

UREDBA EVROPSKE CENTRALNE BANKE (EU) 2015/1599
z dne 10. septembra 2015
o spremembah Uredbe (EU) št. 1333/2014 o statistiki denarnih trgov (ECB/2015/30)

SVET EVROPSKE CENTRALNE BANKE JE –

ob upoštevanju Statuta Evropskega sistema centralnih bank in Evropske centralne banke ter zlasti člena 5 Statuta,

ob upoštevanju Uredbe Sveta (ES) št. 2533/98 z dne 23. novembra 1998 o zbiranju statističnih informacij s strani Evropske centralne banke ⁽¹⁾ ter zlasti členov 5(1) in 6(4) Uredbe,

ob upoštevanju naslednjega:

- (1) Uredba Evropske centralne banke (EU) št. 1333/2014 (ECB/2014/48) ⁽²⁾ nalaga, da poročevalske enote poročajo statistične podatke z namenom, da lahko Evropski sistem centralnih bank pripravi statistiko poslov denarnega trga za izpolnjevanje svojih nalog.
- (2) Nacionalnim centralnim bankam bo izdan sklop navodil za poročanje, v katerih bodo določeni podrobni parametri za poročanje statističnih informacij v skladu z Uredbo (EU) št. 1333/2014 (ECB/2014/48). Navodila za poročanje izboljšujejo številne pomembne pojme iz navedene uredbe, zato mora zaradi doslednosti tudi uredba odražati te spremembe.
- (3) Uredbo (EU) št. 1333/2014 (ECB/2014/48) bi bilo torej treba ustrezno spremeniti –

SPREJEL NASLEDNJO UREDBO:

Člen 1

Spremembe

1. Priloga I k Uredbi (EU) št. 1333/2014 (ECB/2014/48) se nadomesti s Prilogo I k tej uredbi.
2. Prilogi II in III k Uredbi (EU) št. 1333/2014 (ECB/2014/48) se spremenita v skladu s Prilogo II k tej uredbi.

Člen 2

Končne določbe

Ta uredba začne veljati dvajseti dan po objavi v *Uradnem listu Evropske unije*.

Ta uredba je v celoti zavezujoča in se v skladu s Pogodbama neposredno uporablja v vseh državah članicah.

V Frankfurtu na Majni, 10. septembra 2015

Za Svet ECB
Predsednik ECB
Mario DRAGHI

⁽¹⁾ UL L 318, 27.11.1998, str. 8.

⁽²⁾ Uredba Evropske centralne banke (EU) št. 1333/2014 z dne 26. novembra 2014 o statistiki denarnih trgov (ECB/2014/48) (UL L 359, 16.12.2014, str. 97).

PRILOGA I

„PRILOGA I

Sistem poročanja za statistiko denarnih trgov v zvezi z zavarovanimi posli

DEL 1

VRSTE INSTRUMENTOV

Poročevalske enote poročajo Evropski centralni banki (ECB) ali zadevni nacionalni centralni banki (NCB) o vseh pogodbah o začasni prodaji in na njihovi podlagi sklenjenih poslih, vključno s tristranskimi repo posli, ki so denominirani v eurih in imajo zapadlost do vključno enega leta (opredeljeni kot posli z datumom zapadlosti največ 397 dni po datumu poravnave) ter jih poročevalska enota sklene z drugimi denarnimi finančnimi institucijami (MFI), drugimi finančnimi posredniki (DFP), zavarovalnimi družbami, pokojninskimi skladi, državo ali centralnimi bankami za naložbene namene ali z nefinančnimi družbami, ki so v skladu z okvirom Basel III za količnik likvidnostnega kritja uvrščene med grosistične (wholesale).

