

VERORDENING (EU) 2015/1599 VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK
van 10 september 2015
tot wijziging van Verordening (EU) nr. 1333/2014 houdende geldmarktstatistieken (ECB/2015/30)

DE RAAD VAN BESTUUR VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK,

Gezien de statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank, met name artikel 5,
Gezien Verordening (EG) nr. 2533/98 van de Raad van 23 november 1998 met betrekking tot het verzamelen van statistische gegevens door de Europese Centrale Bank ⁽¹⁾, met name artikel 5, lid 1, en artikel 6, lid 4,

Overwegende:

- (1) Verordening (EU) nr. 1333/2014 van de Europese Centrale Bank (ECB/2014/48) ⁽²⁾ vereist de rapportage van statistische gegevens door rapportageplichtigen opdat het Europees Stelsel van centrale banken ter vervulling van zijn taken geldmarkttransactiestatistieken kan produceren.
- (2) Een reeks rapportage-instructies met gedetailleerde parameters voor de rapportage van statistische gegevens uit hoofde van Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt voor de nationale centrale banken uitgevaardigd. Aangezien de rapportage-instructies een aantal significante termen uit die verordening verfijnen, vergt consistentie dat de verordening die wijzigingen ook incorporeert.
- (3) Derhalve moet Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) dienovereenkomstig gewijzigd worden,

HEEFT DEZE VERORDENING VASTGESTELD:

Artikel 1

Wijzigingen

1. Bijlage I bij Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt vervangen door bijlage I bij deze verordening.
2. Bijlagen II en III bij Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) worden gewijzigd in overeenstemming met bijlage II bij deze verordening.

Artikel 2

Slotbepalingen

Deze verordening treedt in werking op de twintigste dag na bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in de lidstaten overeenkomstig de Verdragen.

Gedaan te Frankfurt am Main, 10 september 2015.

Namens de Raad van bestuur van de ECB

De president van de ECB

Mario DRAGHI

⁽¹⁾ PB L 318 van 27.11.1998, blz. 8.

⁽²⁾ Verordening (EU) nr. 1333/2014 van de Europese Centrale Bank van 26 november 2014 houdende geldmarktstatistieken (ECB/2014/48) (PB L 359 van 16.12.2014, blz. 97).

BIJLAGE I

„BIJLAGE I

Rapportageschema voor met gedekte transacties verband houdende geldmarktstatistieken

DEEL 1

TYPE INSTRUMENT

Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB) alle repo-overeenkomsten en transacties uit hoofde van repo-overeenkomsten, waaronder driepartijenrepo's die luiden in euro met een looptijd tot en met één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum) tussen de informatieplichtige en andere monetaire financiële instellingen (MFI's), overige financiële intermediairs (OFI's), verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid of centrale banken voor beleggingsdoelstellingen, alsook met niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader.

DEEL 2

SOORT GEGEVENS**1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens ⁽¹⁾ die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden**

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportage-optie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactie-identificatiecode	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte interne unieke identificatiecode.	De transactie-identificatiecode is uniek voor iedere op een bepaalde rapportagedatum voor enig geldmarktsegment gerapporteerde transactie.
Rapportagedatum	De datum waarop de gegevens bij de ECB of de NCB ingediend moeten worden.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Wederpartijcode	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	Indien transacties via een clearinginstelling als centrale tegenpartij (CCP) worden uitgevoerd, moet de identificatiecode van juridische entiteiten (legal entity identifier (LEI)) verstrekt worden. Indien transacties worden uitgevoerd met niet-financiële vennootschappen, OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid of centrale banken en voor enige andere transactie waarvoor de wederpartij-LEI niet verstrekt wordt, moet de wederpartijklasse verstrekt worden.
ID wederpartijcode	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele wederpartijcode aangeeft.	Moet onder alle omstandigheden gebruikt worden. Een individuele wederpartijcode wordt verstrekt.

