

**VERORDENING (EU) 2019/113 VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK****van 7 december 2018****tot wijziging van Verordening (EU) nr. 1333/2014 houdende geldmarktstatistieken (ECB/2018/33)**

DE RAAD VAN BESTUUR VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK,

Gezien het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie,

Gezien de statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank, en met name artikel 5,

Gezien Verordening (EG) nr. 2533/98 van de Raad van 23 november 1998 met betrekking tot het verzamelen van statistische gegevens door de Europese Centrale Bank <sup>(1)</sup>, en met name artikel 5, lid 1, en artikel 6, lid 4,

Na raadpleging van de Europese Commissie,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Verordening (EU) nr. 1333/2014 van de Europese Centrale Bank (ECB/2014/48) <sup>(2)</sup> vereist de rapportage van statistische gegevens door informatieplichtigen opdat het Europees Stelsel van centrale banken (ESCB) in het kader van de uitvoering van haar taken geldmarktstatistieken kan opstellen.
- (2) Ter garantie van de beschikbaarheid van hoogwaardige statistieken betreffende de eurogeldmarkt dienen een aantal bepalingen van Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) te worden gewijzigd. Het is in het bijzonder belangrijk te garanderen dat elke informatieplichtige alle tussen de informatieplichtige en de financiële vennootschappen (met uitsluiting van centrale banken wanneer de transactie geen investeringsdoeleinden heeft), alsook de overheid en bepaalde niet-financiële vennootschappen gesloten transacties rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB). Het is bovendien noodzakelijk te garanderen dat de gegevensverzameling profiteert van de uitbreiding van het verplichte gebruik van de identificatiecode voor juridische entiteiten (Legal Entity Identifier — LEI) bij rapportage binnen de Unie.
- (3) Gelet op het belang van de beschikbaarheid van tijdige statistieken betreffende de eurogeldmarkt, is het eveneens noodzakelijk om de verplichtingen van informatieplichtigen inzake tijdige overmaking van informatie aan de NCB's of de ECB te harmoniseren en aan te scherpen.
- (4) Er dienen voorzorgsmaatregelen te worden getroffen om te verzekeren dat de statistische gegevens door informatieplichtigen worden verzameld, gecompileerd en verzonden op een manier die de integriteit van de informatie beschermt. In het bijzonder is het belangrijk te benadrukken dat door de NCB's of de ECB ontvangen statistische gegevens onpartijdig, d.w.z. een neutrale weergave van observeerbare transacties die op armlengte worden gesloten door de informatieplichtige, objectief en betrouwbaar moeten zijn, om te voldoen aan de algemene beginselen in de Openbare committering van het ESCB ten aanzien van Europese statistieken <sup>(3)</sup>. Voorts dienen informatieplichtigen te verzekeren dat fouten in de gerapporteerde statistische gegevens zo snel mogelijk worden gecorrigeerd en meegedeeld aan de ECB en de betrokken NCB.
- (5) De tenuitvoerlegging van deze bepalingen zal garanderen dat het ESCB beschikt over meer tijdige, volledige, gedetailleerde, geharmoniseerde en betrouwbare statistische gegevens over de eurogeldmarkt, waardoor een grondigere analyse van het doorwerkingsmechanisme van het monetair beleid mogelijk wordt. Bovendien kunnen de verzamelde gegevens worden gebruikt voor de ontwikkeling en het beheer van een euro unsecured overnight interest rate.
- (6) Daarom dient Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) dienovereenkomstig te worden gewijzigd,

<sup>(1)</sup> PB L 318 van 27.11.1998, blz. 8.

<sup>(2)</sup> Verordening (EU) nr. 1333/2014 van de Europese Centrale Bank van 26 november 2014 houdende geldmarktstatistieken (ECB/2014/48) (PB L 359 van 16.12.2014, blz. 97).

<sup>(3)</sup> Beschikbaar op de ECB-website onder [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

HEEFT DEZE VERORDENING VASTGESTELD:

### Artikel 1

#### Wijzigingen

Verordening (EU) nr. 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt als volgt gewijzigd:

1) Artikel 1 wordt als volgt gewijzigd:

a) het volgende punt (5 bis) wordt ingevoegd:

„(5 bis) „financiële vennootschappen”: institutionele eenheden met eigen rechtspersoonlijkheid die marktproducent zijn en van wie de hoofdactiviteit bestaat uit de productie van financiële diensten zoals bepaald in het herziene Europees systeem van nationale en regionale rekeningen (ESA 2010), neergelegd in Verordening (EU) nr. 549/2013 van het Europees Parlement en de Raad (\*);

