

**EUROPEISKA CENTRALBANKENS FÖRORDNING (EU) 2015/1599**  
**av den 10 september 2015**  
**om ändring av förordning (EU) nr 1333/2014 om penningmarknadsstatistik (ECB/2015/30)**

ECB-RÅDET HAR ANTAGIT DENNA FÖRORDNING

med beaktande av stadgan för Europeiska centralbankssystemet och Europeiska centralbanken, särskilt artikel 5, med beaktande av rådets förordning (EG) nr 2533/98 av den 23 november 1998 om Europeiska centralbankens insamling av statistiska uppgifter <sup>(1)</sup>, särskilt artiklarna 5.1 och 6.4, och av följande skäl:

- (1) Enligt Europeiska centralbankens förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) <sup>(2)</sup> ska uppgiftslämnare rapportera statistik så att Europeiska centralbankssystemet, för utförandet av sina uppgifter, kan ta fram statistik om penningmarknadstransaktioner.
- (2) En uppsättning rapporteringsanvisningar med detaljerade parametrar för statistikrapportering enligt förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) kommer att ges ut till de nationella centralbankerna. Eftersom rapporteringsanvisningarna tolkar många termerna i den förordningen bör man av tydlighetsskäl även reflektera dessa ändringar.
- (3) Förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) bör ändras i enlighet med detta.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

*Artikel 1*

**Ändringar**

1. Bilaga I till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ersättas med bilaga I till den här förordningen.
2. Bilagorna II och III till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ändras i enlighet med bilaga II till den här förordningen.

*Artikel 2*

**Slutbestämmelser**

Denna förordning träder i kraft den den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i medlemsstaterna i enlighet med fördragen.

Utfärdad i Frankfurt am Main den 10 september 2015.

*På ECB-rådets vägnar*  
Mario DRAGHI  
ECB:s ordförande

<sup>(1)</sup> EGT L 318, 27.11.1998, s. 8.

<sup>(2)</sup> Europeiska centralbankens förordning (EU) nr 1333/2014 av den 26 november 2014 om penningmarknadsstatistik (ECB/2014/48) (EUT L 359, 16.12.2014, s. 97).

## BILAGA I

## "BILAGA I

**Rapporteringsordning för penningmarknadsstatistik som avser transaktioner med säkerhet**

## DEL 1

**TYP AV INSTRUMENT**

Uppgiftslämnare ska till Europeiska centralbanken (ECB) eller berörd nationell centralbank rapportera samtliga återköpsavtal och transaktioner som har ingåtts inom ramen för sådana avtal, däribland transaktioner avseende trepartsrepor som är denominerade i euro med en löptid på upp till och med ett år (definierade som transaktioner med en förfallodag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen) mellan uppgiftslämnaren och andra monetära finansinstitut (MFI), andra finansförmedlare, försäkringsbolag, pensionsinstitut, offentlig förvaltning eller centralbanker för investeringsändamål samt med icke-finansiella bolag som klassificeras som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.

## DEL 2

**TYP AV UPPGIFTER****1. Typ av transaktionsbaserade uppgifter <sup>(1)</sup> som ska rapporteras för varje transaktion**

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Transaction identifier (transaktionsidentifierare)	Den interna unika transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för varje transaktion.	Transaktionsidentifieraren är unik för varje transaktion som rapporteras en viss rapporteringsdag för ett visst segment av penningmarknaden.
Reporting date (rapporteringsdag)	Den dag då uppgifterna lämnas till ECB eller den nationella centralbanken.	
Electronic timestamp (elektronisk tidsstämpel)	Den tidpunkt då en transaktion ingås eller bokförs.	
Counterparty code (motpartskod)	En identifieringskod som används för att känna igen uppgiftslämnarens motpart för den rapporterade transaktionen.	Om transaktioner genomförs via en central motpart, måste den centrala motpartens LEI-kod (Legal Entity Identifier) anges.  Motpartskategori ska anges om transaktioner genomförs med icke-finansiella bolag, andra finansförmedlare, försäkringsbolag, pensionsinstitut, offentlig förvaltning och centralbanker samt för alla andra rapporterade transaktioner för vilka motpartens LEI-kod inte anges.
Counterparty code ID (motpartskods-ID)	Attribut som anger vilken typ av individuell motpartskod som lämnas.	Ska användas i samtliga fall. En individuell motpartskod kommer att lämnas.