⁽¹⁾ De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op de ECB-website: <http://www.ecb.europa.eu>

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportage-optie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Vestigingsplaats wederpartij	International Organisation for Standardisation (ISO) landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de individuele wederpartijcode niet verstrekt wordt. Anders optioneel.
Nominaal transactiebedrag	Het initieel opgenomen of verstrekte bedrag.	
Nominaal onderpandbedrag	Het nominale als onderpand verstrekte zekerhedenbedrag.	Met uitzondering van driepartijenrepo's en enige andere transactie waarin de verstrekte zekerheid niet middels een internationaal identificatienummer voor waardepapieren (international securities identification number) (ISIN) wordt geïdentificeerd.
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de financiële transactie aangaan.	
Afwikkelingsdatum	De aankoopdatum, d.w.z. de datum waarop de geldgever het contante bedrag verschuldigd is aan de geldnemer en het waardepapier door de geldnemer aan de geldgever moet worden overgedragen.	In geval van openbasisrepotransacties is dat de datum waarop de rollover afgewikkeld wordt (zelfs als geen contant geld wordt uitgewisseld).
Vervaldatum	De repodatum, d.w.z. op datum waarop de geldnemer de geldgever het verschuldigde contante bedrag moet terugbetalen.	In geval van openbasisrepotransacties is dat de datum waarop de verschuldigde hoofdsom en interest terugbetaald moeten worden indien de transactie niet langer gecontinueerd wordt.
Transactiesymbool	Opnemen van contant geld in het geval van repo's of verstrekken van contant geld in het geval van repo's met wederverkoopverplichting.	
Onderpand-ISIN	Het ISIN dat is toegewezen aan in financiële markten uitgegeven effecten, dat bestaat uit 12 alfanumerieke tekens die unieke identificatie vormen voor effecten (zoals bedoeld onder ISO 6166).	Rapportage is verplicht met uitzondering van bepaalde soorten onderpand.
Type zekerheid	Ter identificering van de als onderpand verstrekte activaklasse, indien geen individuele ISIN verstrekt wordt.	Moet steeds verstrekt worden indien geen individuele ISIN verstrekt wordt.
Sector van onderpandemittent	Ter identificering van de sector van de onderpandemittent indien geen individuele ISIN verstrekt wordt.	Te verstrekken indien geen individuele ISIN verstrekt wordt.
Markering specifiek onderpand	Ter identificering van alle repotransacties die uitgevoerd worden tegen verstrekking van algemeen onderpand en repo's die uitgevoerd worden tegen verstrekking van specifiek onderpand. Optioneel veld dat alleen ingevuld moet worden indien zulks voor de informatieplichtige haalbaar is.	Rapportage van dit veld is optioneel.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportage-optie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Rentepercentage van overeenkomst	Het rentetarief uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-geldmarktconventie waartegen de repo werd afgesloten en welk rentetarief wordt toegepast op het verstrekte contante geld.	
Onderpandsurpluspercentage	Een risicobeheersingsmaatregel die wordt toegepast op het onderliggend onderpand, waarvan de waarde wordt berekend als de marktwaarde van de activa verminderd met een bepaald percentage (surpluspercentage (haircut)). Voor rapportagedoeleinden wordt het onderpandsurpluspercentage berekend als 100 minus de ratio tussen opgenomen/verstrekkt contant geld en de marktwaarde met inbegrip van de opgebouwde rente van het als zekerheid aangeboden onderpand.	Rapportage in dit veld is slechts vereist voor individuele onderpandtransacties.
Wederpartijcode van de driepartijenagent	Wederpartij-identificatiecode van de driepartijenagent.	Moet voor driepartijenrepo's gerapporteerd worden.
Driepartijenagentidentificatiecode ID	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele driepartijenagentidentificatiecode aangeeft.	Moet steeds toegepast worden waar een individuele driepartijenagentidentificatiecode verstrekt zal worden.

2. Materialiteitsdrempel

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moet alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geclassificeerde niet-financiële vennootschappen ⁽¹⁾.

3. Uitzonderingen

Intragroeptransacties moeten niet gerapporteerd worden.”