(\*) Verordening (EU) nr. 549/2013 van het Europees Parlement en de Raad van 21 mei 2013 betreffende het Europees systeem van nationale en regionale rekeningen in de Europese Unie (PB L 174 van 26.6.2013, blz. 1).”;

b) de punten 3 en 5 worden geschrapt;

c) punt 9 wordt als volgt vervangen:

„(9) „geldmarktstatistieken”: statistieken in verband met gedekte, ongedekte en derivatentransacties in geldmarkt-instrumenten welke gedurende de desbetreffende rapportageperiode worden afgesloten tussen informatieplichtigen en financiële vennootschappen (met uitsluiting van centrale banken wanneer de transactie niet bestemd is voor investeringen), overheid, of niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader, maar met uitzondering van intragroep-transacties;”;

d) punt (14) wordt als volgt vervangen:

„(14) „referentiepopulatie van informatieplichtigen”: in het eurogebied ingezeten MFI's, met uitzondering van centrale banken en geldmarktfondsen, die in euro luidende deposito's aanvaarden, en/of enig ander schuldinstrument uitgeven en/of in euro luidende leningen verstrekken zoals bedoeld in de bijlagen I, II of III, van/aan overige financiële vennootschappen, de overheid of niet-financiële vennootschappen;”;

e) het volgende punt (20 bis) wordt ingevoegd:

„(20 bis) „kredietinstelling”: heeft dezelfde betekenis als bedoeld in artikel 4, lid 1 onder 1) van Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad (\*);

(\*) Verordening (EU) nr. 575/2013 van het Europees Parlement en de Raad van 26 juni 2013 betreffende prudentiële vereisten voor kredietinstellingen en beleggingsondernemingen en tot wijziging van Verordening (EU) nr. 648/2012 (PB L 176 van 27.6.2013, blz. 1).”;

f) Punt 25 wordt als volgt vervangen:

„(25) „overnight index swap” of „OIS”: de renteswap waarvan de periodieke variabele rentevoet gedurende een specifieke periode gelijk is aan het geometrische gemiddelde van een daggeldrente (of een daggeldindexrente). De finale betaling wordt berekend als het verschil tussen de vaste rentevoet en de opgebouwde gedurende de looptijd van de OIS geregistreerde daggeldrente toegepast op het nominale transactiebedrag;”.

2) Artikel 3 wordt als volgt gewijzigd:

a) lid 1 wordt als volgt vervangen:

„1. Ten behoeve van de regelmatige productie van geldmarktstatistieken rapporteren informatieplichtigen aan de NCB van de lidstaat waarin zij ingezeten zijn op een geconsolideerde basis, waaronder voor al hun in de Unie en de EVA gevestigde bijkantoren, dagelijkse statistische gegevens in verband met geldmarktinstrumenten. De vereiste statistische informatie is gespecificeerd in bijlage I, II en III bij deze verordening. De informatieplichtige dient de vereiste statistische gegevens te rapporteren in overeenstemming met de minimumnormen voor transmissie, nauwkeurigheid, conceptuele naleving, herzieningen en gegevensintegriteit zoals vastgelegd in bijlage IV. De NCB stuurt de van de informatieplichtigen ontvangen statistische gegevens naar de ECB, zulks overeenkomstig artikel 4, lid 2, van deze verordening.”;

b) lid 2 wordt als volgt vervangen:

„2. De NCB's definiëren de in verband met geldmarktinstrumenten door de informatieplichtigen te volgen rapportageregelingen, en voeren deze uit. Deze rapportageregelingen verzekeren dat de vereiste statistische gegevens verstrekt worden en maken een nauwkeurige controle mogelijk van de naleving van de minimumnormen bedoeld in bijlage IV.”;

c) lid 5 wordt als volgt vervangen:

„5. De NCB's definiëren overeenkomstig hun nationale statistische rapportagevoorschriften de door de aanvullende informatieplichtigen te volgen rapportageregelingen, en passen deze toe. De NCB's waarborgen dat de nationale rapportageregelingen vergen dat aanvullende informatieplichtigen voldoen aan voorschriften die equivalent zijn aan de artikelen 6 tot en met 8, artikel 10, lid 3, artikelen 11 en 12, van deze verordening. De NCB's verzekeren dat deze rapportageprocedures de vereiste statistische gegevens opleveren en een nauwkeurige controle mogelijk maken van de naleving van de minimumnormen zoals vastgelegd in bijlage IV.”.

