

EIROPAS CENTRĀLĀS BANKAS REGULA (ES) 2019/113**(2018. gada 7. decembris),****ar ko groza Regulu (ES) Nr. 1333/2014 par naudas tirgu statistiku (ECB/2018/33)**

EIROPAS CENTRĀLĀS BANKAS PADOME,

ņemot vērā Līgumu par Eiropas Savienības darbību,

ņemot vērā Eiropas Centrālo banku sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtus un jo īpaši to 5. pantu,

ņemot vērā Padomes Regulu (EK) Nr. 2533/98 (1998. gada 23. novembris) par statistikas informācijas vākšanu, ko veic Eiropas Centrālā banka ⁽¹⁾, un jo īpaši tās 5. panta 1. punktu un 6. panta 4. punktu,

pēc apspriešanās ar Eiropas Komisiju,

tā kā:

- (1) Eiropas Centrālās bankas Regula (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) ⁽²⁾ prasa pārskatu sniedzējiem sniegt statistiskos datus, lai Eiropas Centrālo banku sistēma (ECBS), pildot savus uzdevumus, varētu sagatavot statistiku par euro naudas tirgu.
- (2) Lai nodrošinātu euro naudas tirgus augstas kvalitātes statistikas pieejamību, nepieciešams grozīt dažus Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) noteikumus. Jo īpaši ir svarīgi nodrošināt, ka pārskatu sniedzēji Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) sniedz datus par visiem darījumiem, kas noslēgti starp pārskatu sniedzēju un finanšu sabiedrībām (izņemot centrālajām bankām, ja darījums netiek veikts ieguldījumu mērķiem), kā arī valdību un noteiktām nefinanšu sabiedrībām. Turklāt nepieciešams nodrošināt, ka datu vākšana gūst labumu no paplašinātas Juridisko personu identifikatora (JPI) obligātās izmantošanas pārskatu sniegšanā Eiropas Savienībā.
- (3) Ņemot vērā to, cik svarīgi ir nodrošināt savlaicīgas statistikas par euro naudas tirgu pieejamību, tāpat ir nepieciešams saskaņot un stiprināt pārskatu sniedzēju pienākumu savlaicīgi nosūtīt informāciju NCB vai ECB.
- (4) Jāveic piesardzības pasākumi, lai nodrošinātu, ka pārskatu sniedzēji statistisko informāciju vāc, apkopo un nosūta veidā, kas aizsargā informācijas integritāti. Jo īpaši ir svarīgi uzsvērt, ka NCB vai ECB saņemtajai statistiskajai informācijai jābūt objektīvai, t. i., pārskata sniedzēja noslēgtu, savstarpēji nesaistītu, novērojamu darījumu neitrālai reprezentācijai, un uzticamai, lai tā atbilstu vispārējiem principiem, kas pausti ECBS publiskajā apņemšanās par Eiropas statistiku ⁽³⁾. Turklāt pārskatu sniedzējiem būtu jānodrošina, ka kļūdas sniegtajā statistiskajā informācijā tiek labotas un paziņotas ECB un attiecīgajai NCB agrākajā iespējamā datumā.
- (5) Šo noteikumu īstenošana nodrošinās, ka ECBS ir savlaicīgāka, visaptveroša, detalizēta, saskaņota un uzticama statistiskā informācija par euro naudas tirgu, kura ļaus veikt dziļāku monetārās politikas transmisijas mehānisma analīzi. Turklāt savāktie dati var tikt izmantoti, lai izstrādātu un administrētu euro noguldījumu uz nakti nenodrošināto procentu likmi.
- (6) Tādēļ attiecīgi jāgroza Regula (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48),

⁽¹⁾ OVL 318, 27.11.1998., 8. lpp.⁽²⁾ Eiropas Centrālās bankas Regula (ES) Nr. 1333/2014 (2014. gada 26. novembris) par naudas tirgu statistiku (ECB/2014/48) (OVL 359, 16.12.2014., 97. lpp.).⁽³⁾ Pieejams ECB interneta vietnē www.ecb.europa.eu.

IR PIENĒMUSI ŠO REGULU.

1. pants

Grozījumi

Regulu (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) groza šādi:

1) šādi groza 1. pantu:

a) iekļauj šādu 5.a) punktu:

“5.a) “finanšu sabiedrības” ir institucionālās vienības, kuras ir neatkarīgas juridiskas personas un tirgus ražotāji, un kuru galvenā darbība ir finanšu pakalpojumu sniegšana, kā tas noteikts pārstrādātajā Eiropas Kontu sistēmā (EKS 2010), kura pieņemta ar Eiropas Parlamenta un Padomes Regulu (ES) Nr. 549/2013 (*);

(*) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 549/2013 (2013. gada 21. maijs) par Eiropas nacionālo un reģionālo kontu sistēmu Eiropas Savienībā (OV L 174, 26.6.2013., 1. lpp).”;

b) svīturo 3)–5) punktu;

c) ar šādu punktu aizstāj 9) punktu:

“9) “naudas tirgus statistika” ir statistika, kas attiecas uz attiecīgā pārskata perioda nodrošinātiem, nenodrošinātiem un atvasināto instrumentu darījumiem ar naudas tirgus instrumentiem starp pārskatu sniedzējiem un finanšu sabiedrībām (izņemot centrālajām bankām, ja darījums netiek veikts ieguldījumu mērķiem), valdību vai nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā “liela izmēra” saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu, izņemot darījumus grupas ietvaros;”;

d) ar šādu punktu aizstāj 14) punktu:

“14) “pārskatu sniedzēju atsauces kopa” ir euro zonas rezidentu MFI, izņemot centrālās bankas un NTF, kas pieņem noguldījumus euro un/vai emitē jebkurus citus parāda instrumentus, un/vai izsniedz kredītus euro, kā norādīts I, II vai III pielikumā, citām finanšu sabiedrībām, valdībai vai nefinanšu sabiedrībām;”;

e) iekļauj šādu 20.a) punktu:

“20.a) “kredītiestāde” ir iestāde, kas definēta Eiropas Parlamenta un Padomes Regulas (ES) Nr. 575/2013 (*) 4. panta 1. punkta 1) apakšpunktā;

(*) Eiropas Parlamenta un Padomes Regula (ES) Nr. 575/2013 (2013. gada 26. jūnijs) par prudenciālajām prasībām attiecībā uz kredītiestādēm un ieguldījumu brokeru sabiedrībām, un ar ko groza Regulu (ES) Nr. 648/2012 (OV L 176, 27.6.2013., 1. lpp).”;

f) ar šādu punktu aizstāj 25) punktu:

“25) “uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas darījums” (*overnight index swap, OIS*) ir procentu likmes mijmaiņas darījums, kurā periodiskā mainīgā procentu likme ir līdzvērtīga uz nakti izsniegto kredītu procentu likmes ģeometriskajam vidējam (jeb uz nakti izsniegto kredītu indeksu likmei) noteiktā termiņā. Galīgo maksājumu aprēķinās kā starpību starp fiksēto procentu likmi un uz nakti izsniegto kredītu uzkrāto procentu likmi, kas reģistrēta OIS darbības laikā un piemērota darījuma nominālvērtībai;”;

2) šādi groza 3. pantu:

a) ar šādu punktu aizstāj 1. punktu:

“1. Lai regulāri sagatavotu naudas tirgus statistiku, pārskatu sniedzēji tās dalībvalsts, kurā tie ir rezidenti, NCB katru dienu sniedz konsolidētu statistisko informāciju par naudas tirgus instrumentiem, iekļaujot visas to Savienības un EBTA filiāles. Prasītā statistiskā informācija ir norādīta šīs regulas I, II un III pielikumā. Prasīto statistisko informāciju pārskatu sniedzēji paziņo saskaņā ar IV pielikumā izklāstītajiem obligātajiem nosūtīšanas, precizitātes, konceptuālās atbilstības, labojumu un datu integritātes standartiem. Statistisko informāciju, kuru NCB saņem no pārskatu sniedzējiem, tā nodod ECB saskaņā ar šīs regulas 4. panta 2. punktu.”;

b) ar šādu punktu aizstāj 2. punktu:

“2. NCB definē un īsteno pārskatu sniegšanas kārtību, kuru saistībā ar naudas tirgus instrumentiem jāievēro pārskatu sniedzējiem. Šī pārskatu sniegšanas kārtība nodrošina prasītās statistiskās informācijas sniegšanu un ļauj precīzi pārbaudīt IV pielikumā izklāstīto obligāto standartu ievērošanu.”;

c) ar šādu punktu aizstāj 5. punktu:

“5. NCB definē un īsteno pārskatu sniegšanas kārtību, kuru saskaņā ar to nacionālajām statistikas pārskatu sniegšanas prasībām jāievēro pārskatu papildu sniedzējiem. NCB nodrošina, ka nacionālā pārskatu sniegšanas kārtība prasa pārskatu papildu sniedzējiem ievērot prasības, kas ir līdzvērtīgas šīs regulas 6.–8. pantam, 10. panta 3. punktam, 11. un 12. pantam. NCB nodrošina, ka šī pārskatu sniegšanas kārtība sniedz prasīto statistisko informāciju un ļauj precīzi pārbaudīt IV pielikumā izklāstīto obligāto standartu ievērošanu.”;

3) šādi groza 4. pantu:

a) ar šādu punktu aizstāj 1. punktu:

“1. Ja NCB saskaņā ar 3. panta 3. punktu nolemj, ka pārskatu sniedzējiem I, II un III pielikumā norādītā statistiskā informācija jāsniedz tieši ECB, pārskatu sniedzēji šo informāciju nosūta ECB reizi dienā starp plkst. 18.00 darījuma datumā un plkst. 7.00 pēc Viduseiropas laika (*) pirmajā TARGET2 norēķinu dienā pēc darījuma datuma.

(*) Viduseiropas laiks ņem vērā pāreju uz Viduseiropas vasaras laiku.”;

b) ar šādu punktu aizstāj 2. punktu:

“2. Gadījumos, kas nav minēti 1. punktā, I, II un III pielikumā norādīto naudas tirgus dienas statistisko informāciju, kuru NCB saņem no saskaņā ar 2. panta 2. punktu, 3. punktu un 4. punktu izvēlētajiem pārskatu sniedzējiem vai no saskaņā ar 2. panta 6. punktu izvēlētajiem papildu pārskatu sniedzējiem, tās nosūta ECB reizi dienā pirms plkst. 7.00 pēc Viduseiropas laika pirmajā TARGET2 norēķinu dienā pēc darījuma datuma.”;

c) pievieno šādu 5. punktu:

“5. Izvērtējot, vai pārskatu sniedzējs ir ievērojis šī panta prasības, jebkura IV pielikuma 1. punkta i)–ii) apakšpunktā izklāstītā datu nosūtīšanas obligātā standarta pārkāpums ir tāda paša veida pārskatu sniegšanas prasības neievērošanas gadījums, konstatējot prasību neievērošanu ECB Statistikas prasību neievērošanas regulējuma ietvaros.”;

4) svīturo 5. pantu;

5) Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) I pielikumu aizstāj ar šīs regulas I pielikumā izklāstīto tekstu;

6) Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) II pielikumu aizstāj ar šīs regulas II pielikumā izklāstīto tekstu;

7) Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) III pielikumu aizstāj ar šīs regulas III pielikumā izklāstīto tekstu;

8) Regulas (ES) Nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) IV pielikumu aizstāj ar šīs regulas IV pielikumā izklāstīto tekstu.