DEL 2

VRSTE PODATKOV**1. Vrste podatkov na ravni posla ⁽¹⁾, ki jih je treba poročati za vsak posel:**

Polje	Opis podatkov	Druga možnost poročanja (če obstaja) in druge prilagoditve
Transaction identifier (identifikacijska oznaka posla)	Notranja enolična identifikacijska oznaka posla, ki jo poročevalska enota uporabi za vsak posel.	Identifikacijska oznaka posla je enolična za vsak posel, o katerem se poroča na posamezen datum poročanja za kateri koli segment denarnega trga.
Reporting date (datum poročanja)	Datum, na katerega se podatki prenesejo ECB ali NCB	
Electronic time stamp (elektronski časovni žig)	Čas, ko je posel sklenjen ali vknjižen.	
Counterparty code (koda nasprotne stranke)	Identifikacijska koda, ki se uporabi za prepoznavo nasprotne stranke poročevalske enote pri poslu, o katerem se poroča.	Kadar se posli opravijo prek centralne nasprotne stranke (CNS), je treba zagotoviti identifikacijsko oznako pravnega subjekta (LEI), ki pripada CNS. Kadar se posli sklenejo z nefinančnimi družbami, DFP, zavarovalnimi družbami, pokojninskimi skladi, državo ali centralnimi bankami, in v primeru vseh drugih poslov, o katerih se poroča, pri katerih ni zagotovljena oznaka LEI nasprotne stranke, je treba zagotoviti podatek o vrsti nasprotne stranke.
Counterparty code ID (ID kode nasprotne stranke)	Oznaka, ki označuje vrsto prenesene posamezne kode nasprotne stranke.	Uporabi se v vseh primerih. Zagotovi se posamezna koda nasprotne stranke.

⁽¹⁾ Standardi elektronskega poročanja in tehnične specifikacije za podatke so določeni posebej. Dostopni so na spletni strani ECB: www.ecb.europa.eu.

Polje	Opis podatkov	Druga možnost poročanja (če obstaja) in druge prilagoditve
Counterparty location (lokacija nasprotne stranke)	Koda države, v kateri je ustanovljena nasprotna stranka, po standardu Mednarodne organizacije za standardizacijo (ISO).	Obvezno, če ni zagotovljena posamezna koda nasprotne stranke. Sicer izbirno.
Transaction nominal amount (nominalni znesek posla)	Prvotno izposojeni ali posojeni znesek.	
Collateral nominal amount (nominalni znesek zavarovanja)	Nominalni znesek vrednostnih papirjev, zastavljenih za zavarovanje.	Razen pri tristranskih repo poslih in katerih koli drugih poslih, pri katerih zastavljeni vrednostni papirji niso označeni z eno samo mednarodno identifikacijsko številko vrednostnega papirja (ISIN).
Trade date (datum sklenitve posla)	Datum, na katerega stranki skleneta finančni posel.	
Settlement date (datum poravnave)	Datum nakupa tj. datum, na katerega mora posojilodajalec izplačati denar posojilojemalcu, vrednostni papirji pa morajo biti preneseni od posojilojemalca k posojilodajalcu.	V primeru odprtih repo poslov je to datum, na katerega se poravna obnovitev (tudi če ne pride do izmenjave denarja).
Maturity date (datum zapadlosti)	Datum povratnega nakupa tj. datum, na katerega mora posojilojemalec izplačati denar posojilodajalcu.	V primeru odprtih repo poslov je to datum, na katerega je treba odplačati glavnico in obresti, če se posel znova ne obnavi.
Transaction sign (predznak posla)	Izposojanje denarja v primeru poslovčasne prodaje ali posojanje denarja v primeru poslovčasnega nakupa.	
ISIN of the collateral (številka ISIN zavarovanja)	Številka ISIN, ki je dodeljena vrednostnim papirjem, izdanim na finančnih trgih, in je sestavljena iz 12 alfanumeričnih znakov ter enolično označuje vrednostni papir (kakor je opredeljena s standardom ISO 6166).	Se poroča, razen za določene vrste zavarovanj.
Collateral type (vrsta zavarovanja)	Označuje vrsto finančnega premoženja, zastavljenega za zavarovanje, kadar ni zagotovljena posamezna številka ISIN.	Zagotovi se vedno, kadar ni zagotovljena posamezna številka ISIN
Collateral Issuer Sector (sektor izdajatelja zavarovanja)	Označuje sektor izdajatelja zavarovanja, kadar ni zagotovljena posamezna številka ISIN.	Zagotovi se, kadar ni zagotovljena posamezna številka ISIN.
Special collateral flag (oznaka posebnega zavarovanja)	Označuje, ali so repo posli sklenjeni s splošnim zavarovanjem ali s posebnim zavarovanjem. Polje je izbirno in se izpolni samo, če je to za poročevalsko enoto izvedljivo.	Poročanje tega polja je izbirno.

