

**EUROOPA KESKPANGA MÄÄRUS (EL) 2019/113,****7. detsember 2018,****millega muudetakse määrust (EL) nr 1333/2014 rahaturgude statistika kohta (EKP/2018/33)**

EUROOPA KESKPANGA NÕUKOGU,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

võttes arvesse Euroopa Keskpangade Süsteemi ja Euroopa Keskpanga põhikirja, eelkõige selle artiklit 5,

võttes arvesse nõukogu 23. novembri 1998. aasta määrust (EÜ) nr 2533/98 statistilise teabe kogumise kohta Euroopa Keskpanga poolt, <sup>(1)</sup> eelkõige selle artikli 5 lõiget 1 ja artikli 6 lõiget 4,

olles konsulteerinud Euroopa Komisjoniga

ning arvestades järgmist:

- (1) Euroopa Keskpanga määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) <sup>(2)</sup> kohaselt peavad andmeesitajad esitama statistilised andmed, et Euroopa Keskpangade Süsteem (EKPS) saaks oma ülesannete täitmiseks koostada eurorahaturu statistikat.
- (2) Eurorahaturu statistika kõrge kvaliteedi tagamiseks tuleb muuta määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) teatavaid sätteid. Eelkõige on oluline tagada, et kõik andmeesitajad esitaksid Euroopa Keskpangale (EKP) või asjaomastele riikide keskpankadele (RKP) kõikide andmeesitaja ja finantsinstitutsioonide vaheliste tehingute andmed (v.a tehingud keskpankadega mitte investeerimise eesmärgil), samuti tehingud valitsemissektori ja teatavate mittefinantsettevõtetega. Lisaks tuleb tagada, et andmete kogumine võtab arvesse liidu aruandluses kohustuslikku juriidilise isiku tunnust (LEI).
- (3) Võttes arvesse eurorahaturu õigeaegse statistika kättesaadavuse tähtsust, tuleb samuti harmoneerida ja tugevdada andmeesitajate kohustust edastada teave RKPdele ja EKP-le õigeaegselt.
- (4) Statistilise teabe kogumisel, koostamisel ja edastamisel andmeesitajate poolt tuleb rakendada ettevaatusmeetmeid, et tagada andmete tervikluse järgimine. Eelkõige on oluline rõhutada, et RKPde ja EKP poolt saadud statistilised andmed peavad olema erapooletud, st esitama neutraalselt, objektiivselt ja usaldusväärset sõltumatut andmeesitaja poolt tuvastatavad tehingud, mis vastaks üldpõhimõtetele EKPSi avalikus kohustuses seoses Euroopa statistikaga <sup>(3)</sup>. Lisaks peavad andmeesitajad tagama, et kõik avastatud vead esitatud statistilises teabes parandatakse ja sellest teatakse EKP-le ja asjaomasele RKP-le esimesel võimalikul kuupäeval.
- (5) Nende sätete rakendamine tagab, et EKPSil on õigeaegsem, terviklik, detailne, harmoneeritud ja usaldusväärne eurorahaturu statistiline teave, mis võimaldab rahapoliitika ülekandemehhanismi süvaanalüüsi. Lisaks võib kogutud andmeid kasutada euro üleõoturu tagamata intressimäära kujundamiseks ja haldamiseks.
- (6) Seetõttu tuleb määrust (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) vastavalt muuta,

<sup>(1)</sup> EÜT L 318, 27.11.1998, lk 8.<sup>(2)</sup> Euroopa Keskpanga 26. novembri 2014. aasta määrus (EL) nr 1333/2014 rahaturgude statistika kohta (EKP/2014/48) (ELT L 359, 16.12.2014, lk 97).<sup>(3)</sup> Avaldatud EKP veebilehel [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

ON VASTU VÖTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

*Artikkel 1*

**Muudatused**

Määrust (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) muudetakse järgmiselt:

1) artiklit 1 muudetakse järgmiselt:

a) lisatakse järgmine punkt 5a:

„5a) „finantsinstitutsioonid“ – institutsionaalsed üksused, mis on iseseisvad juriidilised üksused ja turutootjad ning tegelevad peamiselt finantsteenuste osutamisega, kooskõlas sätestusega muudetud Euroopa arvepidamise süsteemis (ESA 2010), mis on kehtestatud Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrusega (EL) nr 549/2013 (\*);

(\*) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 21. mai 2013. aasta määrus (EL) nr 549/2013 Euroopa Liidus kasutatava Euroopa rahvamajanduse ja regionaalse arvepidamise süsteemi kohta (ELT L 174, 26.6.2013, lk 1).“;

b) punktid 3 kuni 5 jäetakse välja;

c) punkt 9 asendatakse järgmisega:

„9) „rahaturgude statistika“ – statistika rahaturuinstrumentidega sooritatud tagatud tehingute, tagamata tehingute ja tuletisinstrumentidehingute kohta, mis on vastaval aruandlusperioodil toimunud andmeesitaja ja finantsinstitutsioonide vahel (v.a tehingud keskpangadega mitte investeerimise eesmärgil), samuti tehingud valitsemissektori ja mittefinantsettevõtete, mis on liigitatud hulgiettevõteteks Basel III LCR raamistikus, v.a kontsernisisised tehingud;“;

d) punkt 14 asendatakse järgmisega:

„14) „vaadeldav andmeid esitav üldkogum“ – euroala residentidest rahaloomeasutused, v.a keskpangad ja rahaturufondid, mis võtavad vastu eurodes väeringustatud hoiuseid ja/või emiteerivad muid võlainstrumente ja/või annavad eurodes väeringustatud laene, mis on osutatud I, II ja III lisas, muudele finantsinstitutsioonidele, valitsemissektorile või mittefinantsettevõtetele (või saavad laene muudelt finantsinstitutsioonidelt, valitsemissektorilt või mittefinantsettevõtelt);“;

e) lisatakse järgmine punkt 20a:

„20a) „krediidiasutus“ – mõistet kasutatakse Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruse (EL) nr 575/2013 (\*) artikli 4 lõike 1 punktis 1 määratletud tähenduses;

(\*) Euroopa Parlamendi ja nõukogu 26. juuni 2013. aasta määrus (EL) nr 575/2013 krediidiasutuste ja investeerimisühingute suhtes kohaldatavate usaldatavusnõuete kohta ja määruse (EL) nr 648/2012 muutmise kohta (ELT L 176, 27.6.2013, lk 1).“;

f) punkt 25 asendatakse järgmisega:

„25) „indeksipõhine üleööintressi-vahetustehing“ ehk „OIS“ (*overnight index swap*) – intressimäärade vahetustehing, milles perioodi ujuv intressimäär võrdub üleööintressimäärade (või indeksipõhise üleööintressimäärade) geomeetrilise keskmisega teatava tähtaja jooksul. Lõppmakse arvutatakse, lahutades fikseeritud intressimäärast OIS tähtaja jooksul kumuleerunud üleööintress ja rakendatakse saadud tulemus tehingu nominaalsummale.“;

2) artiklit 3 muudetakse järgmiselt:

a) lõige 1 asendatakse järgmisega:

„1. Rahaturgude statistika regulaarse koostamise huvides esitavad andmeesitajad oma residentsuse liikmesriigi RKP-le iga päev konsolideeritud statistilise teabe rahaturuinstrumentide kohta, mis hõlmab nende liidu ja EFTA filiaale. Nõutav statistiline teave on täpsustatud I, II ja III lisas. Andmeesitajad esitavad nõutava statistilise teabe kooskõlas IV lisas sätestatud edastamise, täpsuse, mõistete vastavuse, andmete parandamise ja andmete tervikluse miinimumnõuetega. RKPd edastavad andmeesitajatelt saadud statistilise teabe EKP-le kooskõlas käesoleva määruse artikli 4 lõikega 2.“;

## b) lõige 2 asendatakse järgmisega:

„2. RKPd määratlevad ja rakendavad aruandluskorra, mida andmeesitajad peavad rahaturu instrumentide osas järgima. See aruandluskord peab tagama nõutava statistilise teabe esitamise ja võimaldama IV lisas sätestatud miinimumnõuete täitmise täpset kontrolli.“;

## c) lõige 5 asendatakse järgmisega:

„5. RKPd määratlevad ja rakendavad aruandluskorra, mida andmeesitajad peavad järgima kooskõlas oma riigi statistikaaruandluse nõuetega. RKPd tagavad, et nende riigi aruandlusnõuete kohaselt peavad lisaandmeesitajad järgima nõudeid, mis on samaväärsed käesoleva määruse artiklites 6 kuni 8, artikli 10 lõikes 3, artiklis 11 ja artiklis 12 sätestatutega. RKPd tagavad, et need aruandlusnõuded võimaldavad saada nõutava statistilise teabe ning täpselt kontrollida IV lisas sätestatud miinimumnõuete täitmist.“;

## 3) artiklit 4 muudetakse järgmiselt:

## a) lõige 1 asendatakse järgmisega:

„1. Kui RKP otsustab vastavalt artikli 3 lõikele 3, et andmeesitajad esitavad I, II ja III lisas osutatud statistilise teabe otse EKP-le, edastavad andmeesitajad selle teabe EKP-le üks kord päevas ajavahemikus 18.00 tehingupäeval kuni 7.00 Kesk-Euroopa aja (\*) järgi esimesel TARGET2 arvelduspäeval pärast tehingupäeva.

(\*) Kesk-Euroopa aeg võtab arvesse üleminekut Kesk-Euroopa suveajale.“;

## b) lõige 2 asendatakse järgmisega:

„2. Kõikidel muudel juhtudel peale lõikes 1 nimetatute edastavad RKPd EKP-le statistilise päevateabe rahaturgude kohta kooskõlas I, II ja III lisaga, mis on saadud artikli 2 lõike 2 kuni 4 alusel valitud andmeesitajatelt või artikli 2 lõike 6 alusel valitud täiendavatelt andmeesitajatelt, üks kord päevas enne kella 7.00 Kesk-Euroopa aja järgi esimesel TARGET2 arvelduspäeval pärast tehingupäeva.“;

## c) lisatakse järgmine lõige 5:

„5. Andmeesitaja käesolevast artiklist tulenevate kohustuste täitmise kindlaks tegemisel loetakse edastamise miinimumnõuete rikkumine IV lisa punkti 1 alapunktide i ja ii alusel rikkumiseks, mis vastab nende aruandlusnõuete rikkumisele, mille alusel tehakse kindlaks rikkumine EKP statistikaaruandluse nõuete eiramise raamistikus.“;

## 4) artikkel 5 jäetakse välja;

5) määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) I lisa asendatakse käesoleva määruse I lisa sätetega;

6) määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) II lisa asendatakse käesoleva määruse II lisa sätetega;

7) määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) III lisa asendatakse käesoleva määruse III lisa sätetega;

8) määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) IV lisa asendatakse käesoleva määruse IV lisa sätetega.