2. pants

Nobeiguma noteikumi

Šī regula stājas spēkā divdesmitajā dienā pēc tās publicēšanas Eiropas Savienības Oficiālajā Vēstnesī.

To piemēro ar 2019. gada 15. martu.

Šī regula uzliek saistības kopumā un ir tieši piemērojama dalībvalstīs saskaņā ar Līgumiem.

Frankfurtē pie Mainas, 2018. gada 7. decembrī

ECB Padomes vārdā –
ECB priekšsēdētājs
Mario DRAGHI

I PIELIKUMS

"I PIELIKUMS

Nodrošinātu darījumu naudas tirgus statistikas pārskatu sniegšanas sistēma

1. DAĻA

INSTRUMENTU VEIDI

Pārskatu sniedzēji sniedz datus Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) par visiem euro repo līgumiem un saskaņā ar tiem slēgtajiem darījumiem, t.sk. trīs pušu repo darījumiem, ar termiņu līdz vienam gadam, ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc norēķinu datuma), kas noslēgti starp pārskatu sniedzēju un finanšu sabiedrībām (izņemot centrālajām bankām, ja darījums netiek veikts ieguldījumu mērķiem), valdību vai nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu. Netiek iekļauti darījumi grupas ietvaros.

2. DAĻA

DATU VEIDS

1. Darījuma datu veidi (*), kas jānorāda par katru darījumu.

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|---|--|--|
| Norādītais darījuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir jauns darījums, iepriekš ziņota darījuma grozījums, anulēšana vai iepriekš ziņota darījuma labojums. | |
| Pārjaunojuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir pārjaunojums. | |
| Unikālais darījuma identifikators | Unikāls kods, kas ļauj identificēt darījumu attiecīgajā tirgus segmentā. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |
| Īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja katram darījumam izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators. Īpašais darījuma identifikators ir unikāls katram sniegtajam darījumam attiecībā uz naudas tirgus segmentu un pārskatu sniedzēju. | |
| Saistītais īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators sākotnējam darījumam, kurš vēlāk ticis pārjaunots. | Informāciju šajā laukā attiecīgos gadījumos sniedz obligāti. |
| Darījuma partnera īpašais darījuma identifikators | Īpašais darījuma identifikators, kuru pārskatu sniedzēja darījuma partneris piešķir tam pašam darījumam. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|--|---|---|
| Darījuma partnera identifikators | Identifikācijas kods, pēc kura atpazīst pārskatu sniedzēja darījuma partneri ziņotajā darījumā. | Juridiskās personas identifikatoru (JPI) jāizmanto visos gadījumos, kuros darījuma partnerim šāds identifikators ir piešķirts. Darījuma partnera sektors un darījuma partnera atrašanās vieta jānorāda gadījumos, kuros nav piešķirts JPI kods. |
| Darījuma partnera sektors | Darījuma partnera institucionālais sektors. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Darījuma partnera atrašanās vieta | Valsts, kurā reģistrēts darījuma partneris, Starptautiskās standartizācijas organizācijas (ISO) valsts kods. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Trīs pušu darījuma aģenta identifikators | Trīs pušu darījuma aģenta darījuma partnera identifikators. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par trīs pušu darījumiem. JPI jāizmanto visos gadījumos, kuros aģentam šāds identifikators ir piešķirts. |
| Pārskata sniegšanas datums | Tā perioda sākuma un beigu datums un laiks, uz kuru attiecas datnē iekļautie darījumu dati. | |
| Elektronisks laika zīmogs | Laiks, kurā veikts vai iegrāmatots darījums. | |
| Darījuma datums | Datums, kurā puses veic finanšu darījumu. | |
| Norēķinu datums | Datums, kurā saskaņā ar līgumu notiek naudas apmaiņa pret aktīvu. | Atvērto repo darījumu pārjaunojuma gadījumā šis ir datums, kurā notiek pārjaunojuma norēķins pat tad, ja notiek naudas nodošana. |
| Termiņa beigu datums | Atpirkšanas datums, t. i., datums, kurā nauda jāatdod vai jāsaņem apmaiņā pret iekļāto aktīvu, vai jāsaņem kā nodrošinājums. | |
| Darījuma veids | Šis atribūts norāda, vai darījums tiek veikts, lai naudu aizņemtos vai aizdotu. | |
| Darījuma nominālvērtība | Sākotnēji aizņemtā vai aizdotā euro summa. | |
| Likmes veids | Lai norādītu, vai instrumentam ir fiksēta vai mainīga procentu likme. | |
| Darījuma procentu likme | Saskaņā ar faktiskais dienu skaits/360 naudas tirgus principu izteikta procentu likme, ar kuru noslēgts repo līgums un ar kuru tiek maksāti procenti par aizdoto naudu. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par fiksētas procentu likmes instrumentiem. |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|----------------------------------|--|--|
| Atsauces likmes indekss | Tās pamatā esošā atsauces likmes Starptautiskais vērtspapīru identifikācijas numurs (<i>ISIN</i>), uz kuras bāzes tiek aprēķināti periodiskie procentu maksājumi. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par mainīgas procentu likmes instrumentiem. |
| Bāzes punktu starpība | Bāzes punktu skaits, kurus pieskaita (ja pozitīvi) vai atņem (ja negatīvi) pamatā esošajai atsauces likmei, lai mainīgas procentu likmes instrumenta emisijas laikā aprēķinātu faktisko procentu likmi noteiktā periodā. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par mainīgas procentu likmes instrumentiem. |
| Nodrošinājuma <i>ISIN</i> | Nodrošinātā aktīva <i>ISIN</i> . | Informāciju šajā laukā sniedz pēc izvēles attiecībā uz trīs pušu repo līgumiem, kurus neveic pret vērtspapīru grozu, kuram ir vispārējs <i>ISIN</i> , vai nodrošinājuma veidiem, kuriem <i>ISIN</i> nav pieejams. Ja netiek sniegts nodrošinātā aktīva <i>ISIN</i> , jāsniedz dati par nodrošinājuma veidu, nodrošinājuma emitenta sektoru un nodrošinājuma pūlu. |
| Nodrošinājuma pūls | Lai norādītu, vai aktīvs, kas iekļāts kā nodrošinājums, ir nodrošinājuma pūls. | |
| Nodrošinājuma veids | Lai identificētu kā nodrošinājums iekļātā aktīva klasi. | Obligāts, ja nav norādīts nodrošinājuma <i>ISIN</i> . |
| Nodrošinājuma emitenta sektors | Nodrošinājuma emitenta institucionālais sektors | Obligāts, ja nav norādīts nodrošinājuma <i>ISIN</i> . |
| Īpašais nodrošinājuma indikators | Lai identificētu visus repo līgumus, kas veikti ar parastu nodrošinājumu, un darījumus, kas veikti ar īpašu nodrošinājumu. | Jāsniedz tikai tad, ja pārskatu sniedzējam ir tāda iespēja. |
| Nodrošinājuma nominālvērtība | Aktīvu, kas iekļāti kā nodrošinājums, euro nominālvērtība. | Pēc izvēles attiecībā uz trīs pušu repo līgumiem un jebkuru darījumu, kurā šie iekļātie aktīvi netiek identificēti ar <i>ISIN</i> palīdzību. |
| Nodrošinājuma diskonts | Riska kontroles pasākums, kas tiek piemērots sniegtajam nodrošinājumam, nodrošinājuma vērtību aprēķinot kā aktīvu tirgus vērtību, kas samazināta par noteiktu procentuālo daļu (diskontu). | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt par atsevišķiem nodrošinājuma darījumiem, pārējos gadījumos – pēc izvēles. |