<sup>(1)</sup> Standarder för elektronisk rapportering samt tekniska specifikationer för uppgifterna fastställs separat. Dessa finns på ECB:s webbplats ([www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)).

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Counterparty location (motpartens geografiska belägenhet)	Internationella standardiseringsorganisationens (ISO) landskod för det land där motparten har sin hemvist.	Obligatoriskt om det inte anges någon individuell motpartskod, annars frivilligt.
Transaction nominal amount (transaktionens nominella belopp)	Det belopp som ursprungligen lånats upp eller lånats ut.	
Collateral nominal amount (säkerhetens nominella belopp)	Det nominella beloppet för värdepapper som har lämnats som säkerhet.	Med undantag för trepartsrepor och andra transaktioner där det värdepapper som ställts som säkerhet inte identifieras via en individuell ISIN-kod (International Securities Identification Number).
Trade date (affärsdag)	Den dag då parterna ingår den finansiella transaktionen.	
Settlement date (avvecklingsdag)	Anskaffningsdagen, dvs. den dag då långivaren ska betala kontanter till låntagaren och låntagaren ska överföra värdepappret till långivaren.	För öppna återköpstransaktioner är detta den dag då överföringen avvecklas (även om det inte utväxlas några kontanter).
Maturity date (förfallodag)	Återköpsdagen, dvs. den dag då låntagaren ska återbetala kontanter till långivaren.	För öppna återköpstransaktioner är detta den dag då skuldbelopp och skuldränta ska återbetalas om transaktionen inte överförs ytterligare.
Transaction sign (transaktionstecken)	Upplåning av kontanter för repor eller utlåning av kontanter för omvända repor.	
ISIN of the collateral (säkerhetens ISIN-kod)	ISIN-kod som tilldelas värdepapper som emitteras på finansmarknaderna, bestående av 12 alfanumeriska tecken, och som är unik för varje värdepapper (enligt definitionen i ISO 6166).	Ska rapporteras med undantag för vissa typer av säkerhet.
Collateral type (typ av säkerhet)	Syftar till att identifiera vilken tillgångskategori som har lämnats som säkerhet om det inte har angetts någon individuell ISIN-kod.	Ska lämnas i samtliga fall då det inte har angetts någon individuell ISIN-kod.
Collateral issuer sector (säkerhetens emittentsektor)	Ska identifiera sektorn på den enhet som emitterar säkerheten om en individuell ISIN-kod saknas.	Ska rapporteras om en individuell ISIN-kod saknas.
Special collateral flag (identifierare för särskild säkerhet)	Syftar till att identifiera samtliga återköpstransaktioner som har genomförts mot en generell säkerhet samt samtliga återköpsavtal som har genomförts mot en särskild säkerhet. Frivilligt fält som uppgiftslämnaren endast behöver fylla i om det är möjligt.	Det är frivilligt att rapportera för detta fält.

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Deal rate (transaktionsnivå)	Den räntenivå, uttryckt i enlighet med penningmarknadens konvention Act/360, till vilken repotransaktionen ingicks och de utlånade kontanterna ersätts.	
Collateral haircut (säkerhets värderingsavdrag)	En riskkontrollåtgärd för underliggande säkerheter, där värdet på den underliggande säkerheten beräknas som marknadsvärdet för tillgångarna minus en viss procentsats (värderingsavdrag). För rapporteringsändamål beräknas säkerhetens värderingsavdrag som 100 minus kvoten mellan utlånade/upplånade kontanter och marknadsvärdet inklusive säkerhetens upplupna ränta.	I detta fält behöver endast transaktioner som avser enskilda säkerheter rapporteras.
Counterparty code of the tri-party agent (motpartskod för trepartsombud)	Motpartskod-ID för trepartsombudet.	Ska rapporteras för trepartsrepor.
Tri-party agent code ID (trepartsombudets kod-ID)	Attribut som anger vilken typ av individuell kod för trepartsombudet som lämnas.	Ska användas i samtliga fall då en individuell kod för trepartsombudet ska lämnas.