*Artikkel 2***Lõppsätted**

Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Seda kohaldatakse alates 15. märtsist 2019.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja liikmesriikides vahetult kohaldatav kooskõlas aluslepingutega.

Frankfurt Maini ääres, 7. detsember 2018

*EKP nõukogu nimel*

*EKP president*

Mario DRAGHI

---

I LISA

„I LISA

**Tagatud tehingutega seotud rahaturgude statistika aruandlusvorm**

1. OSA

**INSTRUMENDILIIK**

Andmeesitajad esitavad Euroopa Keskpannangale (EKP) või asjaomasele riigi keskpangale (RKP) kõik tagasiostulepingud ning nende alusel tehtud ja eurodes väeringustatud üheaastase või lühema tähtajaga (st kuni 397 päeva pärast arvelduskuupäeva) repotehingud, sealhulgas kolmepoolsed repotehingud, andmeesitaja ja finantsinstitutsioonide vahel (v.a tehingud keskpangadega mitte investeerimise eesmärgil), samuti tehingud valitsemissektori ja mittefinantssettevõtete, mis on liigitatud hulgiarvetele Basel III LCR raamistikus. Kontsernisisesed tehingud jäetakse välja.

2. OSA

**ANDMETE LIIGID**

1. Iga tehingu kohta esitatavate tehingupõhiste andmete (\*) liigid:

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Reported transaction status (esitatud tehingu staatus)	See omadus näitab, kas tehing on uus tehing, eelnevalt esitatud tehingu muudatus, eelnevalt esitatud tehingu tühistamine või parandamine.	
Novation status (uuen-damise staatus)	See omadus näitab, kas tehing on uuendamise.	
Unique transaction identifier (tehingu kordumatu tunnus)	Kordumatu tunnuscode võimaldab tehingu tuvastada vastavas turuosas.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Proprietary transaction identification (andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja iga tehingu kohta kasutab. Tehingu tunnus sisekasutuses on kordumatu iga esitatud tehingu osas rahaturusegmendi ja andmeesitaja kohta.	
Related proprietary transaction identification (seonduva andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja kasutab esialgse tehingu kohta, mida seejärel uuendatakse.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Counterparty proprietary transaction identification (vastaspoole andmeesitaja tehingu tunnus)	Andmeesitaja tehingu tunnus, mis omistatakse andmeesitaja sama tehingu vastaspoolele.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Counterparty identification (vastaspoole tunnus)	Tunnuskood, mida kasutatakse selleks, et tuvastada andmeesitaja vastaspool teatavas tehingus.	Juriidilise isiku tunnust (LEI) tuleb kasutada kõikidel juhtudel, kui vastaspoolele on see tunnus antud. Kui juriidilise isiku tunnust ei ole antud, tuleb osutada vastaspoole sektor ja asukoht.
Counterparty sector (vastaspoole sektor)	Vastaspoole institutsionaalne sektor	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Counterparty location (vastaspoole asukoht)	Rahvusvahelise Standardiorganisatsiooni (ISO) riigikood, mis tähistab vastaspoole registreerimise riiki.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Tri-party agent identification (kolmepoolse agendi tunnus)	The counterparty identifier of the tri-party agent (kolmepoolse agendi vastaspoole tunnus)	Selle välja täitmine on nõutav kolmepoolse agendi tehingute korral. Juriidilise isiku tunnust (LEI) tuleb kasutada kõikidel juhtudel, kui agendile on see tunnus antud.
Reporting date (aruandekuupäev)	Aruandlusdokumendis kajastatud tehinguga seotud ajavahemiku algus- ja lõppkuupäev.	
Electronic time stamp (ajatempel)	Tehingu teostamise või registreerimise kellaeg.	
Trade date (tehingupäev)	Kuupäev, mil pooled finantstehingu sõlmivad.	
Settlement date (arvelduskuupäev)	Kuupäev, mil sularaha vahetatakse vara vastu kooskõlas lepinguga.	Pikendatud lahtiste tagasiostutehingute puhul on selleks kuupäev, mil pikendamine jõustub (ka siis, kui raha üle ei anta).
Maturity date (tähtpäev)	Tagasiostu kuupäev, st kuupäev, mil sularaha tagastatakse või saadakse panditud või tagatisena saadud vara eest.	
Transaction type (tehinguliik)	See omadus näitab, kas tehing tehakse sularaha laenusaamise või -andmisega.	
Transaction nominal amount (teingu nominaalsumma)	Algselt laenuks võetud või antud summa eurodes.	
Rate type (intressimäära liik)	See näitab, kas instrument on fikseeritud või ujuva intressimääraga.	
Deal rate (teingu intressimäär)	Rahaturu meetodil ACT/360 väljendatud intressimäär, millega repotehing sõlmiti ja millega laenuks antud rahasumma tagasi makstakse.	Selle välja täitmine on nõutav fikseeritud intressimääraga instrumentide osas

