

EIROPAS CENTRĀLĀS BANKAS REGULA (ES) 2015/1599
(2015. gada 10. septembris),
ar ko groza Regulu (ES) Nr. 1333/2014 par naudas tirgu statistiku (ECB/2015/30)

EIROPAS CENTRĀLĀS BANKAS PADOME,

ņemot vērā Eiropas Centrālo banku sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtus un jo īpaši to 5. pantu,

ņemot vērā Padomes Regulu (EK) Nr. 2533/98 (1998. gada 23. novembris) par statistikas informācijas vākšanu, ko veic Eiropas Centrālā banka ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 5. panta 1. punktu un 6. panta 4. punktu,

tā kā:

- (1) Eiropas Centrālās bankas Regula (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) ⁽²⁾ prasa pārskatu sniedzējiem sniegt statistiskos datus, lai Eiropas Centrālo banku sistēma, pildot savus uzdevumus, varētu sagatavot statistiku par naudas tirgus darījumiem.
- (2) Nacionālās centrālās bankas noteiks pārskatu sniegšanas norādījumu kopumu, kurā izklāstīti sīki izstrādāti parametri statistiskās informācijas sniegšanai saskaņā ar Regulu (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48). Tā kā pārskatu sniegšanas norādījumi precīzē virkni nozīmīgu minētajā regulā atrodamo terminu, saskaņotības dēļ šīs izmaiņas jāatspoguļo arī regulā.
- (3) Tādēļ attiecīgi jāgroza Regula (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48),

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Grozījumi

1. Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) I pielikumu aizstāj ar šīs regulas I pielikumu.
2. Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) II un III pielikumu groza saskaņā ar šīs regulas II pielikumu.

2. pants

Nobeiguma noteikums

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas *Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī*.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama dalībvalstīs saskaņā ar Līgumiem.

Frankfurtē pie Mainas, 2015. gada 10. septembrī

ECB Padomes vārdā –
ECB priekšsēdētājs
Mario DRAGHI

⁽¹⁾ OV L 318, 27.11.1998., 8. lpp.

⁽²⁾ Eiropas Centrālās bankas Regula (ES) Nr. 1333/2014 (2014. gada 26. novembris) par naudas tirgu statistiku (ECB/2014/48) (OV L 359, 16.12.2014., 97. lpp.).

I PIELIKUMS

"I PIELIKUMS

Nodrošinātu darījumu naudas tirgus statistikas pārskatu sniegšanas sistēma

1. DAĻA

INSTRUMENTU VEIDI

Pārskatu sniedzēji sniedz datus Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) par visiem euro repo līgumiem un saskaņā ar tiem slēgtajiem darījumiem, t. sk. trīs pušu repo darījumiem, ar termiņu līdz vienam gadam ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc norēķinu datuma), kas noslēgti starp pārskatu sniedzēju un citām monetārajām finanšu iestādēm (MFI), citiem finanšu starpniekiem (CFS), apdrošināšanas sabiedrībām, pensiju fondiem, valdību vai centrālajām bankām ieguldījumu mērķiem, kā arī ar nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu.

2. DAĻA

DATU VEIDS

1. Darījuma datu veidi ⁽¹⁾, kas jānorāda par katru darījumu

Datu lauks	Datu apraksts	Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi
Darījuma identifikators	Pārskatu sniedzēja katram darījumam izmantotais iekšējais unikālais darījuma identifikators.	Darījuma identifikators ir unikāls katram sniegtajam darījumam noteiktā pārskata dienā jebkurā naudas tirgus segmentā.
Pārskata sniegšanas datums	Datums, kurā dati tiek sniegti ECB vai NCB.	
Elektronisks laika zīmogs	Laiks, kurā veikts vai iegrāmatots darījums.	
Darījuma partnera kods	Identifikācijas kods, pēc kura atpazīst pārskatu sniedzēja darījuma partneri ziņotajā darījumā.	Ja darījumi tiek veikti, izmantojot centrālo kliringa darījuma partneri (KDP), jānorāda KDP juridiskās personas identifikators (JPI). Ja darījumi tiek veikti ar nefinanšu sabiedrībām, CFS, apdrošināšanas sabiedrībām, pensiju fondiem, valdību un centrālajām bankām, kā arī ziņojot par jebkuru citu darījumu, kurā netiek sniegts darījuma partnera JPI, norāda darījuma partnera klasi.
Darījuma partnera ID kods	Raksturlielums, kurš norāda ziņotā individuālā darījuma partnera veidu.	Jāizmanto visos gadījumos. Tiksniegts individuāls darījuma partnera kods.

