

**EUROPOS CENTRINIO BANKO REGLAMENTAS (ES) 2015/1599****2015 m. rugsėjo 10 d.****kuriuo iš dalies keičiamas Reglamentas (ES) Nr. 1333/2014 dėl pinigų rinkos statistikos (ECB/2015/30)**

EUROPOS CENTRINIO BANKO VALDANČIOJI TARYBA,

atsižvelgdama į Europos centrinių bankų sistemos ir Europos Centrinio Banko statutą, ypač į jo 5 straipsnį,

atsižvelgdama į 1998 m. lapkričio 23 d. Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2533/98 dėl Europos Centrinio Banko renkamos statistinės informacijos <sup>(1)</sup>, ypač į jo 5 straipsnio 1 dalį ir 6 straipsnio 4 dalį,

kadangi:

- (1) pagal Europos Centrinio Banko reglamentą (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) <sup>(2)</sup> atskaitingieji agentai turi teikti statistinę informaciją, kad Europos centrinių bankų sistema, vykdydama savo uždavinius, galėtų rengti pinigų rinkos sandorių statistiką;
- (2) nacionaliniams centriniams bankams bus pateiktas atskaitomybės nurodymų rinkinys, nustatantis išsamias statistinės informacijos teikimo pagal Reglamentą (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) taisykles. Kadangi atskaitomybės nurodymuose išsamiau apibūdinama nemažai svarbių tame reglamente nustatytų terminų, siekiant suderinamumo tai turi būti atspindėta ir reglamente;
- (3) todėl reikėtų atitinkamai iš dalies pakeisti Reglamentą (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48),

PRIĖMĖ ŠĮ REGLAMENTĄ:

*1 straipsnis***Daliniai pakeitimai**

1. Reglamento (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) I priedas pakeičiamas šio reglamento I priedu.
2. Reglamento (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) II ir III priedai iš dalies keičiami pagal šio reglamento II priedą.

*2 straipsnis***Baigiamosios nuostatos**Šis reglamentas įsigalioja dvidešimtą dieną po jo paskelbimo *Europos Sąjungos oficialiajame leidinyje*.

Šis reglamentas pagal Sutartis privalomas visas ir tiesiogiai taikomas valstybėse narėse.

Priimta Frankfurte prie Maino 2015 m. rugsėjo 10 d.

*ECB valdančiosios tarybos vardu**ECB Pirmininkas*

Mario DRAGHI

<sup>(1)</sup> OLL 318, 1998 11 27, p. 8.<sup>(2)</sup> 2014 m. lapkričio 26 d. Europos Centrinio Banko reglamentas (ES) Nr. 1333/2014 dėl pinigų rinkos statistikos (ECB/2014/48) (OLL 359, 2014 12 16, p. 97).

## I PRIEDAS

## „I PRIEDAS

**Su užtikrintais sandoriais susijusios pinigų rinkos statistikos teikimo sistema**

## 1 DALIS

**PRIEMONIŲ TIPAS**

Atskaitingieji agentai Europos Centriniam Bankui (ECB) ar atitinkamam nacionaliniam centriniam bankui (NCB) teikia duomenis apie visas atpirkimo sutartis ir sandorius, sudarytus jų pagrindu, įskaitant trišalius atpirkimo sandorius eurais, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų (apibrėžiami kaip sandoriai, kurių išpirkimo terminas neviršija 397 dienų nuo atsiskaitymo dienos), kuriuos sudaro atskaitingasis agentas ir kitos pinigų finansų įstaigos (PFI), kiti finansų tarpininkai (KFT), draudimo bendrovės, pensijų fondai, valdžios sektorius ar centriniai bankai investicijų tikslais, taip pat ne finansų bendrovės, priskiriamos „didmeninėms“ pagal Bazelio III PLTR sistemą.

## 2 DALIS

**DUOMENŲ TIPAS****1. Sandoriais pagrįstų duomenų <sup>(1)</sup>, kuriuos reikia pateikti apie kiekvieną sandorį, tipas:**