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Reference rate index (baasintressimäära indeks)	Aluseks oleva baasintressimäära rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber (ISIN), mille alusel perioodi intressimäär arvutatakse.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ujuva intressimääraga instrumentide osas.
Basis point spread (baaspunktide vahe)	Baaspunktide arv, mis lisatakse (kui on positiivne) või lahutatakse (kui on negatiivne) aluseks olevast määrast tegeliku kohaldatava intressimäära arvutamiseks teataval perioodil ujuva intressimääraga instrumendi emissioonil.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ujuva intressimääraga instrumentide osas.
Collateral ISIN (tagatise ISIN)	Tagatud vara ISIN	Selle välja täitmine on vabatahtlik kolmepoolsete repotehingute puhul, mis tehakse ilma ISINita väärtpaberite korvi osas või ilma ISINita tagatise liikide osas. Juhul kui tagatud vara ISINit ei esitata tuleb esitada tagatise liik, tagatise emiteerija sektor ja tagatiste kogum.
Collateral pool (koondtagatis)	Tuleb osutada, kas tagatiseks esitatud vara on koondtagatis.	
Collateral type (tagatise liik)	See näitab tagatiseks antud vara liiki.	Kohustuslik, kui tagatise ISINit ei esitata.
Collateral issuer sector (tagatise emiteerija sektor)	Tagatise emiteerija institutsionaalne sektor.	Kohustuslik, kui tagatise tunnust ei esitata.
Special collateral indicator (eritagatise tunnus)	Selleks, et tuvastada kõik üldtagatise vastu sõlmitud repotehingud ja eritagatise vastu sõlmitud repotehingud.	Täidetakse ainult siis, kui andmeesitajal on võimalik seda teha.
Collateral nominal amount (tagatise nimiväärtus)	Antud tagatise nimiväärtus eurodes.	Vabatahtlik kolmepoolsete repotehingute jm tehingute puhul, kus antud tagatist ei näidata rahvusvahelise väärtpaberite identifitseerimisnumbri (ISIN-koodi) abil.
Collateral haircut (tagatise väärtuskärpe)	Riskiohjemeede, mille kohaselt arvestatakse tagatise väärtus vastava vara turuväärtusest teatava protsentuaalse osa (ehk väärtuskärpe) võrra väiksemaks.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ühe tagatisega tehingute korral.

## 2. Olulisuse künnis

Mittefinantsettevõtete sõlmitud tehingute kohta tuleb aruanne esitada ainult siis, kui need mittefinantsettevõtted on liigitatud hulgettevõteteks Basel III LCR raamistikus (\*\*).

(\*) Elektroonilised aruandlusstandardid ja andmete tehnilised spetsifikaadid avaldatakse eraldi. Need on avaldatud EKP veebilehel [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

(\*\*) Vt „Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools“, Baseli pangajärelevalve komitee, jaanuar 2013, lk 23–27, avaldatud Rahvusvaheliste Arvelduste Panga veebilehel [www.bis.org](http://www.bis.org).”

II LISA

„II LISA

**Tagamata tehingutega seotud rahaturgude statistika aruandlusvorm**

1. OSA

**INSTRUMENTILIIK**

1. Andmeesitajad esitavad Euroopa Keskpangale (EKP) või asjaomasele riigi keskpangale (RKP):

- a) kõik järgmises tabelis loetletud instrumente kasutades sõlmitud ja eurodes väeringustatud üheaastase või lühema tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) laenuid, mis andmeesitaja on saanud finantsinstitutsioonidelt (v.a tehingud keskpankadega mitte investeerimise eesmärgil), valitsemissektorilt ja mittefinantsettevõtetele, mis on liigitatud hulgiettevõtetele Basel III LCR raamistikus;
- b) kõik muude krediidasutustega sõlmitud üheaastase või lühema tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) laenuandmistehingud tagamata hoiuste või nõudmiseni kontode kujul või emiteerivatelt krediidasutustelt kuni üheaastase tähtajaga kommerts-paberite, hoiusertifikaatide, ujuva intressimääraga võlakirjade või muude võlaväärtpaberite ostmine.

Lõike 1 punktide a ja b osas jäetakse välja kontsernisisesed tehingud.

2. Järgmises tabelis on instrumentide liikide standardkirjeldus tehingute osas, mida andmeesitajad on kohustatud EKP-le esitama. Kui andmeesitajad on kohustatud esitama tehingute kohta aruandeid oma RKP-le, peab see RKP need instrumentide liikide kirjeldused riigis vastavalt käesolevale määrusele üle võtma.

