

AZ EURÓPAI KÖZPONTI BANK (EU) 2015/1599 RENDELETE**(2015. szeptember 10.)****a pénzüpiacokra vonatkozó statisztikákról szóló 1344/2014/EU rendelet módosításáról
(EKB/2015/30)**

AZ EURÓPAI KÖZPONTI BANK KORMÁNYZÓTANÁCSA,

tekintettel a Központi Bankok Európai Rendszere és az Európai Központi Bank Alapokmányára és különösen annak 5. cikkére,

tekintettel az Európai Központi Bank által végzett statisztikai adatgyűjtésről szóló, 1998. november 23-i 2533/98/EK tanácsi rendeletre ⁽¹⁾ és különösen annak 5. cikke (1) bekezdésére és 6. cikke (4) bekezdésére,

mivel:

- (1) Az Európai Központi Bank 1333/2014/EU rendelete ⁽²⁾ (EKB/2014/48) az adatszolgáltatók számára előírja a statisztikai adatok jelentésének kötelezettségét annak érdekében, hogy az Európai Központi Bank a feladatai teljesítése körében a pénzüpiaci tranzakciókra vonatkozó statisztikákat állíthasson elő.
- (2) Az Európai Központi Bank 1333/2014/EU rendelete (EKB/2014/48) alapján történő statisztikai adatszolgáltatásra vonatkozó, részletes követelményeket meghatározó adatszolgáltatási útmutatás kerül majd kibocsátásra a nemzeti központi bankok számára. Mivel az adatszolgáltatási útmutatás számos, a 1333/2014/EU rendeletben szereplő jelentő fogalmat pontosít, az összhang érdekében szükséges ezen változásoknak a rendeletben történő tükrözése.
- (3) Ezért az 1333/2014/EU rendeletet (EKB/2014/48) ennek megfelelően módosítani kell,

ELFOGADTA EZT A RENDELETET:

*1. cikk***Módosítások**

- (1) Az 1333/2014/EU rendelet (EKB/2014/48) I. melléklete helyébe az ezen rendelet I. melléklete lép.
- (2) Az 1333/2014/EU rendelet (EKB/2014/48) II. és III. melléklete ezen rendelet II. és III. mellékletének megfelelően módosul.

*2. cikk***Záró rendelkezések**Ez a rendelet az *Európai Unió Hivatalos Lapjában* történő kihirdetését követő huszadik napon lép hatályba.

Ez a rendelet a Szerződéseknek megfelelően teljes egészében kötelező és közvetlenül alkalmazandó a tagállamokban.

Kelt Frankfurt am Mainban, 2015. szeptember 10-én.

*az EKB Kormányzótanácsa részéről**az EKB elnöke*

Mario DRAGHI

⁽¹⁾ HL L 318., 1998.11.27., 8. o.⁽²⁾ Az Európai Központi Bank 1333/2014/EU rendelete (2014. november 26.) az értékpapírállományokról szóló statisztikákról (EKB/2014/48) (HL L 359., 2014.12.16., 97. o.).

I. MELLÉKLET

„I. MELLÉKLET

A fedezett tranzakciókhoz kapcsolódó pénzügyi statisztikákra vonatkozó adatszolgáltatási rendszer

I. RÉSZ

INSTRUMENTUMOK TÍPUSA

Az adatszolgáltatók az Európai Központi Bank (EKB) vagy az érintett nemzeti központi bank (NKB) részére jelentik valamennyi visszavásárlási megállapodást és az annak keretében kötött tranzakciókat (beleértve a háromszereplős repoügyleteket is), amelyek euróban denomináltak, legfeljebb egy éves futamidejűek (olyan tranzakciók, amelyek esetében a lejárat időpont legfeljebb 397 nappal későbbi, mint az elszámolási nap), és amelyek az adatszolgáltató és egyéb monetáris pénzügyi intézmények (MPI-k), egyéb pénzügyi közvetítők (EPK-k), biztosítók, nyugdíjpénztárak, a kormányzat vagy beruházási célokra központi bankok, valamint a Bazel III LCR keret alapján »wholesale«-ként besorolt nem pénzügyi vállalatok között jöttek létre.

