

REGULAMENTO (UE) 2015/1599 DO BANCO CENTRAL EUROPEU
de 10 de setembro de 2015
que altera o Regulamento (UE) n.º 1333/2014 relativo às estatísticas de mercados monetários
(BCE/2015/30)

O CONSELHO DO BANCO CENTRAL EUROPEU,

Tendo em conta os Estatutos do Sistema Europeu de Bancos Centrais e do Banco Central Europeu, nomeadamente o seu artigo 5.º,

Tendo em conta o Regulamento (CE) n.º 2533/98 do Conselho, de 23 de novembro de 1998, relativo à compilação de informação estatística pelo Banco Central Europeu ⁽¹⁾, nomeadamente os artigos 5.º, n.º 1, e 6.º, n.º 4,

Considerando o seguinte:

- (1) O Regulamento (UE) n.º 1333/2014 do Banco Central Europeu (ECB/2014/48) ⁽²⁾ impõe o reporte de dados estatísticos pelos agentes inquiridos para que o Sistema Europeu de Bancos Centrais possa produzir as estatísticas sobre as operações de mercado monetário necessárias ao desempenho das suas funções.
- (2) Será enviado aos bancos centrais nacionais um conjunto de instruções para o reporte com a indicação detalhada dos parâmetros do reporte de informação estatística a efetuar por força do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (ECB/2014/48). Uma vez que as referidas instruções especificam, em maior medida, vários termos significativos constante do citado regulamento, torna-se necessário fazer refletir no mesmo tais alterações por uma questão de harmonização.
- (3) Havendo, consequentemente, que alterar o Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) em conformidade,

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

Alterações

1. O anexo I do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) é substituído pelo anexo I do presente regulamento.
2. Os anexos II e III do Regulamento (EU) No 1333/2014 (BCE/2014/48) são alterados em conformidade com o anexo II do presente regulamento.

Artigo 2.º

Disposições finais

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia após a sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros nos termos dos Tratados.

Feito em Frankfurt am Main, em 10 de setembro de 2015.

Pelo Conselho do BCE

O Presidente do BCE

Mario DRAGHI

⁽¹⁾ JO L 318 de 27.11.1998, p. 8.

⁽²⁾ Regulamento (UE) n.º 1333/2014 do Banco Central Europeu, de 26 de novembro de 2014, relativo a estatísticas de mercados monetários (BCE/2014/48) (JO L 359 de 16.12.2014, p. 97).

ANEXO I

«ANEXO I

Esquema de reporte de estatísticas de mercado monetário referentes a operações com garantia

PARTE 1

TIPO DE INSTRUMENTOS

Os agentes inquiridos devem reportar ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional competente (BCN) todos os acordos de recompra e operações efetuadas ao abrigo dos mesmos, incluindo acordos de recompra (*repos*) tripartidos, denominados em euros e com data de vencimento até um ano (definidos como operações com um prazo de vencimento não superior a 397 dias após a data da liquidação), celebrados entre o agente inquirido e outras instituições financeiras monetárias (IFM), outros intermediários financeiros (OIF), sociedades de seguros, fundos de pensões, administrações públicas ou bancos centrais para fins de investimento, assim como sociedades não financeiras, quando as referidas instituições estejam classificadas como “*wholesale*” de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez.

PARTE 2

TIPO DE DADOS**1. Dados baseados no tipo de operação ⁽¹⁾ a reportar relativamente a cada operação**

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se for o caso), e outras condições
Identificador da operação	Identificador de operação interno e único atribuído a cada operação pelo agente inquirido.	O identificador de operação é exclusivo de cada operação reportada em determinada data de reporte e relativamente a qualquer segmento de mercado monetário.
Data do reporte	Data de apresentação de dados ao BCE ou ao BCN.	
Carimbo de data eletrónico	A hora a que a operação foi concluída ou contabilizada.	
Código da contraparte	Código de identificação a ser utilizado para reconhecer a contraparte do agente inquirido na operação reportada.	Sempre que as operações se realizem por intermédio de um sistema de compensação com contrapartes centrais (CCP), deve fornecer-se o LEI (<i>Legal Entity Identifier/Identificador de Entidade Jurídica</i>) do CCP. Se as operações se realizarem com sociedades não financeiras, OIF, sociedades de seguros, fundos de pensões, administrações públicas e bancos centrais, e relativamente a qualquer outra operação reportada para a qual não seja fornecido o LEI, será necessário indicar a categoria a que a contraparte pertence.
Código ID da contraparte	Atributo que especifica o tipo de código individual de contraparte transmitido.	A ser utilizado em todas as circunstâncias. Deve fornecer-se um código de contraparte individual.