Instrumentiliik	Kirjeldus
Deposits (hoiused)	Andmeesitaja poolt (laenuks) võetud või antud tagamata, intresse kandvad hoiused, mis on kas etteatamisega lõpetatavad või mille tähtaeg ei ületa üht aastat (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) (sealhulgas nõudmiseni kontod, kuid mitte arvelduskontod).
Call account/Call money (nõudmiseni konto/sularaha)	Igapäevaselt muutuva intressimäärana, regulaarse intressimakse ja -arvestuse ning etteatamistähtajaga lõpetavad sularahakontod. Säästukonto, millelt saab raha välja võtta etteatamisega.
Certificate of deposit (hoiusertifikaat)	Rahaloomeasutuse poolt emiteeritud tähtajaline võlainstrument (kaubeldav või mittekaubeldav), mis annab valdajale õiguse konkreetsele fikseeritud intressimäärale kuni üheaastase (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) fikseeritud tähtaja jooksul, mis võib olla kas intressiga või diskonteeritud.
Commercial paper (kommerts-paber)	Tagamata kuni üheaastase tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) võlainstrument, mis on emiteeritud rahaloomeasutuse poolt ja kannab intresse või on diskonteeritud.
Asset backed commercial paper (varaga tagatud kommerts-paber)	Rahaloomeasutuse poolt emiteeritud kuni üheaastase tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) võlainstrument, mis kannab intresse või on diskonteeritud ja mingis vormis tagatud.
Floating rate note (ujuva intressimääraga võlakiri)	Kuni üheaastase tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) võlainstrument, mille puhul perioodilisi intressiväljamakseid arvutatakse väärtuse põhjal, st fikseerides baasmäärana, nagu nt Euro Interbank Offered Rate (Euribor), ette kindlaks määratud kuupäevadel (fikseerimis-päevadel).



Instrumendiliik	Kirjeldus
Other short-term debt securities (muud lühiajalised võlaväärtpaberid)	<p>Andmeesitajate poolt emiteeritud kuni üheaastase tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast) allutamata väärtpaberid, v.a omandiväärtpaberid, mis on üldjuhul vabalt kaubeldavad ja millega kaubeldakse järelturgudel või mis on turul tasaarvestatavad ega anna valdajale omandiõigust väärtpaberi emiteerinud ettevõttes. Sii kuuluvad:</p> <p>a) väärtpaberid, mis annavad valdajale tingimusteta õiguse fikseeritud või lepinguliselt kindlaks määratavale tulule, mis seisneb kupongimaksetes ja/või ettenähtud fikseeritud summas, mis makstakse välja kindlal kuupäeval (või kindlatel kuupäevadel) või alates emiteerimise ajal kindlaks määratud kuupäevast;</p> <p>b) andmeesitajate poolt emiteeritud mittekaubeldavad instrumendid, mis muutuvad hiljem vabalt kaubeldavaks ja liigitatakse ümber „võlaväärtpaberiteks“.</p>

## 2. OSA

## ANDMETE LIIGID

## 1. Iga tehingu kohta esitatavate tehingupõhiste andmete (\*) liigid:

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Reported transaction status (esitatud tehingu staatus)	See omadus näitab, kas tehing on uus tehing, eelnevalt esitatud tehingu muudatus, eelnevalt esitatud tehingu tühistamine või parandamine.	
Novation status (uendamise staatus)	See omadus näitab, kas tehing on uuendamine.	
Unique transaction identifier (tehingu kordumatu tunnus)	Kordumatu tunnuskoode võimaldab tehingu tuvastada vastavas turuosas.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Proprietary transaction identification (andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja iga tehingu kohta kasutab. Andmeesitaja tehingu tunnus on kordumatu iga esitatud tehingu osas rahaturusegmendi ja andmeesitaja kohta.	
Related proprietary transaction identification (seonduva andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja kasutab esialgse tehingu kohta, mida seejärel uuendatakse.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Counterparty proprietary transaction identification (vastaspoole andmeesitaja tehingu tunnus)	Andmeesitaja tehingu tunnus, mis omistatakse andmeesitaja sama tehingu vastaspoolele.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Counterparty identification (vastaspoole tunnus)	Tunnuskood, mida kasutatakse selleks, et tuvastada andmeesitaja vastaspool teatavas tehingus.	Juriidilise isiku tunnust (LEI) tuleb kasutada kõikidel juhtudel, kui vastaspoolele on see tunnus antud. Kui juriidilise isiku tunnust ei ole antud, tuleb osutada vastaspoole sektor ja asukoht.
Counterparty sector (vastaspoole sektor)	Vastaspoole institutsionaalne sektor.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Counterparty location (vastaspoole asukoht)	Rahvusvahelise Standardiorganisatsiooni (ISO) riigikood, mis tähistab vastaspoole registreerimise riiki.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Reporting date (aruandekuupäev)	Aruandlusdokumendis kajastatud tehingu seotud ajavahemiku algus- ja lõppkuupäev.	
Electronic time stamp (ajatempel)	Tehingu teostamise või registreerimise kellaeg.	
Trade date (tehingupäev)	Kuupäev, mil pooled finantstehingu sõlmivad.	
Settlement date (arvelduskuupäev)	Kuupäev, mil tehingupooled kannavad üle sularaha või mil arveldatakse võlainstrumendi ost või müük.	Nõudmiseni kontode (call accounts) ja muu tagamata, etteatamisega lõpetatava laenuvõtmise/laenuandmise korral kuupäev, mil hoius aegub (s.o kuupäev, mil see oleks tagasi makstud, kui see oleks sisse nõutud/asendamata jäetud).
Maturity date (tähtpäev)	Kuupäev, mil laenuvõtja peab laenuandjale raha tagasi maksma või mil võlainstrumendi tähtaeg lõpeb ja tuleb täita tagasimaksekohustus.	
Instrument type (instrumendi liik)	Instrument, mille kaudu toimub laenuandmine/-võtmine.	
Transaction type (tehinguliik)	See omadus näitab, kas tehing tehakse sularahas laenusaamise või -andmisega.	
Transaction nominal amount (tehingu nominaalsumma)	Kontodele saadud või antud laenusumma eurodes Võlaväärtpaberite korral on see summa emiteeritud/ostetud väärtpaberite nimiväärtus.	
Transaction deal price (tehinguhind)	Ostuhind (st hind, milles sisaldub kogunenud intress), millega väärtpaber emiteeritakse või kaubeldakse protsendipunktides.	Tagamata hoiuste jaoks on see 100.
Rate type (intressimäära liik)	See näitab, kas instrument on fikseeritud või ujuva intressimääraga.	