Laukas	Duomenų aprašas	Alternatyvaus duomenų teikimo galimybė (jei yra) ir kiti požymiai
Sandorio identifikatorius	Unikalus vidaus sandorio identifikatorius, kurį atskaitingasis agentas naudoja su kiekvienu sandoriu.	Sandorio identifikatorius yra unikalus bet kokiam sandoriui, apie kurį duomenys teikiami konkrečią ataskaitinę dieną bet kurio pinigų rinkos segmento atveju.
Ataskaitinė data	Data, kurią duomenys pateikiami ECB ar NCB.	
Elektroninė laiko žyma	Sandorio sudarymo ar registravimo laikas.	
Atitiktinės šalies kodas	Identifikavimo kodas, pagal kurį atpažįstama atskaitingojo agento atitiktinė šalis sandorio, apie kurį teikiami duomenys, atžvilgiu.	Jei sandoriai sudaromi per pagrindinę atsiskaitymo šalį (PAŠ), būtina nurodyti PAŠ juridinio asmens identifikatorių (JAI). Jei sandoriai sudaromi su ne finansų bendrovėmis, KFT, draudimo bendrovėmis, pensijų fondais, valdžios sektoriumi ir centriniais bankais, taip pat kai sudaromi bet kurie kiti sandoriai, apie kuriuos teikiami duomenys, nurodant atitiktinės šalies JAI, būtina nurodyti atitiktinės šalies klasę.
Atitiktinės šalies kodo Nr.	Požymis, nurodantis perduodamo atskiros atitiktinės šalies kodo tipą.	Naudotinas bet kokiomis aplinkybėmis. Nurodomas atskiros atitiktinės šalies kodas.

<sup>(1)</sup> Elektroniniai atskaitomybės standartai ir duomenų techninės specifikacijos yra nustatyti atskirai. Jie pateikiami adresu: [www.ecb.int](http://www.ecb.int).

Laukas	Duomenų aprašas	Alternatyvaus duomenų teikimo galimybė (jei yra) ir kiti požymiai
Atitiktinės šalies buvimo vieta	Tarptautinės standartizacijos organizacijos (TSO) šalies, kurioje įsteigta atitiktinė šalis, kodas.	Privaloma, jei atskiros atitiktinės šalies kodas nenurodytas. Kitais atvejais neprivaloma.
Nominali sandorio vertė	Pirminė pasiskolinta ar paskolinta suma.	
Nominali įkaito vertė	Vertybinio popieriaus, įkeisto įkaitu, nominali vertė.	Išskyrus trišalius atpirkimo sandorius ir bet kuruos kitus sandorius, kuriuose įkeistas vertybinis popierius nėra identifikuojamas vieningu tarptautiniu vertybinių popierių identifikavimo numeriu (ISIN).
Prekybos diena	Diena, kurią šalys sudaro finansinį sandorį.	
Atsiskaitymo diena	Pirkimo diena, t. y. diena, kurią paskolos davėjas privalo sumokėti grynuosius pinigus paskolos gavėjui, o paskolos gavėjas privalo perleisti įkaitą paskolos davėjui.	Atviro pagrindo atpirkimo sandorių atveju tai yra diena, kurią pratęsiamas terminas (net jei gryųjų pinigų mainai nevyksta).
Išpirkimo terminas	Atpirkimo diena, t. y. diena, kurią paskolos gavėjas privalo grąžinti grynuosius pinigus paskolos davėjui.	Atviro pagrindo atpirkimo sandorių atveju tai yra diena, kurią turi būti grąžinta pagrindinė paskolos dalis ir palūkanos, jei sandorio terminas toliau nepratęsiamas.
Sandorio žyma	Gryųjų pinigų skolinimasis atpirkimo sandorių atveju ar gryųjų pinigų skolinimas atvirkštinių atpirkimo sandorių atveju.	
Įkaito ISIN	Finansų rinkose išleistiems vertybiniais popieriais priskirtas ISIN, kurį sudaro 12 raidinių skaitmeninių simbolių, unikalai identifikuojančių vertybinių popierių (kaip apibrėžta ISO 6166).	Turi būti nurodytas, išskyrus tam tikras įkaito rūšis.
Įkaito tipas	Naudojamas turto klasei, įkeistai įkaitu, identifikuoti, jei atskiras ISIN nenurodytas.	Turi būti nurodytas visada, išskyrus atvejus, kai atskiras ISIN nenurodytas.
Įkaito emitento sektorius	Naudojamas įkaito emitento sektoriui identifikuoti, jei atskiras ISIN nenurodytas.	Turi būti nurodytas kai atskiras ISIN nenurodytas.
Speciali įkaito žyma	Naudojama visiems atpirkimo sandoriams, sudarytiems pateikus bendrąjį įkaitą, ir sandoriams, sudarytiems pateikus specialųjį įkaitą, identifikuoti. Laukas neprivalomas; duomenis reikia pateikti tik tada, jei atskaitingasis agentas gali tai padaryti.	Šio lauko duomenų teikti neprivaloma.