2. Darījuma nozīmīguma ierobežojums

Par darījumiem ar nefinanšu sabiedrībām datus sniedz tikai tad, ja tie veikti ar nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra", pamatojoties uz Bāzeles III LSR regulējumu (**).

(*) Datu elektroniskās sniegšanas standarti un tehniskās specifikācijas noteiktas atsevišķi. Tie pieejami ECB interneta vietnē www.ecb.europa.eu.

(**) Sk. "Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools", Basel Committee on Banking Supervision, January 2013, 23. lpp. to 27, pieejams Starptautisko norēķinu bankas interneta vietnē www.bis.org."

II PIELIKUMS

"II PIELIKUMS

Nenodrošinātu darījumu naudas tirgus statistikas pārskatu sniegšanas sistēma

1. DAĻA

INSTRUMENTU VEIDI

1. Pārskatu sniedzēji sniedz datus Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) par:
- jebkādu aizņemšanos, izmantojot tālāk tekstā iekļautajā tabulā definētos euro instrumentus ar termiņu līdz vienam gadam, ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc norēķinu datuma), pārskatu sniedzējiem aizņemoties no finanšu sabiedrībām (izņemot centrālajām bankām, ja darījums netiek veikts ieguldījumu mērķiem), valdību vai nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu;
 - visiem euro aizdošanas darījumiem ar citām kredītiestādēm ar termiņu līdz vienam gadam ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc norēķinu datuma), izmantojot nenodrošinātus noguldījumus vai pieprasījuma kontus, vai īstermiņa parāda vērtspapīru, noguldījumu sertifikātu, mainīgas likmes parādzīmju un citu parāda vērtspapīru ar termiņu līdz vienam gadam iegādi no tos emitējušām kredītiestādēm.
- Sniedzot datus 1. punkta a) un b) apakšpunkta vajadzībām, netiek iekļauti darījumi grupas ietvaros.
2. Tālāk tekstā iekļautā tabula sniedz instrumentu kategoriju detalizētu standarta aprakstu darījumiem, par kuriem pārskatu sniedzējiem jāsniedz dati ECB. Ja pārskatu sniedzējiem prasīts darījumu datus sniegt savai NCB, attiecīgā NCB šos instrumentu kategoriju aprakstus transponē nacionālajā līmenī saskaņā ar šo regulu.

