijednosni papir zajmodavcu.	U slučaju repo transakcija na otvorenoj osnovi, to je datum kada je obnavljanje izvršeno (iako nije došlo do razmjene gotovine).
Maturity date (Datum dospijeća)	Datum ponovne kupnje, tj. datum kada dospijeva otplata gotovine od strane zajmoprimca zajmodavcu.	U slučaju repo transakcija na otvorenoj osnovi, to je datum kada treba oplatiti dugovanu glavnici i kamate ako transakcija nije nadalje obnovljena.
Transaction sign (Oznaka transakcije)	Pozajmljivanje gotovine u slučaju repo ugovora ili davanje gotovine u zajam u slučaju obratnih repo ugovora.	
ISIN of the collateral (Oznaka ISIN za kolateral)	Oznaka ISIN dodijeljena vrijednosnim papirima izdanim na financijskim tržištima, koji se sastoji od 12 alfanumeričkih znakova, kojim se jednoznačno određuje vrijednosni papir (kako je utvrđeno normom ISO 6166).	Dostavlja se, s iznimkom određenih vrsta kolaterala.
Collateral type (Vrsta kolaterala)	Radi utvrđivanja kategorije imovine založene kao kolateral kada nije dostavljena pojedinačna ISIN oznaka.	Dostavljaju se u svim slučajevima gdje nije dostavljena pojedinačna ISIN oznaka.
Collateral Issuer Sector (Sektor izdavatelja kolaterala)	Radi utvrđivanja sektora izdavatelja kolaterala kada nije dostavljena pojedinačna ISIN oznaka.	Dostavljaju se kada nije dostavljena pojedinačna ISIN oznaka.
Special collateral flag (Poseban identifikator kolaterala)	Radi utvrđivanja svih repo poslova koji se provode uz kolateral i onih koji se provode uz poseban kolateral. Neobavezno polje koje se dostavlja samo ako je provedivo za izvještajnu jedinicu.	Izvještavanje za ovo polje je neobavezno.

Polje	Opis podataka	Alternativna mogućnost izvješćivanja (ako postoji) i drugi elementi
Deal rate (Stopa transakcije)	Kamatna stopa izražena u skladu s konvencijom ACT/360 novčanog tržišta po kojoj je repo ugovor sklopljen i po kojoj se posuđena gotovina plaća.	
Collateral haircut (Korektivni faktor za kolateral)	Mjera kontrole rizika koja se primjenjuje na temeljni kolateral pri čemu se vrijednost temeljnog kolaterala računa kao tržišna vrijednost imovine, umanjena za određeni postotak (korektivni faktor). Za potrebe izvješćivanja, korektivni faktor kolaterala izračunava se kao 100 umanjeno za prosjek između gotovine koja je pozajmljena/gotovine uzete u zajam i tržišne vrijednosti uključujući obračunate kamate založenog kolaterala.	Izvješćivanje za ovo polje zahtijeva se samo za pojedinačne kolateralne transakcije.
Counterparty code of the tri-party agent (Oznaka protustranke za agenta treću stranu)	Identifikacijska oznaka protustranke za agenta treću stranu.	Izvješćivanje se obavlja za trostrane repo ugovore.
Tri-party agent code ID (Identifikator oznake agenta treće strane)	Atribut koji određuje vrstu pojedinačne oznake agenta treće strane koja se prenosi.	Upotrebljava se u svim okolnostima gdje nije dostavljena pojedinačna oznaka agenta treće strane.

2. Prag značajnosti

O transakcijama poduzetim s nefinancijskim društvima trebalo bi se izvještavati samo kada se poduzimaju s nefinancijskim društvima razvrstanim kao veleprodajnim na temelju Okvira koeficijenta likvidnosne pokrivenosti Basel III ⁽¹⁾.

3. Iznimke

Transakcije unutar grupe ne iskazuju se.”

⁽¹⁾ Vidjeti 'Basel III: Alati za praćenje koeficijenta likvidnosne pokrivenosti i likvidnosnog rizika', Bazelski odbor za nadzor banaka, siječanj 2013., str. 23.–27., dostupno na mrežnoj stranici Banke za međunarodne namire: www.bis.org.

PRILOG II.

Prilozi II. i III. Uredbi (EU) br. 1333/2014 (ESB/2014/48) mijenjaju se kako slijedi:

1. U Prilogu II., dio 1. zamjenjuje se sljedećim:

„DIO 1.