Laukas	Duomenų aprašas	Alternatyvaus duomenų teikimo galimybė (jei yra) ir kiti požymiai
Sandorio palūkanų norma	Palūkanų norma, išreikšta pagal ACT/360 pinigų rinkos taisyklę, kuria buvo sudarytas atpirkimo sandoris, ir kuria atsiyginama už paskolintus grynuosius pinigus.	
Įkaičio įvertinimas mažesnei rinkos verte	Rizikos valdymo priemonė, taikoma pagrindiniam įkaičiui, pagal kurią to pagrindinio įkaičio vertė apskaičiuojama kaip turto rinkos vertė, sumažinta tam tikra procentine išraiška (įvertinimas mažesnei rinkos verte). Duomenų teikimo tikslais įkaičio įvertinimas mažesnei rinkos verte apskaičiuojamas iš 100 atimant paskolintų (pasiskolintų) grynujų pinigų ir rinkos vertės santykį, įskaitant įkeisto įkaičio sukauptas palūkanas.	Šio lauko duomenis teikti reikalaujama tik apie sandorius su vienu įkaičiu.
Trišalio agento atitiktinės šalies kodas	Trišalio agento atitiktinės šalies kodo identifikatorius.	Turi būti pateiktas trišalių atpirkimo sandorių atveju.
Trišalio agento kodo Nr.	Požymis, nurodantis perduodamo atskiro atitiktinės šalies kodo tipą.	Naudotinas visais atvejais, kai nurodomas atskiro trišalio agento kodas.

## 2. Reikšmingumo riba

Duomenis apie sandorius, sudarytus su ne finansų bendrovėmis, reikėtų teikti tik tuomet, jei šie sandoriai yra sudaryti su ne finansų bendrovėmis, priskiriamomis didmeninėms remiantis Bazelio III PLTR sistema <sup>(1)</sup>.

## 3. Išimtis

Duomenų nereikėtų teikti apie grupės vidaus sandorius.“

<sup>(1)</sup> Žr. „Bazelis III: padengimo likvidžiuoju turtu rodiklis ir likvidumo rizikos stebėsenos priemonės“ (*Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools*), Bazelio bankų priežiūros komitetas, 2013 m. sausis, p. 23–27, pateikiama Tarptautinių atsiskaitymų banko interneto svetainėje: [www.bis.org](http://www.bis.org).

## II PRIEDAS

Reglamento (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) II ir III priedai iš dalies keičiami taip:

1. II priedo 1 dalis pakeičiama taip:

„1 DALIS

## PRIEMONIŲ TIPAS

1. Atskaitingieji agentai Europos Centriniam Bankui (ECB) arba atitinkamam nacionaliniam centriniam bankui (NCB) teikia:
  - a) duomenis apie visas paskolas, pasitelkiant toliau esančioje lentelėje apibrėžtas priemones eurais, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų (apibrėžiamos kaip sandoriai, kurių išpirkimo terminas neviršija 397 dienų nuo atsiskaitymo dienos), kurias atskaitingasis agentas gauna iš kitų pinigų finansų įstaigų (PFĮ), kitų finansų tarpininkų (KFT), draudimo bendrovių, pensijų fondų, valdžios sektoriaus ar centrinių bankų investicijų tikslais, taip pat ne finansų bendrovių, priskiriamos „didmeninėms“ pagal Bazelio III PLTR sistemą;
  - b) duomenis apie visas paskolas, suteiktas kitoms kredito įstaigoms, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų (apibrėžiamos kaip sandoriai, kurių išpirkimo terminas neviršija 397 dienų nuo atsiskaitymo dienos), pasitelkiant neužtikrintus indėlius arba pareikalavimo sąskaitas, arba iš kredito įstaigų emitentų išsigyjant komercinius vekselius, indėlių sertifikatus, kintamos palūkanų normos obligacijas ir kitus skolos vertybinius popierius, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų.
2. Šioje lentelėje pateikiamas išsamus standartinis priemonių kategorijų aprašas, taikomas sandoriams, kurių duomenis atskaitingieji agentai privalo teikti ECB. Jei atskaitingieji agentai privalo teikti sandorių duomenis savo NCB, atitinkamas NCB turėtų perkelti šiuos priemonių kategorijų aprašus į nacionalinį lygmenį pagal šį Reglamentą.