| Instrumenta veids | Apraksts |
|--|--|
| Noguldījumi | Nenodrošināti procentu noguldījumi (t. sk. pieprasījuma konti (<i>call accounts</i>), izņemot pieprasījuma noguldījumu kontus (<i>current accounts</i>)) ar brīdinājuma termiņu par izņemšanu vai termiņu ne ilgāku par vienu gadu, t. i., līdz 397 dienām pēc norēķinu datuma, kurus pieņēmis (aizņemšanās) vai noguldījis (aizdošana) pārskatu sniedzējs. |
| Pieprasījuma konts/nauda pieprasījuma kontā | Skaidras naudas konti ar brīdinājuma termiņu par naudas izņemšanu un ikdienas izmaiņām piemērojamajā procentu likmē, kas ir regulāru procentu maksājumu vai aprēķinu pamatā. Krājkonts ar brīdinājuma termiņu par naudas izņemšanu. |
| Noguldījuma sertifikāts | MFI emitēts fiksētas likmes parāda instruments apgrozāmā vai neapgrozāmā formā, kurš tā turētājam dod tiesības uz noteiktu fiksētu procentu likmi noteiktā fiksētā termiņā, kas nav ilgāks par vienu gadu, t. i., līdz 397 dienām pēc norēķinu datuma, un kas pelna procentus vai pārdots ar diskontu. |
| Īstermiņa parāda vērtspapīrs | MFI emitēts nenodrošināts parāda instruments ar termiņu ne ilgāku par vienu gadu, t. i., līdz 397 dienām pēc norēķinu datuma, kas pelna procentus vai pārdots ar diskontu. |
| Ar aktīviem nodrošināts īstermiņa parāda vērtspapīrs | MFI emitēts parāda instruments ar termiņu ne ilgāku par vienu gadu, t. i., līdz 397 dienām pēc norēķinu datuma, kas pelna procentus vai pārdots ar diskontu un kas nodrošināts ar jebkāda veida nodrošinājumu. |
| Mainīgas likmes parādzīme | Parāda instruments, kura periodiskos procentu maksājumus aprēķina, pamatojoties uz vērtību, t. i., fiksējot pamatā esošo atsauces likmi, piemēram, Euro starpbanku kredītu procentu likmju indekss (<i>Euribor</i>), iepriekš noteiktos datumos, kurus sauc par likmes maiņas datumiem, un kura termiņš nav ilgāks par vienu gadu, t. i., līdz 397 dienām pēc norēķinu datuma. |

| Instrumenta veids | Apraksts |
|-----------------------------------|--|
| Citi īstermiņa parāda vērtspapīri | <p>Pārskata sniedzēju emitēti nesubordinēti vērtspapīri, kas nav pašu kapitāls, ar termiņu līdz vienam gadam, t. i., līdz 397 dienām pēc norēķinu datuma, kas parasti ir apgrozāmi un otrreizējā tirgū tirgoti instrumenti, vai kuru pozīcijas var slēgt, tirgū veicot pretēju darījumu, un kas turētājam nepiešķir īpašumtiesības emitenta iestādē. Šajā postenī tiek iekļauti:</p> <p>a) vērtspapīri, kas turētājam dod beznosacījuma tiesības uz fiksētu vai līgumā noteiktu ienākumu procentu maksājumu veidā un/vai norādītu fiksētu summu konkrētā datumā (vai datumos) vai sākot ar datumu, kas noteikta emisijas brīdī;</p> <p>b) pārskatu sniedzēju emitēti neapgrozāmi instrumenti, kuri vēlāk kļuvuši apgrozāmi un kuri jāpārklasificē kā "parāda vērtspapīri".</p> |