Polje	Opis podatkov	Druga možnost poročanja (če obstaja) in druge prilagoditve
Deal rate (obrestna mera posla)	Obrestna mera, izražena v skladu s konvencijo za denarni trg 'dejansko število dni/360 dni', po kateri je bil sklenjen repo posel in po kateri se obrestuje posojeni denar.	
Collateral haircut (odbitek pri vrednotenju zavarovanja)	Ukrep za nadzor tveganj, ki se uporabi za finančno premoženje za zavarovanje, pri čemer se vrednost tega finančnega premoženja za zavarovanje izračuna kot tržna vrednost finančnega premoženja, zmanjšana za določen odstotek (odbitek pri vrednotenju). Za potrebe poročanja se odbitek pri vrednotenju zavarovanja izračuna kot 100 minus razmerje med zneskom posojenega/izposojenega denarja in tržno vrednostjo zastavljenega zavarovanja vključno z natečenimi obrestmi.	Poročanje tega polja se zahteva samo za posle z enim samim zavarovanjem.
Counterparty code of the tri-party agent (koda nasprotne stranke, ki označuje agenta v tristranskem poslu)	Koda nasprotne stranke, ki označuje agenta v tristranskem poslu.	Poroča se samo pri tristranskih repo poslih.
Tri-party agent code ID (ID kode agenta v tristranskem poslu)	Oznaka, ki označuje vrsto prenesene posamezne kode agenta v tristranskem poslu.	Uporabi se v vseh primerih, kadar se zagotovi posamezna koda agenta v tristranskem poslu.

2. Prag pomembnosti

O poslih, sklenjenih z nefinančnimi družbami, se poroča samo, če so sklenjeni z nefinančnimi družbami, ki so na podlagi okvira Basel III za količnik likvidnostnega kritja ⁽¹⁾ uvrščene med grosistične.

3. Izjeme

O poslih znotraj skupine se ne poroča.“

⁽¹⁾ Glej Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools, Baselski odbor za bančni nadzor, januar 2013, str. 23 do 27, dostopno na spletni strani Banke za mednarodne poravnave na naslovu: www.bis.org.

PRILOGA II

Prilogi II in III k Uredbi (EU) št. 1333/2014 (ECB/2014/48) se spremenita kot sledi:

1. v Prilogi II se del 1 nadomesti z naslednjim:

„DEL 1

VRSTE INSTRUMENTOV

1. Poročevalske enote poročajo Evropski centralni banki (ECB) ali zadevni nacionalni centralni banki (NCB):

- (a) o vseh posojilih z uporabo instrumentov, opredeljenih v spodnji tabeli, denominiranih v eurih z zapadlostjo do vključno enega leta (opredeljeni kot posli z datumom zapadlosti največ 397 dni po datumu poravnave), ki jih poročevalska enota najame pri drugih denarnih finančnih institucijah (MFI), drugih finančnih posrednikih (DFP), zavarovalnih družbah, pokojninskih skladih, državi ali centralnih bankah za naložbene namene ali pri nefinančnih družbah, ki so v skladu z okvirom Basel III za količnik likvidnostnega kritja uvrščene med grosistične (wholesale).
- (b) o vseh posojilih, danih drugim kreditnim institucijam, z zapadlostjo do vključno enega leta (opredeljena kot posli z datumom zapadlosti največ 397 dni po datumu poravnave), v obliki nezavarovanih vlog ali računov na vpogled ali nakupa komercialnih zapisov, potrdil o vlogah, vrednostnih papirjev s spremenljivim donosom in drugih dolžniških vrednostnih papirjev z zapadlostjo do enega leta od kreditnih institucij izdajateljic.