⁽¹⁾ Os padrões para a transmissão eletrónica e as especificações técnicas destes dados são estabelecidos separadamente e estão disponíveis (em inglês) no sítio do BCE na Internet em www.ecb.europa.eu.

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se for o caso), e outras condições
Localização da contraparte	Código de país ISO (atribuído pela <i>International Organisation for Standardisation</i>) do país em que a contraparte está constituída.	Obrigatório, se não for fornecido o código de contraparte individual. Caso contrário, campo de preenchimento facultativo.
Valor nominal da operação	Montante do crédito inicialmente obtido ou concedido.	
Valor nominal do(s) ativo(s) de garantia	Valor nominal do(s) título(s) penhorado(s) fornecido(s) como ativo(s) de garantia.	Exceto no que se refere a acordos de recompra (<i>repos</i>) tripartidos e quaisquer outras operações em que a garantia dada de penhor não seja identificada mediante um <i>ISIN (International Securities Identification Number/Número internacional de identificação de título)</i> exclusivo.
Data da transação	Data em que as partes efetuam a operação financeira.	
Data de liquidação	Data de compra, ou seja, a data em que o numerário deve ser pago pelo mutuante ao mutuário e o título deve ser transferido pelo mutuário para o mutuante.	No caso de acordos de recompra com prazo em aberto, esta será a data em que a renovação for liquidada (ainda que não haja lugar à troca de numerário).
Data de vencimento	Data da recompra, ou seja, data em que o numerário deve ser reembolsado pelo mutuário ao mutuante.	No caso de acordos de recompra com prazo em aberto, esta será a data em que o capital e os juros em dívida devem ser reembolsados, no caso de a operação não ter sido renovada.
Sinal da operação	Tomada de empréstimos em numerário no caso de acordos de recompra, ou de concessão de empréstimos em numerário no caso de acordos de revenda.	
Código <i>ISIN</i> (Número de Identificação Internacional) do(s) ativo(s) de garantia	<i>ISIN</i> atribuído aos valores mobiliários emitidos nos mercados financeiros, composto por 12 caracteres alfanuméricos, que identifica de forma exclusiva uma emissão de títulos (conforme definido na Norma ISO 6166).	A ser reportado com as exceções relativas a determinados ativos de garantia.
Tipo de ativos de garantia	Para identificação da categoria do ativo dado em garantia, se não for fornecido um <i>ISIN</i> individual.	A indicar em todos os casos em que não seja fornecido um <i>ISIN</i> individual.
Setor do emitente dos ativos de garantia	Para identificação da categoria do ativo dado em garantia, se não for fornecido um <i>ISIN</i> individual.	A indicar em todos os casos em que não seja fornecido um <i>ISIN</i> individual.
Bandeira indicadora de ativo de garantia especial	Para distinguir entre os acordos de recompra concluídos contra a prestação de garantia geral e especial. Campo de preenchimento facultativo, apenas se tal for possível ao agente inquirido.	O preenchimento deste campo é facultativo.

Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte alternativo (se for o caso), e outras condições
Taxa da operação	A taxa de juro, expressa de acordo com a convenção de mercado monetário “número efetivo de dias/360”, à qual o acordo de recompra foi celebrado e o numerário deve ser reembolsado.	
Margem de avaliação dos ativos de garantia	Uma medida de controlo de risco aplicada aos ativos de garantia subjacentes mediante a qual o valor desses ativos é calculado como valor de mercado do ativo deduzido de uma certa percentagem (<i>haircut</i>). Para efeitos de reporte, a margem de avaliação do ativo de garantia é calculada como 100 menos a proporção entre o numerário concedido/tomado de empréstimo e o valor de mercado (incluindo juros corridos) do ativo dado em garantia.	O reporte deste campo só é necessário para operações com um único ativo de garantia.
Código de contraparte do agente tripartido	Identificador do código de contraparte do agente tripartido.	A reportar em relação a acordos de recompra tripartidos.
Código ID do agente tripartido	Atributo que especifica o tipo de código do agente tripartido individual transmitido.	A ser utilizado sempre que seja fornecido um código de agente tripartido individual.

2. Limiar de relevância

As operações realizadas com sociedades não financeiras só deverão ser reportadas quando estas estiverem classificadas como “*wholesale*” de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez ⁽¹⁾.