⁽¹⁾ Datu elektroniskās sniegšanas standarti un tehniskās specifikācijas noteiktas atsevišķi. Tie pieejami ECB tīmekļa vietnē www.ecb.europa.eu.

Datu lauks	Datu apraksts	Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi
Darījuma partnera atrašanās vieta	Valsts, kurā reģistrēts darījuma partneris, Starptautiskās Standartizācijas organizācijas (ISO) valsts kods.	Obligāts tad, ja nav norādīts individuālais darījuma partnera kods. Pārējos gadījumos – pēc izvēles.
Darījuma nominālvērtība	Sākotnēji aizņemtā vai aizdotā summa.	
Nodrošinājuma nominālvērtība	Vērtspapīra, kas iekļāts kā nodrošinājums, nominālvērtība.	Izņemot trīs pušu repo un citus darījumus, kuros iekļātais vērtspapīrs netiek identificēts, izmantojot vienotu starptautisko vērtspapīru identifikācijas numuru (<i>International Securities Identification Number – ISIN</i>).
Darījuma datums	Datums, kurā puses veic finanšu darījumu.	
Norēķinu datums	Pirkšanas datums, t. i., datums, kurā aizdevējam jāizmaksā aizņēmējam nauda un aizņēmējam jāpārved aizdevējam nodrošinājums.	Atvērto repo darījumu gadījumā šis ir datums, kurā notiek pārjaunojuma norēķins (pat tad, ja nenotiek naudas nodošana).
Termiņa beigu datums	Atpirkšanas datums, t. i., datums, kurā aizņēmējam jāatmaksā aizdevējam nauda.	Atvērto repo darījumu gadījumā šis ir datums, kurā jāatmaksā pamatsumma un procenti, ja darījums netiek pārjaunots.
Darījuma apzīmējums	Naudas aizņemšanās repo gadījumā vai naudas aizdošana reversā repo gadījumā.	
Nodrošinājuma ISIN	Finanšu tirgos emitētiem vērtspapīriem piešķirts ISIN, kas sastāv no 12 burtiem un cipariem un kas ir unikāls katram vērtspapīram (kā definēts ISO 6166).	Jāsniedz visos gadījumos, izņemot dažus nodrošinājuma veidus.
Nodrošinājuma veids	Lai identificētu aktīva klasi, kas iekļāts kā nodrošinājums, ja netiek sniegts individuāls ISIN.	Jānorāda visos gadījumos, kuros netiek sniegts individuāls ISIN.
Nodrošinājuma emitenta sektors	Lai identificētu nodrošinājuma emitenta sektoru, ja netiek sniegts individuāls ISIN.	Jānorāda, ja netiek sniegts individuāls ISIN.
Īpaša nodrošinājuma atzīme	Lai identificētu visus repo darījumus, kas veikti ar parastu nodrošinājumu, un darījumus, kas veikti ar īpašu nodrošinājumu. Izvēles lauks, kurā informācija jāsniedz tikai tad, ja pārskatu sniedzējam ir tāda iespēja.	Informāciju šajā laukā sniedz pēc izvēles.

Datu lauks	Datu apraksts	Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi
Darījuma procentu likme	Saskaņā ar faktiskais dienu skaits/360 naudas tirgus principu izteikta procentu likme, ar kuru noslēgts repo darījums un ar kuru tiek maksāti procenti par aizdoto naudu.	
Nodrošinājuma diskonts	Riska kontroles pasākums, kas tiek piemērots sniegtajam nodrošinājumam, nodrošinājuma vērtību aprēķinot kā aktīvu tirgus vērtību, kas samazināta par noteiktu procentuālo daļu (diskontu). Pārskatu sniegšanas mērķiem datus par nodrošinājuma diskontu sniedz, no 100 atņemot aizdotās/aizņemtās naudas un iekļātā nodrošinājuma tirgus vērtības, t. sk. uzkrāto procentu, attiecību.	Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par atsevišķiem nodrošinājuma darījumiem.
Trīs pušu darījuma aģenta darījuma partnera kods	Trīs pušu darījuma aģenta darījuma partnera identifikācijas kods.	Sniedz attiecībā uz trīs pušu repo darījumiem.
Trīs pušu darījuma aģenta ID kods	Raksturlielums, kurš norāda ziņotā individuālā darījuma partnera veidu.	Raksturlielums, kurš norāda ziņotā individuālā trīs pušu darījuma aģenta veidu.

2. Darījuma nozīmīguma ierobežojums

Par darījumiem ar nefinanšu sabiedrībām datus sniedz tikai tad, ja tie veikti ar nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra", pamatojoties uz Bāzeles III LSR regulējumu ⁽¹⁾.