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Deal rate (teingu intressimäär)	Rahaturu meetodil ACT/360 väljendatud intressimäär, millega hoius avati ja millega laenuks antud rahasumma tagasi makstakse. Võlainstrumentide puhul on see efektiivne intressimäär, mida väljendatakse rahaturu meetodil ACT/360 ja millega instrument emiteeriti või osteti.	Selle välja täitmine on nõutav ainult fikseeritud intressmääraga instrumentide osas
Reference rate index (baasintressimäära indeks)	Aluseks oleva baasintressimäära rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimismärk (ISIN), mille alusel perioodi intressimäär arvutatakse.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ujuva intressmääraga instrumentide osas.
Baaspunktide vahe	Baaspunktide arv, mis lisatakse (kui on positiivne) või lahutatakse (kui on negatiivne) aluseks olevast määrast tegeliku kohaldatava intressimäära arvutamiseks teataval perioodil ujuva intressimääraga instrumendi emissioonil.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ujuva intressmääraga instrumentide osas.
Call or put (ost või müük)	See näitab, kas instrument on ostu- või müügioptsiooniga.	Selle välja täitmine on nõutav ainult fikseeritud intressmääraga instrumentide osas
First call/put date (esimene ostu/müügi kuupäev)	Esimene kuupäev, mil ostu- või müügioptsiooni saab kasutada.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ostu- või müügioptsiooniga instrumentide puhul, kui optsiooni saab kasutada ühel või enamal päeval.
Call/put notice period (ostu või müügi etteteatamistähtaeg)	Kalendripäevade arv, mis instrumendi valdaja või emitent annab instrumendi emitendile või valdajale enne ostu- või müügioptsiooni kasutamist.	Selle välja täitmine on nõutav ainult ostu- või müügioptsiooniga instrumentide/tehingute ja eelnevalt kokku lepitud etteteatamistähtajaga väljavõetavate hoiuste osas.

## 2. Olulisuse künnis

Mittefinantsettevõtete solumitid tehingute kohta tuleb aruanne esitada ainult siis, kui need mittefinantsettevõtted on liigitatud hulgiäretvõteteks Basel III LCR raamistikus.

(\*) Elektroonilised aruandlusstandardid ja andmete tehnilised spetsifikaadid avaldatakse eraldi. Need on avaldatud EKP veebilehel [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

## III LISA

## „III LISA

**Tuletisinstrumentidehingutega seotud rahaturgude statistika aruandlusvorm**

## 1. OSA

**INSTRUMENTIDE LIIGID**

Andmeesitajad esitavad Euroopa Keskpannale (EKP) või asjaomasele riigi keskpangale (RKP):

- a) kõik välisvaluuta vahetustehingud, mille puhul eurot ostetakse/müüakse välisvaluuta eest hetkekursiga ning müüakse või ostetakse tulevasel kuupäeval välisvaluuta eest tagasi eelnevalt kokku lepitud üheaastase või lühema tähtajaga (st kuni 397 päeva alates arvelduskuupäevast, mil välisvaluuta arveldati vahetustehingu hetkekursi osa) tähtpäevakursiga, andmeesitaja ja finantsinstitutsioonide vahel (v.a tehingud keskpankadega mitte investeerimise eesmärgil), samuti tehingud valitsemissektori ja mittefinantsettevõtete, mis on liigitatud hulgiettevõteteks Basel III LCR raamistikus;
- b) eurodes vääringustatud indeksipõhised üleööintressi-vahetustehingud (OISid) andmeesitaja ja finantsinstitutsioonide vahel (v.a tehingud keskpankadega mitte investeerimise eesmärgil), samuti tehingud valitsemissektori või mittefinantsettevõtete, mis on liigitatud hulgiettevõteteks Basel III LCR raamistikus.