2. RÉSZ

ADATOK TÍPUSA**1. Az egyes tranzakciók esetében jelentendő tranzakció-alapú adatok ⁽¹⁾ típusa:**

Mező	Adatok leírása	Alternatív adatszolgáltatási lehetőség (amennyiben van) és egyéb minősítések
Transaction identifier (Tranzakciós azonosító)	Az adatszolgáltató által minden egyes tranzakcióra vonatkozóan használt belső egyedi tranzakciós azonosító.	A tranzakciós azonosító egy adott adatszolgáltatási időpontban bármely pénzügyi szegmensre vonatkozóan jelentett bármely tranzakcióra nézve egyedi.
Reporting date (Adatszolgáltatás napja)	Az a nap, amikor az adatokat benyújtják az EKB-hoz vagy az NKB-hoz.	
Electronic time stamp (Elektronikus időbélyegző)	Az az időpont, amikor a tranzakciót megkötik vagy elkönnyvelik.	
Counterparty code (Szerződő fél kódja)	A jelentett tranzakcióban az adatszolgáltató szerződő partnerének felismerésére szolgáló azonosító kód.	Amennyiben a tranzakciókat központi szerződő félén keresztül bonyolítják, annak jogalany-azonosítóját meg kell adni. Amennyiben a tranzakciókat EPK-kal, nem pénzügyi vállalatokkal, biztosítókkal, nyugdíjpénztárakkal, a kormányzattal vagy központi bankokkal bonyolítják, valamint minden egyéb jelentett tranzakció esetében, amelyre vonatkozóan a szerződő fél jogalany-azonosítóját nem adják meg, a szerződő fél osztályát meg kell adni.
Counterparty code ID (Szerződő fél kódjának azonosítója)	A szerződő fél továbbított egyedi kódjának típusát meghatározó attribútum.	Minden körülmények között használandó. A szerződő fél egyedi kódja megadásra kerül.

⁽¹⁾ Az elektronikus adatszolgáltatási előírások és az adatokra vonatkozó technikai előírások külön kerülnek rögzítésre. Ezek elérhetők az EKB honlapján: www.ecb.europa.eu

Mező	Adatok leírása	Alternatív adatszolgáltatási lehetőség (amennyiben van) és egyéb minősítések
Counterparty location (Szerződő fél helye)	Azon ország Nemzetközi Szabványügyi Szervezet (ISO) szerinti országkódja, ahol a szerződő felet bejegyezték.	Kötelező, ha a szerződő fél egyedi kódját nem adják meg. Egyébként választható.
Transaction nominal amount (Tranzakció nominális összege)	Az eredetileg kölcsönvett vagy kölcsönadott összeg.	
Collateral nominal amount (Fedezet nominális összege)	A fedezetként felhasznált értékpapír nominális összege.	A háromszereplős repók és bármely más olyan tranzakció kivételével, ahol a fedezetként felhasznált értékpapírt nem azonosítja egyetlen nemzetközi értékpapír-azonosító szám (ISIN).
Trade date (Kötési időpont)	Az a nap, amikor a felek megkötik a pénzügyi tranzakciót.	
Settlement date (Elszámolás napja)	A vásárlás napja, vagyis az a nap, amikor a kölcsönadónak meg kell fizetnie a készpénzt a kölcsönvevő részére, és a kölcsönvevőnek az értékpapírt át kell ruháznia a kölcsönadóra.	A nyitott alapú repoügyletek esetében ez az az időpont, amikor a továbbgörgetés sor kerül (még ha nem is kerül sor készpénz átadására).
Lejárat időpontja	A visszavásárlás napja, vagyis az a nap, amikor a kölcsönvevőnek vissza kell fizetnie a készpénzt a kölcsönadó részére.	A nyitott alapú repoügyletek esetében ez az az időpont, amikor a tartozott tőkét és a kamatokat vissza kell fizetni, amennyiben a tranzakciót nem görgetik tovább.
Transaction sign (Tranzakció előjele)	Repo esetében készpénz kölcsönvétele és fordított repo esetében készpénz kölcsönadása.	
ISIN of the collateral (A fedezet ISIN-je)	A pénzügyi piacokon kibocsátott értékpapírokhoz rendelt ISIN, amely az értékpapírt egyedileg azonosító 12 alfanumerikus karakterből áll (az ISO 6166-ban meghatározottak szerint).	Jelentendő, egyes fedezettípusok kivételével.
Collateral type (Fedezet típusa)	A fedezetként felhasznált eszközosztály azonosítása érdekében, amennyiben egyedi ISIN nem kerül megadásra.	Minden esetben meg kell adni, amennyiben egyedi ISIN nem kerül megadásra.
Értékpapír-kibocsátó szektor	A fedezetet kibocsátó szektorának azonosítása érdekében, amennyiben egyedi ISIN nem kerül megadásra.	Abban az esetben kell megadni, amennyiben egyedi ISIN nem kerül megadásra.
Special collateral flag (Különleges fedezet jelölő)	Az általános fedezet mellett, valamint a különleges fedezet mellett kötött valamennyi repoügylet azonosítása érdekében. Választható mező, csak akkor kell megadni, ha az adatszolgáltató számára megvalósítható.	E mező jelentése választható.