3. Izņēmumi

Datus nesniedz par darījumiem grupas ietvaros."

⁽¹⁾ Sk. *Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools*, Basel Committee on Banking Supervision, January 2013, 23.–27. lpp., pieejams Starptautisko norēķinu bankas tīmekļa vietnē www.bis.org.

II PIELIKUMS

Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) II un III pielikumu groza šādi:

1) II pielikuma 1. daļu aizstāj ar šādu:

"1. DAĻA

INSTRUMENTU VEIDI

1. Pārskatu sniedzēji sniedz datus Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) par:
 - a) par visiem euro aizņemšanās darījumiem, izmantojot tālāk tekstā iekļautajā tabulā definētos instrumentus, ar termiņu līdz vienam gadam ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc norēķinu datuma), pārskatu sniedzējam aizņemoties no monetārajām finanšu iestādēm (MFI), citiem finanšu starpniekiem (CFS), apdrošināšanas sabiedrībām, pensiju fondiem, valdības vai centrālajām bankām ieguldījumu mērķiem, kā arī no nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu;
 - b) visiem aizdevumiem citām kredītiestādēm ar termiņu līdz vienam gadam ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc norēķinu datuma), izmantojot nenodrošinātus noguldījumus vai pieprasījuma kontus, vai īstermiņa parāda vērtspapīru, noguldījumu sertifikātu, mainīgas likmes parādzīmju un citu parāda vērtspapīru ar termiņu līdz vienam gadam iegādi no tos emitējušām kredītiestādēm.
2. Tālāk tekstā iekļautā tabula sniedz instrumentu kategoriju detalizētu standarta aprakstu darījumiem, par kuriem pārskatu sniedzējiem jāsniedz dati ECB. Ja pārskatu sniedzējiem prasīts darījumu datus sniegt savai NCB, attiecīgā NCB šos instrumentu kategoriju aprakstus transponē nacionālajā līmenī saskaņā ar šo regulu.

Instrumenta veids	Apraksts
Noguldījumi	Nenodrošināti procentu noguldījumi (t. sk. pieprasījuma konti (<i>call accounts</i>), izņemot pieprasījuma noguldījumu kontus (<i>current accounts</i>)) ar brīdinājuma termiņu par izņemšanu vai termiņu ne ilgāku par vienu gadu, kurus pieņēmis (aizņemšanās) vai noguldījis pārskatu sniedzējs.
Pieprasījuma konti	Skaidras naudas konti ar brīdinājuma termiņu par naudas izņemšanu un ikdienas izmaiņām piemērojamajā procentu likmē, kas ir regulāru procentu maksājumu vai aprēķinu pamatā.
Noguldījuma sertifikāts	MFI emitēts fiksēta termiņa parāda instruments, kurš tā turētājam dod tiesības uz noteiktu fiksētu procentu likmi noteiktā fiksētā termiņā, kas nav ilgāks par vienu gadu.
Īstermiņa parāda vērtspapīrs	Nenodrošināts parāda instruments vai parāda instruments ar emitenta sniegtu nodrošinājumu ar termiņu ne ilgāku par vienu gadu, kas pelna procentus vai pārdots ar diskontu.
Mainīgas likmes parādzīme	Parāda instruments, kura periodiskos procentu maksājumus aprēķina, pamatojoties uz vērtību, t. i., fiksējot pamatā esošo atsauces likmi, piemēram, <i>Euribor</i> , iepriekš noteiktos datumos, kurus sauc par likmes maiņas datumiem, un kura termiņš nav ilgāks par vienu gadu.

Instrumenta veids	Apraksts
Citi īstermiņa parāda vērtspapīri	<p>Pārskata sniedzēju emitēti nesubordinēti vērtspapīri, kas nav pašu kapitāls, ar termiņu līdz vienam gadam, kas parasti ir apgrozāmi un otrreizējā tirgū tirgoti instrumenti, vai kuru pozīcijas var slēgt, tirgū veicot pretēju darījumu, un kas turētājam nepiešķir īpašumtiesības emitenta iestādē. Šajā postenī tiek iekļauti:</p> <p>a) vērtspapīri, kas turētājam dod beznosacījuma tiesības uz fiksētu vai līgumā noteiktu ienākumu procentu maksājumu veidā un/vai norādītu fiksētu summu konkrētā datumā (vai datumos) vai sākot ar datumu, kas noteikta emisijas brīdī;</p> <p>b) pārskatu sniedzēju emitēti neapgrozāmi instrumenti, kas vēlāk kļuvuši apgrozāmi un pārklasificēti kā "parāda vērtspapīri".;</p>