2. DAĻA

DATU VEIDS

1. Darījuma datu veidi (*), kas jānorāda par katru darījumu:

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja (ja pastāv) un papildu nosacījumi |
|---|--|---|
| Norādītais darījuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir jauns darījums, iepriekš ziņots darījuma grozījums, anulēšana vai iepriekš ziņots darījuma labojums. | |
| Pārjaunojuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir pārjaunojums. | |
| Unikālais darījuma identifikators | Unikāls kods, kas ļauj identificēt darījumu attiecīgajā tirgus segmentā. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |
| Īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja katram darījumam izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators. Īpašais darījuma identifikators ir unikāls katram sniegtajam darījumam attiecībā uz naudas tirgus segmentu un pārskatu sniedzēju. | |
| Saistītais īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators sākotnējam darījumam, kurš vēlāk ticis pārjaunots. | Informāciju šajā laukā attiecīgos gadījumos sniedz obligāti. |
| Darījuma partnera īpašais darījuma identifikators | Īpašais darījuma identifikators, kuru pārskatu sniedzēja darījuma partneris piešķir tam pašam darījumam. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja (ja pastāv) un papildu nosacījumi |
|-----------------------------------|---|---|
| Darījuma partnera identifikators | Identifikācijas kods, pēc kura atpazīst pārskatu sniedzēja darījuma partneri ziņotajā darījumā. | Juridiskās personas identifikatoru (JPI) jāizmanto visos gadījumos, kuros darījuma partnerim šāds identifikators ir piešķirts. Darījuma partnera sektors un darījuma partnera atrašanās vieta jānorāda gadījumos, kuros nav piešķirts JPI kods. |
| Darījuma partnera sektors | Darījuma partnera institucionālais sektors. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Darījuma partnera atrašanās vieta | Valsts, kurā reģistrēts darījuma partneris, Starptautiskās standartizācijas organizācijas (ISO) valsts kods. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Pārskata sniegšanas datums | Tā perioda sākuma un beigu datums un laiks, uz kuru attiecas datnē iekļautie darījumu dati. | |
| Elektronisks laika zīmogs | Laiks, kurā veikts vai iegrāmatots darījums. | |
| Darījuma datums | Datums, kurā puses veic pārskatā norādīto finanšu darījumu. | |
| Norēķinu datums | Datums, kurā notiek naudas summu apmaiņa darījuma partneru starpā vai kurā notiek parāda instrumentu pirkšanas vai pārdošanas norēķini. | Pieprasījuma kontu un citas nenodrošinātas aizņemšanās/aizdošanas ar brīdinājuma termiņu gadījumā – datums, kurā noguldījums tiek pārjaunots (t. i., kurā noguldījums tiktu atmaksāts, ja tiktu izmantota pirkšanas iespēja un tas netiktu pārjaunots). |
| Termiņa beigu datums | Datums, kurā aizņēmējam jāatmaksā naudas summa aizdevējam, vai datums, kurā iestājas parāda instrumenta termiņš un tas jāatmaksā. | |
| Instrumenta veids | Instrumenti, ar kura palīdzību notiek aizņemšanās/aizdošana. | |
| Darījuma veids | Šis atribūts norāda, vai darījums ir naudas aizņemšanās vai aizdošana. | |
| Darījuma nominālvērtība | Naudas summa euro, kas aizdota vai aizņemta noguldījumu veidā. Parāda vērtspapīru gadījumā tā ir emitētā/pirktā vērtspapīra nominālvērtība. | |
| Darījuma cena | Netirā cena (t. i., cena, kura ietver visus uzkrātos procentus) procentu punktos, par kuru vērtspapīrs tiek emitēts vai tirgots. | Nenodrošinātu noguldījumu gadījumā norāda 100. |
| Likmes veids | Lai norādītu, vai instrumentam ir fiksēta vai mainīga procentu likme. | |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja (ja pastāv) un papildu nosacījumi |
|--|--|---|
| Darījuma procentu likme | Saskaņā ar faktiskais dienu skaits/360 naudas tirgus principu izteikta procentu likme, ar kuru veikts noguldījums un ar kuru tiek maksāti procenti par aizdoto naudas summu. Parāda instrumentu gadījumā tā ir saskaņā ar faktiskais dienu skaits/360 naudas tirgus principu izteikta efektīvā procentu likme, ar kuru instruments tika emitēts vai pirkt. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par fiksētas procentu likmes instrumentiem. |
| Atsauces likmes indekss | Tās pamatā esošā atsauces likmes Starptautiskais vērtspapīru identifikācijas numurs (ISIN), uz kuras bāzes tiek aprēķināti periodiskie procentu maksājumi. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par mainīgas procentu likmes instrumentiem. |
| Bāzes punktu starpība | Bāzes punktu skaits, kurus pieskaita (ja pozitīvi) vai atņem (ja negatīvi) atsauces likmes indeksam, lai mainīgas procentu likmes instrumenta emisijas laikā aprēķinātu faktisko procentu likmi noteiktā periodā. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par mainīgas procentu likmes instrumentiem. |
| Pirkšanas vai pārdošanas iespēja | Lai identificētu, vai instrumentam ir pirkšanas iespēja vai pārdošanas iespēja. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt tikai par pērkamiem/pārdodamiem instrumentiem. |
| Pirmais pirkšanas/pārdošanas iespējas datums | Pirmais datums, kurā var tikt izmantota pirkšanas iespēja vai pārdošanas iespēja. | Informācijas sniegšana šajā laukā tiek prasīta tikai par instrumentiem ar pirkšanas iespēju vai pārdošanas iespēju, kas var tikt realizēta vienā vai vairākos iepriekš noteiktos datos. |
| Pirkšanas/pārdošanas iespējas periods | Kalendāra dienu skaits, kuru instrumenta turētājs/instrumenta emitents dos instrumenta emitentam/turētājam pirms pirkšanas/pārdošanas iespējas izmantošanas. | Informācijas sniegšana šajā laukā tiek prasīta tikai par instrumentiem/darījumiem ar pirkšanas/pārdošanas iespējas termiņu un noguldījumiem ar iepriekš noteiktu brīdinājuma termiņu par izņemšanu. |

2. Darījuma nozīmīguma ierobežojums

Par darījumiem ar nefinanšu sabiedrībām datus sniedz tikai tad, ja tie veikti ar nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra", pamatojoties uz Bāzeles III LSR regulējumu.

(*) Datu elektroniskās sniegšanas standarti un tehniskās specifikācijas noteiktas atsevišķi. Tie pieejami ECB tīmekļa vietnē www.ecb.europa.eu."

III PIELIKUMS

"III PIELIKUMS

Atvasināto instrumentu darījumu naudas tirgus statistikas pārskatu sniegšanas sistēma

1. DAĻA

INSTRUMENTU VEIDI

Pārskatu sniedzēji sniedz datus Eiropas Centrālajai bankai (ECB) vai attiecīgajai nacionālajai centrālajai bankai (NCB) par:

- a) visiem valūtas mijmaiņas darījumiem, kuros euro tiek pirkti/pārdoti tagadnē par ārvalstu valūtu un atpārdoti vai atpirkti datumā nākotnē par iepriekšnoteiktu valūtas beigu kursu, ar termiņu līdz vienam gadam, ieskaitot (kas definēti kā darījumi ar termiņu, kas nav garāks par 397 dienām pēc valūtas mijmaiņas darījuma tagadnes posma norēķinu dienas), kas noslēgti starp pārskatu sniedzēju un finanšu sabiedrībām (izņemot centrālajām bankām, ja darījums netiek veikts ieguldījumu mērķiem), valdību vai nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu;
- b) uz nakti izsniegto kredītu indeksu mijmaiņas (OIS) darījumiem euro starp pārskatu sniedzēju un finanšu sabiedrībām (izņemot centrālajām bankām, ja darījums netiek veikts ieguldījumu mērķiem), valdību vai nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra" saskaņā ar Bāzeles III LSR regulējumu.