3. Exceções

As operações intragrupo não se reportam.»

⁽¹⁾ Ver “*Basel III: The Liquidity Coverage Ratio and liquidity risk monitoring tools*”, Comité de Supervisão Bancária de Basileia, janeiro de 2013, págs. 23 a 27, disponível no sítio do Banco de Pagamentos Internacionais na Internet em www.bis.org.

ANEXO II

Os anexos II e III do Regulamento (UE) n.º 1333/2014 (BCE/2014/48) são alterados do seguinte modo:

1. No anexo II, o artigo 1.º é substituído pelo seguinte:

«PARTE 1

TIPO DE INSTRUMENTOS

1. Os agentes inquiridos devem reportar ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional (BCN) competente:
 - a) todas as operações de tomada de empréstimo com utilização dos instrumentos descritos no quadro abaixo, denominados em euros e com uma data de vencimento até um ano (definidas como operações com um prazo de vencimento não superior a 397 dias após a data da liquidação), realizadas entre o agente inquirido e outras instituições financeiras monetárias (IFM), outros intermediários financeiros (OIF), sociedades de seguros, fundos de pensões, administrações públicas e bancos centrais para fins de investimento, bem como sociedades não financeiras, quando as referidas instituições estejam classificadas como “*wholesale*” de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez.
 - b) todas as operações de concessão de empréstimo a outras instituições de crédito com uma data de vencimento até um ano (definidas como operações com uma maturidade não superior a 397 dias após a data da liquidação) mediante depósitos sem garantia ou contas de investimento ou da compra, às instituições de crédito emitentes, de papel comercial, certificados de depósito, instrumentos de taxa variável e outros títulos de dívida com maturidades até um ano;
2. O quadro abaixo fornece uma descrição detalhada e normalizada das categorias de instrumentos utilizados nas operações que os agentes inquiridos estão obrigados a reportar ao BCE. No caso de os agentes inquiridos estarem obrigados a reportar ao respetivo BCN, o BCN competente deveria transpor para o nível nacional as descrições de categorias de instrumentos previstas neste regulamento.

Tipo de instrumento	Descrição
Depósitos	Depósitos remunerados sem garantia (incluindo contas de investimento (<i>call accounts</i>), mas não as contas correntes), que sejam reembolsáveis com pré-aviso ou tenham um prazo de vencimento não superior a um ano, e que sejam tomados de empréstimo ou colocados pelo agente inquirido.
Contas de investimento	Contas em numerário sujeitas a variações diárias da taxa de juro aplicável, dando lugar ao pagamento ou ao cálculo de juros a intervalos regulares, assim como a um prazo de pré-aviso para se poderem efetuar levantamentos.
Certificados de depósito	Instrumento de taxa de juro fixa emitido por uma IFM que confere ao seu detentor o direito a uma determinada taxa de juro fixa durante um prazo fixo acordado de até um ano.
Papel comercial	Instrumento de dívida sem garantia, ou garantido por ativos de garantia fornecidos pelo emitente, com prazo de vencimento inferior a um ano e que pode ser remunerado ou emitido a desconto.
Instrumento de taxa variável	Instrumento de dívida cujas prestações de juros são calculadas com base no valor, ou seja, mediante a fixação de uma taxa de referência de base, tal como a Euribor, em datas pré-definidas, conhecidas como datas de <i>fixing</i> (fixação do valor), e com prazo de vencimento não superior a um ano.

Tipo de instrumento	Descrição
Outros títulos de dívida de curto prazo	<p>Títulos não subordinados, exceto ações ou participações com prazo de vencimento até um ano emitidos pelos agentes inquiridos, que sejam instrumentos normalmente negociáveis e transacionados em mercados secundários, ou que possam ser compensados no mercado e que não confirmam ao detentor qualquer direito de propriedade sobre a instituição emitente. Esta rubrica inclui:</p> <p>a) títulos que confirmam ao seu detentor o direito incondicional a auferir um rendimento fixo ou contratual sob a forma de pagamento de cupões e/ou a uma importância fixa a pagar em data(s) especificada(s) ou a partir de uma data fixada na data da emissão;</p> <p>b) instrumentos não negociáveis emitidos por agentes inquiridos que posteriormente se tornem negociáveis e que sejam reclassificados como “títulos de dívida”.</p>