Mező	Adatok leírása	Alternatív adatszolgáltatási lehetőség (amennyiben van) és egyéb minősítések
Deal rate (Ügyleti kamatláb)	Az ACT/360 pénzügyi konvenciónak megfelelően kifejezett azon kamatláb, amely mellett a repót megkötötték és amelyen a kölcsönadott készpénzt díjazták.	
Collateral haircut (Fedezeti haircut)	Az alapul szolgáló fedezetre alkalmazott kockázatellenőrzési intézkedés, amelynek értelmében az alapul szolgáló fedezet értéke úgy kerül kiszámításra, hogy az eszközök piaci értéket meghatározott százalékkal (haircut) csökkentik. Az adatszolgáltatás céljára a fedezeti haircut számítása 100 mínusz a kölcsönadott/kölcsönvett készpénz és a fedezetként felhasznált eszköz felhalmozott kamatot is tartalmazó piaci értéke közötti arány.	E mezőt csak az egyes fedezeti tranzakciók esetében kell jelenteni.
Counterparty code of the tri-party agent (Háromszereplős szolgáltatást nyújtó ügynök szerződő fél kódja)	A háromszereplős szolgáltatást nyújtó ügynök szerződő fél kód azonosítója.	Háromszereplős repók esetében jelentendő.
Tri-party agent code ID (Háromszereplős szolgáltatást nyújtó ügynök kódjának azonosítója)	A háromszereplős szolgáltatást nyújtó ügynök továbbított egyedi kódjának típusát meghatározó attribútum.	Minden körülmények között használandó, amikor megadják a háromszereplős szolgáltatást nyújtó ügynök egyedi kódját.

2. Lényegességi küszöb

A nem pénzügyi vállalatokkal bonyolított tranzakciókat csak akkor kell jelenteni, ha azokat a Bazel III LCR keret ⁽¹⁾ alapján »wholesale«-ként besorolt nem pénzügyi vállalatokkal kötötték.

3. Kivételek

A csoporton belüli tranzakciók nem jelentendők.”

⁽¹⁾ Lásd »Basel III: A likviditásfedezeti ráta és a likviditási kockázat figyelemmel kísérésére szolgáló eszközök«, Bázeli Bankfelügyeleti Bizottság, kelt 2013 januárjában, 23-27. oldal, elérhető a Nemzetközi Fizetések Bankjának honlapján: www.bis.org

II. MELLÉKLET

Az 1333/2014/EU rendelet (EKB/2014/48) II. és III. melléklete a következőképpen módosul:

1. a II. mellékletben az 1. rész helyébe a következő szöveg lép:

„I. RÉSZ

INSTRUMENTUMOK TÍPUSA

1. Az adatszolgáltatók a következőket jelentik az Európai Központi Bank (EKB) vagy az érintett nemzeti központi bank (NKB) felé:
 - a) az adatszolgáltató által az alábbi táblázatban meghatározott valamennyi instrumentum felhasználásával történő, euróban denominált és legfeljebb egy éves futamidejű (azaz olyan tranzakciók, amelyek esetében a lejárat időpont legfeljebb 397 nappal későbbi, mint az elszámolási nap), egyéb monetáris pénzügyi intézményektől (MPI-k), egyéb pénzügyi közvetítőktől (EPK-k), biztosítóktól, nyugdíjpénztáraktól, a kormányzattól vagy befektetési célra központi bankoktól, valamint a Basel III LCR keret alapján »wholesale«-ként besorolt nem pénzügyi vállalatoktól történő hitelfelvétel.
 - b) az egyéb hitelintézetek részére történő, legfeljebb egy éves futamidejű (olyan tranzakciók, amelyek esetében a lejárat időpont legfeljebb 397 nappal későbbi, mint az elszámolási nap), fedezetlen betéteken illetve call számlákon keresztül vagy kereskedelmi értékpapírok, letéti jegyek, változó kamatozású értékpapírok és egyéb, legfeljebb egy éves futamidejű hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok a kibocsátó hitelintézettől történő vásárlásán keresztül történő minden hitelnújtás.
2. Az alábbi táblázat tartalmazza az azon tranzakciókra vonatkozó instrumentumkategóriák részletes standard leírását, amelyeket az adatszolgáltatóknak jelenteniük kell az EKB-nak. Abban az esetben, ha az adatszolgáltatóknak a tranzakciókat NKB-jüknek kell jelenteniük, az érintett NKB-nak nemzeti szinten e rendelettel összhangban át kell ültetnie az instrumentumkategóriák ezen leírásait.