Sniedzot datus a) un b) apakšpunkta vajadzībām, netiek iekļauti darījumi grupas ietvaros.

2. DAĻA

DATU VEIDS

1. Valūtas mijmaiņas darījumu datu veidi (*), kas jānorāda par katru darījumu.

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|---|--|--|
| Norādītais darījuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir jauns darījums, iepriekš ziņots darījuma grozījums, anulēšana vai iepriekš ziņots darījuma labojums. | |
| Pārjaunojuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir pārjaunojums. | |
| Unikālais darījuma identifikators | Unikāls kods, kas ļauj identificēt darījumu attiecīgajā tirgus segmentā. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |
| Īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja katram darījumam izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators. Īpašais darījuma identifikators ir unikāls katram sniegtajam darījumam attiecībā uz naudas tirgus segmentu un pārskatu sniedzēju. | |
| Saistītais īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators sākotnējam darījumam, kurš vēlāk ticis pārjaunots. | Informāciju šajā laukā attiecīgos gadījumos sniedz obligāti. |
| Darījuma partnera īpašais darījuma identifikators | Īpašais darījuma identifikators, kuru pārskatu sniedzēja darījuma partneris piešķir tam pašam darījumam. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|-----------------------------------|--|---|
| Darījuma partnera identifikators | Identifikācijas kods, pēc kura atpazīst pārskatu sniedzēja darījuma partneri ziņotajā darījumā. | Juridiskās personas identifikatoru (JPI) jāizmanto visos gadījumos, kuros darījuma partnerim šāds identifikators ir piešķirts. Darījuma partnera sektors un darījuma partnera atrašanās vieta jānorāda gadījumos, kuros nav piešķirts JPI kods. |
| Darījuma partnera sektors | Darījuma partnera institucionālais sektors. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Darījuma partnera atrašanās vieta | Valsts, kurā reģistrēts darījuma partneris, Starptautiskās standartizācijas organizācijas (ISO) valsts kods. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Pārskata sniegšanas datums | Tā perioda sākuma un beigu datums un laiks, uz kuru attiecas datnē iekļautie darījumu dati. | |
| Elektronisks laika zīmogs | Laiks, kurā veikts vai iegrāmatots darījums. | |
| Darījuma datums | Datums, kurā puses veic pārskatā norādīto finanšu darījumu. | |
| Tagadnes vērtības datums | Datums, kurā viena puse pārdod otram noteiktu daudzumu noteiktas valūtas, saņemot nolīgtu summu noteiktas citas valūtas, kas pamatojas uz nolīgtu valūtas kursu, kuru sauc par valūtas sākumkursu. | |
| Termiņa beigu datums | Datums, kurā beidzas valūtas mijmaiņas darījums un kurā tagadnes vērtības datumā pārdotā valūta tiek atpirkta. | |
| Valūtas darījuma veids | Šis atribūts norāda, vai summa euro, kas norādīta kā darījuma nominālvērtība, tagadnes vērtības datumā tiek pirka vai pārdota. Jāattiecas uz euro tagadnes darījumu, t. i., to, vai tagadnes vērtības datumā euro tiek pirks vai pārdots. | |
| Darījuma nominālvērtība | Valūtas mijmaiņas darījuma euro nominālvērtība. | |
| Valūtas kods | Valūtas, kuru pērk/pārdod apmaiņā pret euro, starptautiskais trīs zīmju ISO kods. | |
| Valūtas sākumkurss | Euro un ārvalstu valūtas kurss, kurš attiecas uz valūtas mijmaiņas darījuma pirmo posmu. | |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|-------------------------------|---|--|
| Valūtas kursa nākotnes punkti | Starpība starp valūtas darījuma beigu kursu un valūtas darījuma sākumkursu, kas izteikta bāzes punktos atbilstoši attiecīgajam valūtu pārim pieņemtajiem tirgus principiem. | |