VRSTA INSTRUMENATA

1. Izvještajne jedinice izvještavaju Europsku središnju banku (ESB) ili odgovarajuću nacionalnu središnju banku (NSB) o:
 - (a) svim zajmovima gdje se koriste instrumenti određeni u donjoj tablici, nominirani u eurima s dospeljem do i uključujući jednu godinu (određene kao transakcije s datumom dospelja ne duljim od 397 dana nakon datuma namire), koje je izvještajna jedinica uzela od drugih monetarnih financijskih institucija, ostalih financijskih posrednika, osiguravajućih društava, mirovinskih fondova, opće države ili središnjih banaka u svrhe ulaganja kao i od nefinancijskih društava razvrstanih kao ‚veleprodajnih‘ prema okviru koeficijenta likvidnosne pokrivenosti Basel III;
 - (b) svim pozajmljivanjima drugim kreditnim institucijama s dospeljem do i uključujući jednu godinu (određene kao transakcije s datumom dospelja ne duljim od 397 dana nakon datuma namire) putem neosiguranih depozita ili depozitnih računa po viđenju ili putem kupnje komercijalnih zapisa, potvrda o depozitu, obveznica s promjenjivom kamatnom stopom i drugih dužničkih vrijednosnih papira s rokom dospelja do jedne godine, od kreditnih institucija koje su ih izdale.
2. U donjoj tablici prikazuje se detaljan standardni opis kategorija instrumenata za transakcije o kojima izvještajne jedinice izvještavaju ESB. U slučaju da izvještajne jedinice moraju izvješćivati svoj NSB o transakcijama, odgovarajući NSB trebao bi prenijeti ove opise kategorija instrumenata na nacionalnoj razini u skladu s ovom Uredbom.

Vrsta instrumenta	Opis
Deposits (Depoziti)	Neosigurani depoziti koji nose kamate (uključujući depozitne račune po viđenju, ali isključujući tekuće račune) koji su ili iskupivi s otkaznim rokom ili s dospeljem od najviše godinu dana, a koje je izvještajna jedinica preuzela (uzela u zajam) ili plasirala.
Call accounts (Depozitni računi po viđenju)	Gotovinski računi s dnevnim promjenama u odnosu na primjenjive kamatne stope, koji dovode do plaćanja kamata ili izračuna u redovitim razmacima i s rokom za podizanje novca.
Certificate of deposit (Certifikat o depozitu)	Oročeni dužnički instrument izdan od strane monetarne financijske institucije koji imatelju daje pravo na posebnu nepromjenjivu kamatnu stopu s određenim fiksnim rokom dospelja do jedne godine.
Commercial paper (Komerציjalni zapis)	Dužnički instrument koji je neosiguran ili osiguran kolateralom koji je osigurao izdavatelj, s dospeljem od najviše godinu dana, a koji ne nosi kamatu ili je diskontiran.
Floating rate note (Obveznica s promjenjivom kamatnom stopom)	Dužnički instrument za koji se periodična kamatna plaćanja izračunavaju na temelju vrijednosti, tj. putem utvrđivanja temeljne referentne stope kao što je EURIBOR na unaprijed određene datume, poznati kao datumi fiksiranja kamata, s dospeljem od najviše godinu dana.

Vrsta instrumenta	Opis
Other short-term debt securities (Drugi kratkoročni dužnički vrijednosni papiri)	Vrijednosni papiri osim udjela koje su izdale izvještajne jedinice i koji su obično prenosivi instrumenti kojima se trguje na sekundarnim tržištima ili je moguć njihov prijeboj na tržištu, te koji imatelju ne osiguravaju nikakva vlasnička prava nad institucijom izdavateljem. Ova stavka uključuje: (a) vrijednosne papire koji imatelju daju bezuvjetno pravo na fiksni ili ugovorno utvrđeni prihod u obliku kuponskih isplata i/ili utvrđeni fiksni iznos na određeni datum (ili datume) ili počevši od datuma određenog u vrijeme izdavanja; (b) neprenosive instrumente koje izdaju izvještajne jedinice, koji naknadno postaju prenosivi, a razvrstani su kao 'dužnički vrijednosni papiri'."

2. U Prilogu III., dio 1. zamjenjuje se sljedećim:

„DIO 1.