⁽¹⁾ Zie „Bazel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools”, Bazel Comité voor banktoezicht, januari 2013, blz. 23-27, beschikbaar op de website van de Bank voor Internationale Betalingen: <http://www.bis.org/>

BIJLAGE II

De bijlagen II en III bij Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) worden als volgt gewijzigd:

1) In bijlage II wordt deel 1 als volgt vervangen:

„DEEL 1

TYPE INSTRUMENT

1. Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB):
 - a) alle leenactiviteiten die de in de volgende tabel opgesomde instrumenten gebruiken, die luiden in euro met een looptijd van hoogstens één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum) tussen de informatieplichtige en overige monetaire financiële instellingen (MFI's), overige financiële intermediairs (OFI's), verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid of centrale banken voor beleggingsdoelstellingen, alsook met niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” in het Bazel III LCR-kader;
 - b) alle leenactiviteiten aan andere kredietinstellingen met een looptijd van hoogstens één jaar (zijnde transacties met een looptijd van ten hoogste 397 dagen na de afwikkelingsdatum) middels ongedekte deposito's of zichtrekeningen of middels de aankoop van de uitgevende instellingen van commercial papier, depositocertificaten, floating rate notes en overige schuldbewijzen met een looptijd van ten hoogste één jaar.
2. De hiernavolgende tabel bevat een gedetailleerde standaardbeschrijving van de instrumentcategorieën voor transacties die informatieplichtigen aan de ECB moeten rapporteren. Indien de informatieplichtigen aan hun betrokken NCB de transacties moeten rapporteren, moet de betrokken NCB deze beschrijvingen van de instrumentcategorieën op nationaal niveau overeenkomstig deze verordening omzetten.

Type instrument	Beschrijving
Deposito's	Ongedekte rentedragende deposito's (waaronder zichtrekeningen met uitzondering van rekeningen courant) met hetzij een opzegtermijn, hetzij een looptijd van hoogstens één jaar, die de informatieplichtige hetzij opneemt (opgenomen lening), hetzij plaatst.
Zichtrekeningen	Kasrekeningen met een dagelijks wijzigend rentetarief waaruit regelmatige rentebetalingen of renteberekeningen voortvloeien, en een aankondigingstermijn voor het opnemen van geld.
Depositocertificaten	Een door een MFI uitgegeven schuldbewijs met een vaste looptijd die de houder recht geeft op een bepaalde vaste rentevoet gedurende een vaste termijn van hoogstens één jaar.
Commercieel papier	Een schuldbewijs dat hetzij ongedekt is, hetzij gedekt wordt door een door de emitent verstrekt onderpand dat een looptijd heeft van hoogstens één jaar en hetzij rentedragend, hetzij met disagio is uitgegeven.
Obligaties met een variabel tarief („Floating rate note”)	Een schuldbewijs waarvoor de periodieke interestbetalingen zijn berekend op basis van de waarde, d.w.z. door het vastleggen van een onderliggend rentetarief zoals Euribor op vooraf bepaalde data die ook wel vaststellingsdata genoemd worden, met een looptijd van ten hoogste één jaar.

Type instrument	Beschrijving
Overige kortlopende schuldbewijzen	<p>Door informatieplichtigen uitgegeven niet-achtergestelde effecten, niet zijnde aandelen met een looptijd van ten hoogste één jaar, welke instrumenten doorgaans verhandelbaar zijn en op secundaire markten worden verhandeld of op de markt kunnen worden verrekend en die de houder geen eigendomsrechten verlenen met betrekking tot de emitterende instelling. Hiertoe behoren:</p> <p>a) effecten die de houder een onvoorwaardelijk recht geven op een vast of contractueel bepaald inkomen in de vorm van couponbetalingen en/of vast bedrag op een bepaalde datum (of op bepaalde data), dan wel vanaf een bij de emissie vastgestelde datum;</p> <p>b) niet-verhandelbare door informatieplichtigen uitgegeven instrumenten die nadien verhandelbaar worden en als „schuldbewijzen” geherclassificeerd worden.”.</p>