2. OIS darījumu datu veidi, kas jānorāda par katru darījumu.

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|---|--|--|
| Norādītais darījuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir jauns darījums, iepriekš ziņota darījuma grozījums, anulēšana vai iepriekš ziņota darījuma labojums. | |
| Pārjaunojuma statuss | Šis atribūts norāda, vai darījums ir pārjaunojums. | |
| Unikālais darījuma identifikators | Unikāls kods, kas ļauj identificēt darījumu attiecīgajā tirgus segmentā. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |
| Īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja katram darījumam izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators. Īpašais darījuma identifikators ir unikāls katram sniegtajam darījumam attiecībā uz naudas tirgus segmentu un pārskatu sniedzēju. | |
| Saistītais īpašais darījuma identifikators | Pārskatu sniedzēja izmantotais unikālais iekšējais darījuma identifikators sākotnējam darījumam, kurš vēlāk ticis pārjaunots. | Informāciju šajā laukā attiecīgos gadījumos sniedz obligāti. |
| Darījuma partnera īpašais darījuma identifikators | Īpašais darījuma identifikators, kuru pārskatu sniedzēja darījuma partneris piešķir tam pašam darījumam. | Informāciju šajā laukā prasīts sniegt, ja tā ir pieejama. |
| Darījuma partnera identifikators | Identifikācijas kods, pēc kura atpazīst pārskatu sniedzēja darījuma partneri ziņotajā darījumā. | JPI jāizmanto visos gadījumos, kuros darījuma partnerim šāds identifikators ir piešķirts. Darījuma partnera sektors un darījuma partnera atrašanās vieta jānorāda gadījumos, kuros nav piešķirts JPI kods. |
| Darījuma partnera sektors | Darījuma partnera institucionālais sektors. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Darījuma partnera atrašanās vieta | Valsts, kurā reģistrēts darījuma partneris, ISO valsts kods. | Obligāts, ja nav norādīts darījuma partnera identifikators. |
| Pārskata sniegšanas datums | Tā perioda sākuma un beigu datums un laiks, uz kuru attiecas datnē iekļautie darījumu dati. | |

| Datu lauks | Datu apraksts | Datu sniegšanas alternatīva iespēja un citi nosacījumi |
|---------------------------|---|--|
| Elektronisks laika zīmogs | Laiks, kurā veikts vai iegrāmatots darījums. | Pēc izvēles. |
| Darījuma datums | Datums, kurā puses veic finanšu darījumu. | |
| Sākuma datums | Datums, kurā tiek aprēķināta mainīgā posma uz nakti izsniegto kredītu procentu likme. | |
| Termiņa beigu datums | Termiņa, kuram aprēķina uz nakti izsniegto kredītu uzkrāto procentu likmi, pēdējais datums. | |
| Fiksētā procentu likme | OIS izmaksas aprēķināšanā izmantotā fiksētā procentu likme. | |
| Darījuma veids | Šis atribūts norāda, vai pārskata sniedzējs maksā vai saņem fiksēto procentu likmi. | |
| Darījuma nominālvērtība | OIS nominālvērtība. | |

3. Darījuma nozīmīguma ierobežojums

Par darījumiem ar nefinanšu sabiedrībām datus sniedz tikai tad, ja tie veikti ar nefinanšu sabiedrībām, kas klasificētas kā "liela izmēra", pamatojoties uz Bāzeles III LSR regulējumu.

(*) Datu elektroniskās sniegšanas standarti un tehniskās specifikācijas noteiktas atsevišķi. Tie pieejami ECB interneta vietnē www.ecb.europa.eu."

IV PIELIKUMS

"IV PIELIKUMS

Faktisko pārskatu sniedzēju piemērotie obligātie standarti

Pārskatu sniedzēji ievēro šādus obligātos standartus, lai atbilstu Eiropas Centrālās bankas (ECB) statistikas pārskatu sniegšanas prasībām.

1. Datu nosūtīšanas obligātie standarti:

- i) pārskatu sniegšana tiek veikta laikus, ECB un attiecīgās nacionālās centrālās bankas (NCB) noteiktajos termiņos;
- ii) statistikas pārskati tiek noformēti tādā veidā un formātā, kā noteikts ECB attiecīgās NCB pārskatu sniegšanas tehniskajās prasībās;
- iii) pārskatu sniedzēji ECB un attiecīgajai NCB sniedz ziņas par vienu vai vairākām kontaktpersonām;
- iv) tiek ievērota tehniskā specifikācija datu nosūtīšanai uz ECB un attiecīgo NCB.

2. Precizitātes obligātie standarti:

- i) statistiskās informācijas pareizība;
- ii) pārskatu sniedzēji ir gatavi sniegt informāciju par notikumiem, kas izriet no nosūtītajiem datiem;
- iii) statistiskā informācija ir pilnīga, bez nepārtrauktiem un strukturāliem informācijas trūkumiem; esošie trūkumi jāatrunā, sniedzot paskaidrojumus ECB un attiecīgajai NCB, un attiecīgos apstākļos pēc iespējas drīz jāaizpilda;
- iv) pārskatu sniedzēji ievēro ECB un attiecīgās NCB datu pārraidei noteiktās dimensijas, noapaļošanas politiku un decimāldaļas.

3. Konceptuālās atbilstības obligātie standarti:

- i) statistiskā informācija atbilst šajā regulā ietvertajām definīcijām un klasifikācijai;
- ii) ja izdara atkāpes no šīm definīcijām un klasifikācijas, pārskatu sniedzēji regulāri uzrauga un kvantitatīvi atspoguļo atšķirību starp izmantoto metodi un šai regulai atbilstošu metodi;
- iii) pārskatu sniedzēji spēj izskaidrot atšķirības starp iesniegtajiem datiem, salīdzinot tos ar iepriekšējo periodu skaitļiem.

4. Labojumu obligātie standarti

Tiek ievērota ECB un attiecīgās NCB noteiktā labojumu politika un procedūras. Labojumiem, kas veikti, atkāpjoties no parastās labojumu kārtības, sniedz paskaidrojuma piezīmes.

5. Datu integritātes obligātie standarti:

- i) pārskatu sniedzēji statistisko informāciju apkopo un nosūta neatkarīgā un objektīvā veidā;
 - ii) atklātās kļūdas nosūtītajos datos pārskatu sniedzēji izlabo un par tām paziņo ECB un attiecīgajai NCB agrākajā iespējamā datumā."
-