VRSTA INSTRUMENATA

Izvještajne jedinice izvještavaju Europsku središnju banku (ESB) ili odgovarajuću nacionalnu središnju banku (NSB) o:

- (a) svim valutnim ugovorima o razmjeni u kojima se promptno kupuje/prodaje euro u zamjenu za stranu valutu i ponovno prodaje ili ponovno kupuje na budući datum po prethodno dogovorenom deviznom terminskom tečaju s dospijecem do i uključujući jednu godinu (određene kao transakcije s datumom dospijeca ne duljim od 397 dana nakon datuma namire promptnog dijela transakcije valutne razmjene) između izvještajne jedinice i drugih monetarnih financijskih institucija, ostalih financijskih posrednika, osiguravajućih društava, mirovinskih fondova, opće države ili središnjih banaka u svrhe ulaganja kao i s nefinancijskim društvima razvrstanim kao 'veleprodajnim' prema okviru koeficijenta likvidnosne pokrivenosti Basel III;
- (b) transakcijama o prekonoćnim kamatnim ugovorima o razmjeni nominiranim u eurima između izvještajne jedinice i drugih monetarnih financijskih institucija, ostalih financijskih posrednika, osiguravajućih društava, mirovinskih fondova, opće države ili središnjih banaka u svrhe ulaganja kao i s nefinancijskim društvima razvrstanim kao 'veleprodajnim' prema okviru koeficijenta likvidnosne pokrivenosti Basel III."

3. U Prilogu III., tablica u stavku 1. dijela 2. zamjenjuje se sljedećim:

„Polje	Opis podataka	Alternativna mogućnost izvješćivanja (ako postoji) i drugi elementi
Transaction identifier (Identifikator transakcije)	Interni jedinstveni identifikator transakcije koji koristi izvještajna jedinica za svaku transakciju.	Identifikator transakcije je jedinstven za svaku transakciju o kojoj se izvješćuje na određeni izvještajni datum za bilo koji segment tržišta novca.
Reporting date (Izvještajni datum)	Datum kada se podaci dostavljaju ESB-u ili NSB-u.	
Electronic time stamp (Elektronički vremenski žig)	Vrijeme kada je transakcija zaključena ili proknjižena.	

„Polje	Opis podataka	Alternativna mogućnost izvješćivanja (ako postoji) i drugi elementi
Counterparty code (Oznaka protustranke)	Identifikacijska oznaka koja se koristi radi prepoznavanja protustranke izvještajne jedinice za transakciju koja se iskazuje.	Kada su transakcije zaključene putem središnje klirinške protustranke, mora se dostaviti jedinstveni identifikator pravnih osoba (LEI) središnje klirinške protustranke. Kada se transakcije poduzimaju s nefinancijskim društvima, ostalim financijskim posrednicima, osiguravajućim društvima, mirovinskim fondovima, općom državom i središnjim bankama i za bilo koju drugu transakciju o kojoj se izvješćuje za koju nije dostavljen LEI druge ugovorne strane, mora se dostaviti razred druge ugovorne strane.
Counterparty code ID (Identifikator oznake protustranke)	Atribut koji određuje vrstu individualne oznake protustranke koja se prenosi.	Treba se koristiti u svim okolnostima. Osigurat će se pojedinačna oznaka protustranke.
Counterparty location (Mjesto gdje se protustranka nalazi)	Oznaka zemlje Međunarodne organizacije za normizaciju (ISO) za zemlju u kojoj je protustranka osnovana.	Obvezna ako nije osigurana pojedinačna oznaka protustranke. U suprotnom, neobavezna.
Trade date (Datum trgovanja)	Datum kada stranke sklope financijsku transakciju.	
Spot value date (Datum namire u promptnom trgovanju)	Datum kada jedna strana prodaje drugoj određeni iznos određene valute uz plaćanje dogovorenog iznosa određene druge valute na temelju dogovorenog deviznog tečaja poznatog kao promptni devizni tečaj.	
Maturity date (Datum dospelja)	Datum kada istječe transakcija valutne razmjene, a valuta koja je prodana na datum promptne vrijednosti se ponovno otkupljuje.	
Transaction sign (Oznaka transakcije)	Koristi se radi utvrđivanja je li iznos u eurima koji je iskazan pod nominalnim iznosom transakcije kupljen ili prodan na datum namire u promptnom trgovanju.	Ovo bi se trebalo odnositi na promptnu prodaju ili kupnju eura, tj. je li se euro kupuje ili prodaje na datum namire u promptnom trgovanju.
Transaction nominal amount (Nominalni iznos transakcije)	Količina eura kupljena ili prodana na datum namire u promptnom trgovanju.	
Foreign currency code (Oznaka strane valute)	Međunarodna troznamenasta ISO oznaka kupljene/prodane valute u zamjenu za euro.	

„Polje	Opis podataka	Alternativna mogućnost izvješćivanja (ako postoji) i drugi elementi
Foreign exchange spot rate (Promptni devizni tečaj)	Devizni tečaj između eura i strane valute primjenjive na promptni dio transakcije valutne razmjene.	
Foreign exchange forward points (Terminski bodovi u stranoj valuti)	Razlika između promptnog deviznog tečaja i deviznog terminskog tečaja izraženog u baznim bodovima iskazanim u skladu s prevladavajućim tržišnim običajima za valutne parove.”	