2) In bijlage III wordt deel 1 als volgt vervangen:

„DEEL 1

TYPE INSTRUMENT

Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB):

- a) alle deviezenswaps waarbij euro's contant worden aangekocht tegen betaling van een vreemde valuta en die euro's op een toekomstige datum worden herverkocht of heraangekocht tegen een vooraf overeengekomen deviezenkoers met een looptijd tot en met één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum van het contante deel van de deviezenswaptransactie) tussen de informatieplichtige en overige monetaire financiële instellingen (MFI's), overige financiële instellingen (OFI's), verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid of centrale banken voor beleggingsdoeleinden, alsook met overeenkomstig het Bazel III LCR-kader als „wholesale” ingedeelde niet-financiële vennootschappen;
- b) overnight index swaps (OIS) transacties, luidend in euro, tussen de informatieplichtige en andere monetaire financiële instellingen (MFI's), OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid of centrale banken voor beleggingsdoeleinden, alsook met overeenkomstig het Bazel III LCR-kader als „wholesale” ingedeelde niet-financiële vennootschappen.”.

3) In bijlage III wordt de tabel in punt 1 van deel 2 als volgt vervangen:

„Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportage-optie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactie-identificatiecode	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte interne unieke identificatiecode.	De transactie-identificatiecode is uniek voor iedere op een bepaalde rapportagedatum voor enig geldmarktsegment gerapporteerde transactie.
Rapportagedatum	De datum waarop de gegevens bij de ECB of de NCB ingediend moeten worden.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	

„Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportage-optie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Wederpartijcode	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	Indien transacties via een clearinginstelling als centrale tegenpartij (CCP) worden uitgevoerd, moet de identificatiecode van juridische entiteiten (legal entity identifier (LEI)) verstrekt worden. Indien transacties worden uitgevoerd met niet-financiële vennootschappen, OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid of centrale banken en voor enige andere transactie waarvoor de wederpartij-LEI niet verstrekt wordt, moet de wederpartijklasse verstrekt worden.
ID wederpartijcode	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele wederpartijcode aangeeft.	Moet onder alle omstandigheden gebruikt worden. Een individuele wederpartijcode wordt verstrekt.
Vestigingsplaats wederpartij	International Organisation for Standardisation (ISO) landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de individuele wederpartijcode niet verstrekt wordt. Anders optioneel.
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de gerapporteerde financiële transactie aangaan.	
Contante valutadatum	De datum waarop een partij aan de andere partij een specifiek bedrag van een specifieke valuta verkoopt tegen betaling van een overeengekomen bedrag van een specifieke andere valuta gebaseerd op een overeengekomen wisselkoers, ook wel de contante koers van de vreemde valuta genoemd.	
Vervaldatum	De datum waarop de swaptransactie van de vreemde valuta afloopt en de verkochte valuta op de contante valutadatum weer wordt aangekocht.	
Transactiesymbool	Moet gebruikt worden om vast te stellen of het eurobedrag dat uit hoofde van het nominale transactiebedrag werd gerapporteerd, op de contante valutadatum wordt aangekocht of verkocht.	Dit moet verwijzen naar de eurospotdeel (euro spot leg), d.w.z. of euro wordt aangekocht of verkocht op de contante valutadatum.
Nominaal transactiebedrag	Het op de contante valutadatum aangekochte of verkochte bedrag in euro.	
Deviezencode	De internationale driecijferige ISO-code van in ruil voor euro aangekochte/verkochte valuta.	

„Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportage-optie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Contante koers van de deviezen	De wisselkoers tussen de euro en de op het contante deel toepasselijke vreemde valuta van de deviezenswaptransactie.	
Deviezentermijnpunten	Het verschil tussen de contante wisselkoers en de deviezentermijnkoers, uitgedrukt in basispunten genoteerd volgens de heersende marktconventies voor het deviezenpaar.”.	