Instrumentumtípus	Leírás
Deposits (Betétek)	Fedezetlen, kamatozó betétek (ideértve a call számlákat, de ide nem értve a folyószámlákat), amelyek vagy felmondással visszaválthatók, vagy legfeljebb egy éves futamidejűek, és amelyeket az adatszolgáltató fogad (kölcsonfelvétel) vagy elhelyez.
Call accounts (call számlák)	Naponta változó kamatozású olyan készpénzszámla, amely rendszeresen lehetővé teszi a kamatfizetést vagy a kamatszámítást, és amelyről felmondási idővel vehető fel pénz.
Certificate of deposit (Letéti jegy)	Az MPI által kibocsátott olyan rögzített kamatozású hitelviszonyt megtestesítő értékpapír, amely tulajdonosát egy meghatározott mértékű rögzített kamatra jogosítja fel egy meghatározott, legfeljebb egy éves időszak alatt.
Commercial paper (Kereskedelmi értékpapír)	Olyan hitelviszonyt megtestesítő értékpapír, amely vagy fedezetlen, vagy a kibocsátó által nyújtott fedezettel biztosított, legfeljebb egy éves futamidejű, valamint kamatozó vagy diszkontált.
Floating rate note (Változó kamatozású értékpapír)	Olyan hitelviszonyt megtestesítő értékpapír, amely esetében az időszakos kamatfizetéseket az előre meghatározott napokon (a kamatrögzítés napján) fennálló érték alapján számítják, vagyis egy alapul szolgáló referencia-kamatláb, például az Euribor meghatározásával, és amely legfeljebb egy éves futamidejű.

Instrumentumtípus	Leírás
Other short-term debt securities (Egyéb rövid lejáratú, hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok)	<p>Az adatszolgáltatók által kibocsátott, legfeljebb egy éves futamidejű, a tulajdoni részesedéstől eltérő, nem alárendelt értékpapírok, amelyek általában átruházható instrumentumok, és amelyekkel másodlagos piacokon kereskednek vagy velük ellenirányú ügylet köthető a piacon, és amelyek tulajdonosuknak nem biztosítanak tulajdonjogot az azt kibocsátó intézményben. Ez a tétel magában foglalja:</p> <p>a) az olyan értékpapírokat, amelyek tulajdonosuknak feltétlen jogot biztosítanak valamilyen rögzített vagy szerződésben meghatározott, kamatszelvény révén hozzáférhető jövedelemre és/vagy egy megállapított rögzített összegre, amely meghatározott napon (napokon), illetve a kibocsátáskor meghatározott dátumtól kezdődően jár;</p> <p>b) az adatszolgáltatók által kibocsátott, át nem ruházható instrumentumokat, amelyek később átruházhatóvá válnak és átminősítésre kerülnek »hitelviszonyt megtestesítő értékpapírrá«.</p>

2. a II. mellékletben az 1. rész helyébe a következő szöveg lép:

„I. RÉSZ

INSTRUMENTUMOK TÍPUSA

Az adatszolgáltatók a következőket jelentik az Európai Központi Bank (EKB) vagy az érintett nemzeti központi bank (NKB) felé:

- a) az adatszolgáltató által az alábbi táblázatban meghatározott valamennyi instrumentum felhasználásával történő, euróban denominált és legfeljebb egy éves futamidejű (azaz olyan tranzakciók, amelyek esetében a lejárat időpont legfeljebb 397 nappal későbbi, mint az azonnali (spot) devizaswapügylet azonnali lábának elszámolási napja), az egyéb monetáris pénzügyi intézmények (MPI-k) és egyéb pénzügyi közvetítők (EPK-k), biztosítók, nyugdíjpénztárak, kormányzat vagy befektetési célra központi bankok között, valamint a Basel III LCR keret alapján »wholesale«-ként besorolt nem pénzügyi vállalatokkal kötött valamennyi olyan devizaswap ügylet, amely során azonnali jelleggel eurót vesznek/adnak el külföldi deviza ellenében, és azt előre megállapodott határidős devizaárfolyamon egy későbbi időpontban újból értékesítik vagy újból megvásárolják;
- b) az adatszolgáltató és egyéb monetáris pénzügyi intézmények (MPI-k), EPK-k, biztosítók, nyugdíjpénztárak, a kormányzat vagy befektetési célra központi bankok, valamint a Basel III LCR keret alapján »wholesale«-ként besorolt nem pénzügyi vállalatok közötti, euróban denominált overnight index swap tranzakciók.”