Priemonės tipas	Aprašas
Indėliai (Deposits)	Neužtikrinti indėliai, už kuriuos skaičiuojamos palūkanos (įskaitant pareikalavimo sąskaitas, tačiau neįtraukiant einamųjų sąskaitų), išperkami iš anksto pranešus ar kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų; šiuos indėlius priima (skolindamasis) arba pateikia atskaitingasis agentas.
Pareikalavimo sąskaitos (Call accounts)	Piniginių lėšų sąskaitos, kurių atžvilgiu taikytina palūkanų norma kasdien keičiasi, dėl to palūkanos išmokamos arba apskaičiuojamos reguliariais intervalais, taip pat yra išpėjamas laikotarpis norint išsiimti pinigų.
Indėlio sertifikatas (Certificate of deposit)	PFĮ išleista terminuota skolos priemonė, suteikianti jos turėtojui teisę į konkrečią fiksuotą palūkanų normą apibrėžtu fiksuotu laikotarpiu, neviršijančiu vienerių metų.
Komercinis vekselis (Commercial paper)	Neužtikrinta arba emitento įkaitu paremta skolos priemonė, kurios išpirkimo terminas neviršija vienerių metų; už šias priemones skaičiuojamos palūkanos arba priemonės yra diskontuotos.
Kintamos palūkanų normos obligacija (Floating rate note)	Skolos priemonė, kurios periodiniai palūkanų mokėjimai apskaičiuojami pagal vertę, t. y. nustatant pagrindinę atskaitinę palūkanų normą, pavyzdžiui, Euribor iš anksto nustatytais dienomis, vadinamomis nustatymo dienomis, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų.

Priemonės tipas	Aprašas
Kiti trumpalaikiai skolos vertybiniai popieriai <i>(Other short-term debt securities)</i>	Nesubordinuotieji vertybiniai popieriai, išskyrus nuosavybės priemones, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų, kuriuos išleidžia atskaitingieji agentai; šios priemonės paprastai yra perleidžiamosios ir jomis prekiaujama antrinėse rinkose, arba jos užskaitomos rinkoje ir nesuteikia jų turėtoji jokių nuosavybės teisių įstaigos emitentės atžvilgiu. Šis straipsnis apima: <ol style="list-style-type: none"> <li>vertybinius popierius, suteikiančius jų turėtoji besąlygišką teisę gauti fiksuotas ar sutartyje nustatytas pajamas atkarpos mokėjimų ir (arba) nurodytos fiksuotos sumos forma konkrečią dieną (ar dienas) arba nuo emisijos momentu apibrėžtos dienos;</li> <li>neperleidžiamas atskaitingųjų agentų išleistas priemones, kurios vėliau tampa perleidžiamomis ir iš naujo priskiriamos „skolos vertybiniais popieriais“.</li> </ol>

2. III priedo 1 dalis pakeičiama taip:

„1 DALIS

#### PRIEMONIŲ TIPAS

Atskaitingieji agentai Europos Centriniam Bankui (ECB) arba atitinkamam nacionaliniam centriniam bankui (NCB) teikia:

- duomenis apie visus užsienio valiutos keitimo apskaitavimo sandorius, kuriais eurai yra perkami ar parduodami neatidėliotinai už užsienio valiutą ir perparduodami ar perperkami dieną ateityje už iš anksto sutartą užsienio valiutos keitimo išankstinę palūkanų normą, kurių išpirkimo terminas neviršija vienerių metų (apibrėžiami kaip sandoriai, kurių išpirkimo terminas neviršija 397 dienų nuo neatidėliotino užsienio valiutos keitimo apskaitavimo sandorio dalies atsiskaitymo dienos), kuriuos sudaro atskaitingasis agentas ir kitos pinigų finansų įstaigos (PFI), kiti finansų tarpininkai (KFT), draudimo bendrovės, pensijų fondai, valdžios sektorius ar centriniai bankai investicijų tikslais, taip pat ne finansų bendrovės, priskiriamos „didmeninėms“ pagal Bazelio III PLTR sistemą;
- duomenis apie vienos nakties indeksų apskaitavimo sandorius (VNIAS) eurai, kuriuos sudaro atskaitingasis agentas ir kitos pinigų finansų įstaigos (PFI), kiti finansų tarpininkai (KFT), draudimo bendrovės, pensijų fondai, valdžios sektorius ar centriniai bankai investicijų tikslais, taip pat ne finansų bendrovės, priskiriamos „didmeninėms“ pagal Bazelio III PLTR sistemą.