Eespool toodud punktide a ja b osas jäetakse välja kontsernisisesed tehingud.

## 2. OSA

**ANDMETE LIIGID**

1. Iga välisvaluuta vahetustehingu kohta esitatavate tehingupõhiste andmete (\*) liigid:

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Reported transaction status (tehingu staatus aruande esitamise ajal)	See omadus näitab, kas tehing on uus tehing, eelnevalt esitatud tehingu muudatus, eelnevalt esitatud tehingu tühistamine või parandamine.	
Novation status (uuendamise staatus)	See omadus näitab, kas tehing on uuendamine.	
Unique transaction identifier (tehingu kordumatu tunnuscode)	Kordumatu tunnuscode võimaldab tehingu tuvastada vastavas turuosas.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Proprietary transaction identification (andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja iga tehingu kohta kasutab. Andmeesitaja tehingu tunnus on kordumatu iga esitatud tehingu osas rahaturusegmendi ja andmeesitaja kohta.	
Related proprietary transaction identification (seonduva andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja kasutab esialgse tehingu kohta, mida seejärel uuendatakse.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Counterparty proprietary transaction identification (vastaspoole andmeesitaja tehingu tunnus)	Andmeesitaja tehingu tunnus, mis omistatakse andmeesitaja sama tehingu vastaspoolele.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Counterparty identification (vastaspoole tunnus)	Tunnuskood, mida kasutatakse selleks, et tuvastada andmeesitaja vastaspool teatavas tehingus.	Juriidilise isiku tunnust (LEI) tuleb kasutada kõikidel juhtudel, kui vastaspoolele on see tunnus antud. Kui juriidilise isiku tunnust ei ole antud, tuleb osutada vastaspoole sektor ja asukoht.
Counterparty sector (vastaspoole sektor)	Vastaspoole institutsionaalne sektor.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Counterparty location (vastaspoole asukoht)	Rahvusvahelise Standardiorganisatsiooni (ISO) riigikood, mis tähistab vastaspoole registreerimise riiki.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Reporting date (aruandekuupäev)	Aruandlusdokumendis kajastatud tehingu seotud ajavahemiku algus- ja lõppkuupäev.	
Electronic time stamp (ajatempel)	Tehingu teostamise või registreerimise kellaeg.	
Trade date (tehingupäev)	Kuupäev, mil pooled finantstehingu sõlmivad.	
Spot value date (hetkekursi kuupäev)	Kuupäev, mil üks pool müüb teisele poolele teatava summa teatavat valuutat ja teine pool maksab selle eest kokkulepitud summa teatavas teises valuutas vastavalt kokkulepitud vahetuskursile, mida nimetatakse hetkekursiks.	
Maturity date (tähtpäev)	Kuupäev, mil välisvaluuta vahetustehingu tähtaeg lõpeb ja hetkekursi kuupäeval müüdüd valuuta ostetakse tagasi.	
Foreign exchange transaction type (välisvaluutatehingu liik)	See omadus osutab, kas tehingu nominaalsummas näidatud eurod on hetkekursi kuupäeval ostetud või müüdüd. See peaks viitama hetketehingule euro seisukohast, st sellele, kas hetkekursi kuupäeval osteti või müüdi eurosid.	
Transaction nominal amount (tehingu nominaalsumma)	Välisvaluuta vahetustehingu nimiväärtus eurodes.	
Foreign currency code (välisvaluuta kood)	Eurode eest ostetud/müüdüd välisvaluuta rahvusvaheline kolmekohaline ISO kood.	
Foreign exchange spot rate (vahetustehingu hetkekurs)	Vahetuskurs euro ja välisvaluuta vahel selles välisvaluuta vahetustehingu osas, mida kohaldatakse välisvaluuta vahetustehingu esimesele osale.	

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Foreign exchange forward points (tähtpäevakursi erinevus hetkekursist)	Vahetustehingus rakendatava tähtpäevakursi ja hetkekursi vahe baaspunktides väljendatuna valuutapaari suhtes valdavalt kasutatavate turutavade kohaselt.	