## 2. Väsentlighetsnivå

Transaktioner som genomförs med icke-finansiella bolag bör endast rapporteras om de genomförs med icke-finansiella bolag som har klassificerats som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten <sup>(1)</sup>.

## 3. Undantag

Koncerninterna transaktioner bör inte rapporteras.”

<sup>(1)</sup> Se Basel III: *The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools*, Committee on Banking Supervision, januari 2013, s. 23–27, finns på webbplatsen för Banken för internationell betalningsutjämning ([www.bis.org](http://www.bis.org)).

## BILAGA II

Bilagorna II och III till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ändras på följande sätt:

1. I bilaga II ska del 1 ersättas med följande:

"DEL 1

## TYP AV INSTRUMENT

1. Uppgiftslämnarna ska rapportera följande till Europeiska centralbanken (ECB) eller den berörda nationella centralbanken:
  - a) All uppgiftslämnarens upplåning där man använder sig av de instrument som anges i nedanstående tabell, som är denominerad i euro med en löptid på upp till och med ett år (definierad som transaktioner med en förfallodag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen) från andra monetära finansinstitut (MFI), andra finansförmedlare, försäkringsbolag, pensionsinstitut, offentlig förvaltning eller centralbanker för investeringsändamål samt från icke-finansiella bolag som klassificeras som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.
  - b) All utlåning till andra kreditinstitut med en löptid på upp till och med ett år (definierad som transaktioner med en förfallodag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen) via inlåning utan säkerhet eller sparkonton, eller via köp från de emitterande kreditinstituten av företagscertifikat, bankcertifikat, skuldebrev med rörlig ränta och andra skuldebrev med en löptid på upp till ett år.
2. I nedanstående tabell finns en mer ingående standardbeskrivning av instrumentkategorierna samt de transaktioner för vilka uppgiftslämnarna ska rapportera uppgifter till ECB. Om uppgiftslämnarna ska rapportera transaktionerna till sin nationella centralbank, bör den berörda nationella centralbanken överföra dessa beskrivningar av instrumentkategorier på nationell nivå i enlighet med denna förordning.

Typ av instrument	Beskrivning
Deposits (inlåning)	Räntebärande inlåning (inklusive sparkonton men exklusive transaktionskonton) utan säkerhet som antingen har en uppsägningstid eller också en löptid på högst ett år och som antingen görs (upplåning) eller placeras av uppgiftslämnaren.
Call accounts (sparkonton)	Likviditetskonto med daglig räntestjustering som ger rätt till räntebetalning eller –beräkning med regelbundna intervaller och där utbetalning först sker efter viss uppsägningstid.
Certificate of deposit (bankcertifikat)	En skuldförbindelse med fast löptid som emitteras av ett monetärt finansinstitut och som ger innehavaren rätt till en bestämd fast ränta för en bestämd period på upp till ett år.
Commercial paper (företagscertifikat)	En skuldförbindelse som antingen saknar säkerhet eller också säkerställs genom emittenten, som har en löptid på högst ett år och som antingen är räntebärande eller diskonterad.
Floating rate note (skuldebrev med rörlig ränta)	En skuldförbindelse med en löptid på högst ett år där de regelbundna räntebetalningarna beräknas på grundval av värdet, dvs. genom att det fastställs en underliggande referensränta såsom Euribor på förutbestämda dagar, så kallade räntestjusteringsdagar.

Typ av instrument	Beskrivning
Other short-term debt securities (andra kortfristiga skuldebrev)	<p>Icke-efterställda värdepapper – utom ägarandelar – som har en löptid på upp till ett år, som emitterats av uppgiftslämnare och som vanligen är överlåtbara och har en andrahandsmarknad, eller kan användas för avräkning på marknaden och som inte ger innehavaren någon form av äganderätt till det institut som har emitterat värdepapperet. Denna post omfattar följande:</p> <p>a) Värdepapper som ger innehavaren en ovillkorlig rätt till en fast eller avtalsenlig avkastning i form av kupongbetalningar och/eller en bestämd fast summa på en given dag (eller dagar) eller räknat från en vid emissionen bestämd dag.</p> <p>b) Icke-överlåtbara instrument som emitteras av uppgiftslämnare och som senare blir överlåtbara och omklassificeras som skuldebrev.”</p>