2) III pielikuma 1. daļu aizstāj ar šādu:

"1. DAĻA

INSTRUMENTU VEIDI

Pārskatu sniedzēji sniedz datus Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) par:

- a) visiem valūtas mijmaiņas darījumiem, kuros euro tiek pirkti/pārdoti tagadnē par ārvalstu valūtu un atpārdots vai atpirkts datumā nākotnē par iepriekšnoteiktu valūtas beigu kursu, ar termiņu līdz vienam gadam ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc valūtas mijmaiņas darījuma tagadnes posma norēķinu dienas), darījumiem notiekot starp pārskatu sniedzēju un citām monetārajām finanšu iestādēm (MFI), citiem finanšu starpniekiem (CFS), apdrošināšanas sabiedrībām, pensiju fondiem, valdības vai centrālajām bankām ieguldījumu mērķiem, kā arī nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu;
- b) uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas (OIS) darījumiem euro starp pārskatu sniedzēju un citām monetārajām finanšu iestādēm (MFI), CFS, apdrošināšanas sabiedrībām, pensiju fondiem, valdības vai centrālajām bankām ieguldījumu mērķiem, kā arī nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu.";

3) tabulu III pielikuma 2. daļas 1. punktā aizstāj ar šādu:

"Datu lauks	Datu apraksts	Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi
Darījuma identifikators	Pārskatu sniedzēja katram darījumam izmantotais iekšējais unikālais darījuma identifikators.	Darījuma identifikators ir unikāls, katram sniegtajam darījumam noteiktā pārskata dienā jebkurā naudas tirgus segmentā.
Pārskata sniegšanas datums	Datums, kurā dati tiek sniegti ECB vai NCB.	
Elektronisks laika zīmogs	Laiks, kurā veikts vai iegrāmatots darījums.	

"Datu lauks	Datu apraksts	Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi
Darījuma partnera kods	Identifikācijas kods, pēc kura atpazīst pārskatu sniedzēja darījuma partneri ziņotajā darījumā.	Ja darījumi tiek veikti, izmantojot centrālo kliringa darījuma partneri (KDP), jānorāda KDP juridiskās personas identifikators (JPI). Ja darījumi tiek veikti ar nefinanšu sabiedrībām, CFS, apdrošināšanas sabiedrībām, pensiju fondiem, valdību un centrālajām bankām, kā arī ziņojot par jebkuru citu darījumu, kurā netiek sniegts darījuma partnera JPI, norāda darījuma partnera klasi.
Darījuma partnera ID kods	Raksturlielums, kurš norāda ziņotā individuālā darījuma partnera veidu.	Jāizmanto visos gadījumos. Tiks sniegts individuāls darījuma partnera kods.
Darījuma partnera atrašanās vieta	Valsts, kurā reģistrēts darījuma partneris, Starptautiskās Standartizācijas organizācijas (ISO) valsts kods.	Obligāts tad, ja nav norādīts individuālais darījuma partnera kods. Pārējos gadījumos – pēc izvēles.
Darījuma datums	Datums, kurā puses veic pārskatā norādīto finanšu darījumu.	
Tagadnes vērtības datums	Datums, kurā viena puse pārdod otrai noteiktu daudzumu noteiktas valūtas, saņemot nolīgtu summu noteiktas citas valūtas, kas pamatojas uz nolīgtu valūtas kursu, kuru sauc par valūtas sākumkursu.	
Termiņa beigu datums	Datums, kurā beidzas valūtas mijmaiņas darījums un kurā tagadnes vērtības datumā pārdotā valūta tiek atpirkta.	
Darījuma apzīmējums	Izmanto, lai noteiktu, vai summa euro, kas norādīta kā darījuma nominālvērtība, tagadnes vērtības datumā tiek pirktā vai pārdota.	Jāattiecas uz euro tagadnes darījumu, t. i., to, vai tagadnes vērtības datumā euro tiek pirktā vai pārdota.
Darījuma nominālvērtība	Tagadnes vērtības datumā pirktā vai pārdotā euro summa.	
Valūtas kods	Valūtas, kuru pērk/pārdod apmaiņā pret euro, starptautiskais trīs zīmju ISO kods.	

"Datu lauks	Datu apraksts	Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi
Valūtas sākumkurss	Euro un ārvalstu valūtas kurss, kurš attiecas uz valūtas mijmaiņas darījuma tagadnes posmu.	
Valūtas kursa nākotnes punkti (<i>Foreign exchange forward points</i>)	Starpība starp valūtas darījuma sākumkursu un valūtas darījuma beigu kursu, kas izteikta bāzes punktos atbilstoši valūtu pārī pieņemtajiem tirgus principiem."	