2. Iga OIS tehingu kohta esitatavate tehingupõhiste andmete liigid:

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Reported transaction status (tehingu staatus aruande esitamise ajal)	See omadus näitab, kas tehing on uus tehing, eelnevalt esitatud tehingu muudatus, eelnevalt esitatud tehingu tühistamine või parandamine.	
Novation status (uuenamise staatus)	See omadus näitab, kas tehing on uuendamine.	
Unique transaction identifier (tehingu kordumatu tunnuscode)	Kordumatu tunnuscode võimaldab tehingu tuvastada vastavas turuosas.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Proprietary transaction identification (andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja iga tehingu kohta kasutab. Andmeesitaja tehingu tunnus on kordumatu iga esitatud tehingu osas rahaturusegmeni ja andmeesitaja kohta.	
Related proprietary transaction identification (seonduva andmeesitaja tehingu tunnus)	Kordumatu tehingutunnus sisekasutuses, mida andmeesitaja kasutab esialgse tehingu kohta, mida seejärel uuendatakse.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Counterparty proprietary transaction identification (vastaspoole andmeesitaja tehingu tunnus)	Andmeesitaja tehingu tunnus, mis omistatakse andmeesitaja sama tehingu vastaspoolele.	Väli täidetakse, kui teave on kättesaadav.
Counterparty identification (vastaspoole tunnus)	Tunnuscode, mida kasutatakse selleks, et tuvastada andmeesitaja vastaspool teatavas tehingus.	Juriidilise isiku tunnust (LEI) tuleb kasutada kõikidel juhtudel, kui vastaspoolele on see tunnus antud. Kui juriidilise isiku tunnust ei ole antud, tuleb osutada vastaspoole sektor ja asukoht.
Counterparty sector (vastaspoole sektor)	Vastaspoole institutsionaalne sektor.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Counterparty location (vastaspoole asukoht)	ISO riigikood, mis tähistab vastaspoole registreerimise riiki.	Kohustuslik, kui vastaspoole tunnust ei esitata.
Reporting date (aruandekuupäev)	Aruandlusdokumendis kajastatud tehinguga seotud ajavahemiku algus- ja lõppkuupäev.	

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Electronic time stamp (ajatem- pel)	Tehingu teostamise või registreerimise kellaaeg.	Vabatahtlik.
Trade date (tehingupäev)	Kuupäev, mil pooled finantstehingu sõl- mivad.	
Alguskuupäev	Kuupäev, mil arvutatakse üleöointressi- määra ujuv osa.	
Maturity date (tähtpäev)	Ajavahemiku viimane kuupäev, mil arvu- tatakse üleöö liitintress.	
Fikseeritud intressimäär	OIS väljamakse arvutamisel kasutatav fik- seeritud intressimäär	
Transaction type (tehinguliik)	See omadus näitab, kes andmeesitaja maksab või saab fikseeritud intressi.	
Transaction nominal amount (teingu nominaalsumma)	OIS nominaalsumma.	

### 3. Olulisuse künnis

Mittefinantsettevõtetega sõlmitud tehingute kohta tuleb aruanne esitada ainult siis, kui need mittefinantsettevõtted on liigitatud hulgiettevõteteks Basel III LCR raamistikus.

(\*) Elektroonilised aruandlusstandardid ja andmete tehnilised spetsifikaadid avaldatakse eraldi. Need on avaldatud EKP veebilehel [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

IV LISA

„IV LISA

### Miinumunõuded, mida peab täitma tegelik andmeid esitav üldkogum

Euroopa Keskpanga (EKP) statistilise aruandluse nõuete järgimiseks peavad andmeesitajad täitma järgmisi miinumunõudeid.

1. Edastamise miinumunõuded:

- i) andmed tuleb edastada õigeaegselt ning EKP ja asjaomase riigi keskpanga (RKP) seatud tähtaegade jooksul;
- ii) statistilised aruanded tuleb esitada sellisel kujul ja sellises formaadis, mis vastab EKP ja asjaomaste RKPde kehtestatud tehnilistele aruandlusnõuetele;
- iii) andmeesitajad peavad esitama ühe või mitme kontaktsiku andmed EKP-le ja asjaomasele RKP-le;
- iv) tuleb järgida tehnilisi spetsifikatsioone, mis käsitlevad andmeedastust EKP-le ja asjaomasele RKP-le.

2. Täpsuse miinumunõuded:

- i) statistiline teave peab olema õige;
- ii) andmeesitajad peavad suutma anda teavet arengu kohta, mis on edastatud andmete kohaselt toimunud;
- iii) statistiline teave peab olema täielik ning selles ei tohi olla pidevaid ega struktuurilisi lünki; puuduvatest andmetest tuleb EKPd ja asjaomaseid RKPsid teavitada ja nende puudumist selgitada ning need tuleb esitada esimesel võimalusel;
- iv) andmeesitajad peavad järgima proportsioone, ümardamis põhimõtteid ja kümnendkohti, mis EKP ja RKPd on määranud andmete tehniliseks edastamiseks.

3. Mõistete vastavuse miinumunõuded:

- i) statistiline teave peab vastama käesolevas määruses sisalduvatele määratlustele ja liigitustele;
- ii) kui nendest määratlustest ja liigitustest on kõrvale kaldunud, kontrollivad andmeesitajad võimaluse korral korrapäraselt kasutatud meetme ja käesoleva määruse kohase meetme vahelist erinevust ja mõõdavad selle;
- iii) andmeesitajad peavad suutma selgitada andmete esitamise katkemist, mis ilmneb esitatud andmete võrdlemisel varasemate perioodide andmetega.

4. Andmete parandamise miinumunõuded:

Tuleb järgida EKP ja asjaomaste RKPde sätestatud põhimõtteid ja korda andmete parandamiseks. Korrapäraselt tehtavatest parandustest kõrvalekalduvatele parandustele tuleb lisada selgitus.

5. Andmete tervikluse miinumunõuded:

- i) andmeesitajad koostavad ja edastavad statistilist teavet erapooletult ja objektiivselt;
  - ii) avastatud vead edastatud andmetes tuleb parandada ja andmeesitajad peavad nendest EKP-le ja asjaomasele RKPle teatama esimesel võimalusel.“
-