2. No anexo III, a parte 1 é substituída pela seguinte:

«PARTE 1

TIPO DE INSTRUMENTOS

Os agentes inquiridos devem reportar ao Banco Central Europeu (BCE) ou ao banco central nacional (BCN) competente:

- a) todos os *swaps* cambiais mediante os quais o euro seja comprado/vendido à vista contra uma divisa estrangeira, e revendido ou recomprado a prazo a uma taxa de câmbio a prazo pré-acordada, com um prazo de vencimento até um ano (definido como operações com um prazo de vencimento não superior a 397 dias após a data da liquidação da componente à vista da operação de *swap* cambial), realizados entre o agente inquirido e outras instituições financeiras monetárias (IFM), outros intermediários financeiros (OIF), sociedades de seguros, fundos de pensões, administrações públicas e bancos centrais para fins de investimento, bem como sociedades não financeiras, quando as referidas instituições estejam classificadas como “*wholesale*” de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez;
- b) operações de *swap* de taxa de juro *overnight* (OIS), denominadas em euros, realizadas entre o agente inquirido e outras instituições financeiras monetárias (IFM), OIF, sociedades de seguros, fundos de pensões, administrações públicas e bancos centrais para fins de investimento, assim como sociedades não financeiras, quando as referidas instituições estejam classificadas como “*wholesale*” de acordo com o Quadro Regulamentar de Basileia III referente ao Rácio de Cobertura de Liquidez».

3. No anexo III, o quadro constante da parte 2, parágrafo 1, é substituído pelo seguinte:

«Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte (se for o caso) e outras condições
Identificador da operação	Identificador de operação interno e único atribuído a cada operação pelo agente inquirido.	O identificador de operação é exclusivo de cada operação reportada em determinada data de reporte num dado segmento de mercado monetário.
Data do reporte	Data de apresentação de dados ao BCE ou ao BCN.	
Carimbo de data eletrónico	A hora a que a operação foi concluída ou contabilizada.	

«Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte (se for o caso) e outras condições
Código da contraparte	Código de identificação a ser utilizado para reconhecer a contraparte do agente inquirido na operação reportada.	Sempre que as operações se realizem por intermédio de um sistema de compensação com contrapartes centrais (CCP), deve ser fornecido o <i>LEI (Legal Entity Identifier/Identificador de Entidade Jurídica)</i> do CCP. Se as operações se realizarem com sociedades não financeiras, OIF, sociedades de seguros, fundos de pensões, administrações públicas e bancos centrais, e relativamente a qualquer outra operação reportada para a qual não seja fornecido o <i>LEI</i> , será necessário indicar a categoria a que a contraparte pertence.
Código ID da contraparte	Atributo que especifica o tipo de código de contraparte individual transmitido.	A ser utilizado em todas as circunstâncias. Deve fornecer-se um código de contraparte individual.
Localização da contraparte	Código de país ISO (atribuído pela <i>International Organisation for Standardisation</i>) do país em que a contraparte está constituída.	Obrigatório, se não for fornecido o código de contraparte individual. Caso contrário, campo de preenchimento facultativo.
Data da transação	Data em que as partes efetuam a operação financeira reportada.	
Data-valor à vista	Data na qual uma parte vende à outra um dado quantitativo de uma divisa contra o pagamento de um determinado valor noutra divisa, calculado com base numa taxa de câmbio previamente ajustada, designada "taxa de câmbio à vista".	
Data de vencimento	Data em que o <i>swap</i> cambial expira e a divisa vendida na data-valor à vista é recomprada.	
Sinal da operação	A ser utilizado para identificar quando o montante em euros reportado como valor nominal da operação for comprado ou vendido na data-valor à vista.	Deve referir-se ao euro <i>spot</i> , ou seja, se o euro é comprado ou vendido na data-valor à vista.
Valor nominal da operação	O montante de euros comprado ou vendido na data-valor à vista.	
Código da moeda estrangeira	O código internacional ISO (atribuído pela <i>International Organisation for Standardisation</i>) de três dígitos da moeda comprada/vendida em troca de euros.	

«Campo	Descrição dos dados	Opção de reporte (se for o caso) e outras condições
Taxa de câmbio à vista	A taxa de câmbio entre o euro e a moeda estrangeira aplicável à componente à vista do <i>swap</i> cambial.	
Pontos cambiais a prazo	Diferença entre as taxas de câmbio à vista e a prazo, expressas em pontos base citados de acordo com as convenções de mercado prevalentes para o par de divisas em causa.»	