3. III priedo 2 dalies 1 punkto lentelė pakeičiama taip:

„Laukas	Duomenų aprašas	Alternatyvaus duomenų teikimo galimybė (jei yra) ir kiti požymiai
Sandorio identifikatorius <i>(Transaction identifier)</i>	Unikalus vidaus sandorio identifikatorius, kurį atskaitingasis agentas naudoja su kiekvienu sandoriu.	Sandorio identifikatorius yra unikalus bet kokiam sandoriui, apie kurį duomenys teikiami konkrečią atskaitinę dieną bet kurio pinigų rinkos segmento atveju.
Atskaitinė data <i>(Reporting date)</i>	Data, kurią duomenys pateikiami ECB ar NCB.	
Elektroninė laiko žyma <i>(Electronic time stamp)</i>	Sandorio sudarymo ar registravimo laikas.	

„Laukas	Duomenų aprašas	Alternatyvaus duomenų teikimo galimybė (jei yra) ir kiti požymiai
Atitiktinės šalies kodas ( <i>Counterparty code</i> )	Identifikavimo kodas, pagal kurį atpažįstama atskaitingojo agento atitiktinė šalis sandorio, apie kurį teikiami duomenys, atžvilgiu.	Jei sandoriai sudaromi per pagrindinę atskaitymo šalį (PAŠ), būtina nurodyti PAŠ juridinio asmens identifikatorių (JAI).  Jei sandoriai sudaromi su ne finansų bendrovėmis, KFT, draudimo bendrovėmis, pensijų fondais, valdžios sektoriumi ir centriniais bankais, taip pat kai sudaromi bet kurie kiti sandoriai, apie kuriuos teikiami duomenys, nenurodant atitiktinės šalies JAI, būtina nurodyti atitiktinės šalies klasę.
Atitiktinės šalies kodo Nr. ( <i>Counterparty code ID</i> )	Požymis, nurodantis perduodamo atskiros atitiktinės šalies kodo tipą.	Naudotinas bet kokiomis aplinkybėmis. Nurodomas atskiros atitiktinės šalies kodas.
Atitiktinės šalies buvimo vieta ( <i>Counterparty location</i> )	Tarptautinės standartizacijos organizacijos (TSO) šalies, kurioje įsteigta atitiktinė šalis, kodas.	Privaloma, jei atskiros atitiktinės šalies kodas nenurodytas. Kitais atvejais neprivaloma.
Prekybos diena ( <i>Trade date</i> )	Diena, kurią šalys sudaro finansinį sandorį, apie kurį teikiami duomenys.	
Neatidėliotino įskaitymo diena ( <i>Spot value date</i> )	Diena, kai viena šalis parduoda kitai šaliai nustatytą sumą nustatyta valiuta mainais už sutartos sumos nustatyta skirtinga užsienio valiuta mokėjimą, remiantis sutarta užsienio valiutos keitimo norma, vadinama neatidėliotina užsienio valiutos keitimo norma.	
Išpirkimo terminas ( <i>Maturity date</i> )	Diena, kurią pasibaigia užsienio valiutos keitimo apsikeitimo sandoris, o užsienio valiuta, parduota neatidėliotino įskaitymo dieną, atperkama.	
Sandorio ženklas ( <i>Transaction sign</i> )	Naudojamas nustatant, ar suma eurais, nurodoma ties nominalia sandorio verte, perkama ar parduodama neatidėliotino įskaitymo dieną.	Šis ženklas turėtų nurodyti euro įskaitymą, t. y. ar euro perkamas ar parduodamas neatidėliotino įskaitymo dieną.
Sandorio nominali vertė ( <i>Transaction nominal amount</i> )	Euro suma, perkama ar parduodama neatidėliotino įskaitymo dieną.	
Užsienio valiutos kodas ( <i>Foreign currency code</i> )	Tarptautinis trijų skaitmenų TSO valiutos, perkamos ar parduodamos už euro, kodas.	

„Laukas	Duomenų aprašas	Alternatyvaus duomenų teikimo galimybė (jei yra) ir kiti požymiai
Užsienio valiutos keitimo neatidėliotinas kursas ( <i>Foreign exchange spot rate</i> )	Euro ir užsienio valiutos keitimo kursas, taikomas neatidėliotinai užsienio valiutos keitimo apsisiekimo sandorio daliai.	
Užsienio valiutos keitimo išankstiniai taškai ( <i>Foreign exchange forward points</i> )	Neatidėliotino užsienio valiutos keitimo kurso ir užsienio valiutos išankstinio keitimo kurso skirtumas, reiškiamas baziniais taškais, nurodomais pagal galiojančias užsienio valiutos poros rinkos taisykles.“	