3. a II. mellékletben a 2. rész 1. bekezdése helyébe a következő szöveg lép:

„Mező	Adatok leírása	Alternatív adatszolgáltatási lehetőség (amennyiben van) és egyéb minősítések
Transaction identifier (Tranzakciós azonosító)	Az adatszolgáltató által minden egyes tranzakcióra vonatkozóan használt belső egyedi tranzakciós azonosító.	A tranzakciós azonosító egy adott adatszolgáltatási időpontban bármely pénzügyi szegmensre vonatkozóan jelentett bármely tranzakcióra nézve egyedi.
Reporting date (Adatszolgáltatás napja)	Az a nap, amikor az adatokat benyújtják az EKB-hoz vagy az NKB-hoz.	
Electronic time stamp (Elektronikus időbélyegző)	Az az időpont, amikor a tranzakciót megkötik vagy elkönnyvelik.	

„Mező	Adatok leírása	Alternatív adatszolgáltatási lehetőség (amennyiben van) és egyéb minősítések
Counterparty code (Szerződő fél kódja)	A jelentett tranzakcióban az adatszolgáltató szerződő partnerének felismerése érdekében használandó azonosító kód.	Amennyiben a tranzakciókat központi szerződő félen keresztül bonyolítják, annak jogalany-azonosítóját meg kell adni. Amennyiben a tranzakciókat nem pénzügyi vállalatokkal, EPK-kal, biztosítókkal, nyugdíjpénztárakkal, a kormányzattal vagy központi bankokkal bonyolítják, valamint minden egyéb jelentett tranzakció esetében, amelyre vonatkozóan a szerződő fél jogalany-azonosítóját nem adják meg, a szerződő fél osztályát meg kell adni.
Counterparty code ID (Szerződő fél kódjának azonosítója)	A szerződő fél továbbított egyedi kódjának típusát meghatározó attribútum.	Minden körülmények között használandó. A szerződő fél egyedi kódja megadásra kerül.
Counterparty location (Szerződő fél helye)	Azon ország Nemzetközi Szabványügyi Szervezet (ISO) szerinti országkódja, ahol a szerződő felet bejegyezték.	Kötelező, ha a szerződő fél egyedi kódját nem adják meg. Egyébként választható.
Trade date (Kötési időpont)	Az a nap, amikor a felek megkötik a jelentett pénzügyi tranzakciót.	
Spot value date (Azonnali értéknap)	Az a nap, amikor az egyik fél eladja a másiknak egy meghatározott deviza meghatározott összegét, egy meghatározott eltérő deviza megállapodott összege megfizetése ellenében, egy megállapodott átváltási árfolyam mellett, amelyet azonnali átváltási árfolyamnak neveznek.	
Maturity date (Lejárat időpontja)	Az a nap, amikor a devizaswapügylet lejár, és az azonnali értéknapon eladott devizát visszavásárolják.	
Transaction sign (Tranzakció előjele)	Annak azonosítására szolgál, hogy a tranzakció nominális összege alatt jelentett euro összeget az azonnali értéknapon veszik vagy eladják-e.	Ennek euróra vonatkozó azonnali ügyletre kell utalnia, vagyis, hogy az azonnali értéknapot eurót vesznek vagy eladnak-e.
Transaction nominal amount (Tranzakció nominális összege)	Az azonnali értéknapon vett vagy eladott euro összege.	
Foreign currency code (Külföldi deviza kódja)	Az euro ellenében vett/eladott deviza nemzetközi háromjegyű ISO-kódja.	

„Mező	Adatok leírása	Alternatív adatszolgáltatási lehetőség (amennyiben van) és egyéb minősítések
Foreign exchange spot rate (Azonnal átváltási árfolyam)	Az euro és a külföldi deviza közötti átváltási árfolyam, amely a devizaswapügylet azonnali lábára alkalmazandó.	
Foreign exchange forward points (Határidős átváltás pontok)	Az azonnali átváltási árfolyam és a határidős átváltási árfolyam közötti különbség bázispontban kifejezve, az adott devizapárra vonatkozó piaci konvencióknak megfelelően jegyezve.”	