2. Spodnja tabela vsebuje podroben standarden opis kategorij instrumentov za posle, ki jih morajo poročevalske enote poročati ECB. Če morajo poročevalske enote poročati o poslih svoji NCB, mora zadevna NCB te opise kategorij instrumentov prenesti na nacionalno raven v skladu s to uredbo.

Vrsta instrumenta	Opis
Deposits (vloge)	Nezavarovane obrestonosne vloge (vključno z računi na vpogled vendar brez tekočih računov) na odpoklic z odpovednim rokom ali z zapadlostjo največ eno leto, ki jih poročevalska enota sprejme (izposojanje) ali položi.
Call accounts (računi na vpogled)	Denarni računi z dnevno spremembo uporabne obrestne mere, ki pomenijo izplačilo obresti ali obračune v rednih razponih in vnaprejšnje obvestilo o dvigu denarja.
Certificate of deposit (potrdilo o vlogi)	Dolžniški instrument s fiksnim rokom, ki ga izda MFI in katerega imetnik je upravičen do obresti po določeni fiksni obrestni meri v določenem fiksnem obdobju do enega leta.
Commercial paper (komercialni zapis)	Dolžniški instrument, ki je nezavarovan ali je zavarovan s finančnim premoženjem, ki ga zagotovi izdajatelj, ter ima zapadlost največ eno leto in je obrestonosen ali diskontiran.
Floating rate note (vrednostni papir s spremenljivim donosom)	Dolžniški instrument, pri katerem se periodična plačila obresti izračunajo na podlagi vrednosti, tj. prek določitve osnovne referenčne obrestne mere, kot je Euribor, na vnaprej določene datume, t. i. datume določitve, in katerega zapadlost je največ eno leto.

Vrsta instrumenta	Opis
Other short-term debt securities (drugi kratkoročni dolžniški vrednostni papirji)	<p>Nepodrejeni vrednostni papirji, razen lastniških instrumentov, z zapadlostjo do enega leta, ki so jih izdale poročevalske enote in so običajno tržni instrumenti ter se z njimi trguje na sekundarnih trgih ali jih je mogoče pobotati na trgu, imetniku pa ne dajejo lastniških pravic nad institucijo izdajateljico. Ta postavka vključuje:</p> <p>(a) vrednostne papirje, ki imetniku dajejo brezpogojno pravico do fiksnega ali pogodbeno določenega dohodka v obliki kuponskih izplačil in/ali določene fiksne vsote na določen datum (ali datume) ali z začetkom na datum, ki se določi ob izdaji;</p> <p>(b) netržne vrednostne papirje, ki jih izdajo poročevalske enote in ki potem postanejo tržni ter se prerazvrstijo med „dolžniške vrednostne papirje“.</p>

2. v Prilogi III se del 1 nadomesti z naslednjim:

„DEL 1

VRSTE INSTRUMENTOV

Poročevalske enote poročajo Evropski centralni banki (ECB) ali zadevni nacionalni centralni banki (NCB):

- (a) o vseh poslih valutnih zamenjav, pri katerih se euri kupijo/prodajo promptno v zameno za tujo valuto in se prodajo oziroma kupijo nazaj na datum v prihodnosti po vnaprej dogovorjenem terminskem deviznem tečaju in imajo zapadlost do vključno enega leta (opredeljeni kot posli z datumom zapadlosti največ 397 dni po datumu poravnave promptnega dela posla valutne zamenjave), ki jih poročevalska enota sklene z drugimi denarnimi finančnimi institucijami (MFI), drugimi finančnimi posredniki (DFP), zavarovalnimi družbami, pokojninskimi skladi, državo ali centralnimi bankami za naložbene namene ali z nefinančnimi družbami, ki so v skladu z okvirom Basel III za količnik likvidnostnega kritja uvrščene med grosistične (wholesale).
- (b) o poslih zamenjav indeksov čez noč (overnight index swaps – OIS), denominiranih v eurih, ki jih poročevalska enota sklene z drugimi denarnimi finančnimi institucijami (MFI), DFP, zavarovalnimi družbami, pokojninskimi skladi, državo ali centralnimi bankami za naložbene namene ali z nefinančnimi družbami, ki so v skladu z okvirom Basel III za količnik likvidnostnega kritja uvrščene med grosistične (wholesale).“;