2. I bilaga III ska del 1 ersättas med följande:

”DEL 1

#### TYP AV INSTRUMENT

Uppgiftslämnarna ska rapportera följande till Europeiska centralbanken (ECB) eller den berörda nationella centralbanken:

- a) Alla valutaswaptransaktioner där euro vid en viss tidpunkt köps/säljs mot utländsk valuta och vid en senare tidpunkt återsäljs eller återköps till en på förhand avtalad terminkurs för denna valuta med en löptid på upp till och med ett år (definierad som transaktioner med en förfalldag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen för spotdelen i valutaswaptransaktionen) ingångna mellan uppgiftslämnaren och andra monetära finansinstitut (MFI), andra finansförmedlare, försäkringsbolag, pensionsinstitut, offentlig förvaltning eller centralbanker för investeringsändamål samt med icke-finansiella bolag som klassificeras som ’institutionell bankverksamhet’ enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.
- b) OIS-swaptransaktioner denominerade i euro mellan uppgiftslämnaren och andra monetära finansinstitut (MFI), andra finansförmedlare, försäkringsbolag, pensionsinstitut, offentlig förvaltning eller centralbanker för investeringsändamål samt med icke-finansiella bolag som klassificeras som ’institutionell bankverksamhet’ enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.”

3. I bilaga III ska tabellen i del 2 punkt 1 ersättas med följande:

”Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Transaction identifier (transaktionsidentifierare)	Den interna unika transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för varje transaktion.	Transaktionsidentifieraren är unik för varje transaktion som rapporteras en viss rapporteringsdag för ett visst segment av penningmarknaden.
Reporting date (rapporteringsdag)	Den dag då uppgifterna lämnas till ECB eller den nationella centralbanken.	
Electronic time stamp (elektronisk tidsstämpel)	Den tidpunkt då en transaktion ingås eller bokförs.	

”Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Counterparty code (motpartskod)	En identifieringskod som ska användas för att känna igen uppgiftslämnarens motpart för den rapporterade transaktionen.	Om transaktioner genomförs via en central motpart, måste den centrala motpartens LEI-kod (Legal Entity Identifier) anges.  Motpartskategori ska anges om transaktioner genomförs med icke-finansiella bolag, andra finansförmedlare, försäkringsbolag, pensionsinstitut, offentlig förvaltning och centralbanker samt för alla andra rapporterade transaktioner för vilka motpartens LEI-kod inte anges.
Counterparty code ID (motpartskods-ID)	Attribut som anger vilken typ av individuell motpartskod som lämnas.	Ska användas i samtliga fall. En individuell motpartskod kommer att lämnas.
Counterparty location (motpartens geografiska belägenhet)	Internationella standardiseringsorganisationens (ISO) landskod för det land där motparten har sin hemvist.	Obligatoriskt om det inte anges någon individuell motpartskod, annars frivilligt.
Trade date (affärsdag)	Den dag då parterna ingår den rapporterade finansiella transaktionen.	
Spot value date (spotdag)	Den dag då en part till en annan part säljer ett bestämt belopp av en bestämd valuta mot betalning av ett överenskommet belopp av en bestämd annan valuta på basis av en överenskommen valutakurs, den så kallade valutaspotkursen.	
Maturity date (förfallodag)	Den dag då valutaswaptransaktionen löper ut och den valuta som har sålts på spotdagen återköps.	
Transaction sign (transaktionstecken)	Används för att ange om det eurobelopp som rapporteras under transaktionens nominella belopp köps eller säljs på spotdagen.	Detta bör avse spotvärdet i euro, dvs. om euro köps eller säljs på spotdagen.
Transaction nominal amount (transaktionens nominella belopp)	Det eurobelopp som köps eller säljs på spotdagen.	
Foreign currency code (valutakod)	Den internationella tresiffriga ISO-koden för den valuta som köps/säljs i utbyte mot euro.	

"Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Foreign exchange spot rate (valutaspotkurs)	Den valutakurs mellan euron och den valuta som ska tillämpas på spotdelen i valutaswaptransaktionen.	
Foreign exchange forward points (valutaterminspunkter)	Differensen mellan valutaspotkursen och valutaterminskursen uttryckt i baspunkter, angiven enligt rådande marknadskonventioner för valutaparet."	