3. v Prilogi III se tabela v odstavku 1 dela 2 nadomesti z naslednjo:

„Polje	Opis podatkov	Druga možnost poročanja (če obstaja) in druge prilagoditve
Transaction identifier (identifikacijska oznaka posla)	Notranja enolična identifikacijska oznaka posla, ki jo poročevalska enota uporabi za vsak posel.	Identifikacijska oznaka posla je enolična za vsak posel, o katerem se poroča na posamezen datum poročanja za kateri koli segment denarnega trga.
Reporting date (datum poročanja)	Datum, na katerega se podatki prenesejo ECB ali NCB.	
Electronic time stamp (elektronski časovni žig)	Čas, ko je posel sklenjen ali vknjižen.	

„Polje	Opis podatkov	Druga možnost poročanja (če obstaja) in druge prilagoditve
Counterparty code (koda nasprotne stranke)	Identifikacijska koda, ki se uporabi za prepoznavo nasprotne stranke poročevalske enote pri poslu, o katerem se poroča.	Kadar se posli opravijo prek centralne nasprotne stranke (CNS), je treba zagotoviti identifikacijsko oznako pravnega subjekta (LEI), ki pripada CNS. Kadar se posli sklenejo z nefinančnimi družbami, DFP, zavarovalnimi družbami, pokojninskimi skladi, državo ali centralnimi bankami, in v primeru vseh drugih poslov, o katerih se poroča, pri katerih ni zagotovljena oznaka LEI nasprotne stranke, je treba zagotoviti podatek o vrsti nasprotne stranke.
Counterparty code ID (ID kode nasprotne stranke)	Oznaka, ki označuje vrsto prenesene posamezne kode nasprotne stranke.	Uporabi se v vseh primerih. Zagotovi se posamezna koda nasprotne stranke.
Counterparty location (lokacija nasprotne stranke)	Koda države, v kateri je ustanovljena nasprotna stranka, po standardu Mednarodne organizacije za standardizacijo (ISO).	Obvezno, če ni zagotovljena posamezna koda nasprotne stranke. Sicer izbirno.
Trade date (datum sklenitve posla)	Datum, na katerega stranki skleneta finančni posel.	
Spot value date (datum uporabe promptnega deviznega tečaja)	Datum, na katerega ena stranka drugi stranki proda določen znesek določene valute proti plačilu dogovorjenega zneska določene druge valute po dogovorjenem deviznem tečaju, ki je znan kot promptni devizni tečaj.	
Maturity date (datum zapadlosti)	Datum, na katerega se posel valutne zamenjave izteče in se valuta, ki je bila prodana na datum uporabe promptnega deviznega tečaja, kupi nazaj.	
Transaction sign (predznak posla)	Uporabi se, da se označi, ali se znesek v eurih, o katerem se poroča pod postavko nominalni znesek posla, na datum uporabe promptnega deviznega tečaja kupi ali proda.	To se mora nanašati na eurski del posla, tj. ali se na datum uporabe promptnega deviznega tečaja euri kupijo ali prodajo.
Transaction nominal amount (nominalni znesek posla)	Znesek v eurih, ki se kupi ali proda na dan uporabe promptnega deviznega tečaja.	
Foreign currency code (koda tuje valute)	Trimestna mednarodna koda ISO valute, ki se kupi/proda v zameno za eure.	

„Polje	Opis podatkov	Druga možnost poročanja (če obstaja) in druge prilagoditve
Foreign exchange spot rate (promptni devizni tečaj)	Devizni tečaj med eurom in tujo valuto, ki se uporabi za promptni del posla valutne zamenjave.	
Foreign exchange forward points (bazične točke do termenskega deviznega tečaja)	Razlika med promptnim deviznim tečajem in terminskim deviznim tečajem, izražena v bazičnih točkah, v skladu s prevladujočo tržno konvencijo za zadevni par valut.“	