3) Artikel 4 wordt als volgt gewijzigd:

a) lid 1 wordt als volgt vervangen:

„1. „Indien een NCB overeenkomstig artikel 3, lid 3 besluit dat informatieplichtigen de in de bijlagen I, II en III bedoelde statistische gegevens direct aan de ECB rapporteren, sturen die informatieplichtigen deze gegevens naar de ECB eenmaal per dag tussen 6 p.m. op de transactiedatum en 7 a.m. Central European Time (CET) (\*) op de eerste TARGET2-afwikkelingsdag na de transactiedatum.

(\*) CET houdt ook rekening met de omschakeling naar Centraal Europese Zomertijd.”;

b) lid 2 wordt als volgt vervangen:

„2. In andere gevallen dan lid 1, sturen de NCB's de in bijlage I, II en III bedoelde dagelijkse statistische geldmarktgegevens, ontvangen van de informatieplichtigen die geselecteerd zijn krachtens artikel 2, leden 2, 3 en 4, of van geselecteerde aanvullende informatieplichtigen krachtens artikel 2, lid 6 naar de ECB, eenmaal per dag voor 7 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na de transactiedatum.”;

c) Het volgende lid 5 wordt toegevoegd:

„5. Bij de beoordeling of een informatieplichtige heeft voldaan aan de vereisten van dit artikel, vormt de schending van één van de minimumnormen voor transmissie uiteengezet in lid 1 onder (i) en (ii) van Bijlage IV met het oog op vaststelling van de niet-naleving van het statistische niet-nalevingskader van de ECB een geval van niet-naleving van hetzelfde type rapportageverplichting.”.

4) Artikel 5 wordt geschrapt.

5) Bijlage I bij Verordening (EU) 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt vervangen door de tekst in bijlage I bij deze verordening.

6) Bijlage II bij Verordening (EU) 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt vervangen door de tekst in bijlage II bij deze verordening.

7) Bijlage III bij Verordening (EU) 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt vervangen door de tekst in bijlage III bij deze verordening.

8) Bijlage IV bij Verordening (EU) 1333/2014 (ECB/2014/48) wordt vervangen door de tekst in bijlage IV bij deze verordening.

## Artikel 2

### Slotbepalingen

Deze verordening wordt van kracht op de twintigste dag na die van de bekendmaking ervan in het *Publicatieblad van de Europese Unie*.

Het Besluit is met ingang van 15 maart 2019 van toepassing.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in de lidstaten overeenkomstig de Verdragen.

Gedaan te Frankfurt am Main, 7 december 2018.

*Voor de Raad van bestuur van de ECB*

*De president van de ECB*

Mario DRAGHI

---

## BIJLAGE I

## „BIJLAGE I

**Rapportageschema voor met gedekte transacties verband houdende geldmarktstatistieken**

## DEEL 1

**TYPE INSTRUMENT**

Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB) alle repo-overeenkomsten en transacties uit hoofde van repo-overeenkomsten, waaronder driepartijenrepo's die luiden in euro met een looptijd tot en met één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de transactiedatum) tussen de informatieplichtige en financiële vennootschappen (met uitsluiting van centrale banken wanneer de transactie niet bestemd is voor investeringen), overheid, of niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader. Intragroep transacties worden uitgesloten.

## DEEL 2

**SOORT GEGEVENS**

1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens (\*) die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Gerapporteerde status van de transactie	Dit attribuut specificeert of de transactie een nieuwe transactie is, een wijziging van een eerder gerapporteerde transactie of een correctie van een eerder gerapporteerde transactie.	
Status schuldvernieuwing	Dit attribuut specificeert of de transactie een schuldvernieuwing is.	
Unieke transactie-identificatiecode	De unieke code waarmee een transactie kan geïdentificeerd worden in het desbetreffende marktsegment.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.
Identificatie transactie met eigen vermogen	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte unieke interne identificatiecode. De identificatie van de transactie met eigen vermogen is uniek voor elke gerapporteerde transactie per geldmarktsegment en informatieplichtige.	
Identificatie gerelateerde transactie met eigen vermogen	De unieke interne transactie-identificatiecode die door de informatieplichtige wordt gebruikt voor de oorspronkelijke transactie die vervolgens is vernieuwd.	Rapportage van dit veld is verplicht indien toepasselijk.
Identificatie transactie met eigen vermogen wederpartij	De identificatie van de transactie met eigen vermogen die door de wederpartij van de informatieplichtige wordt toegekend voor dezelfde transactie.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Identificatie wederpartij	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	De Identificatiecode voor juridische entiteiten (Legal Entity Identifier (LEI)) moet onder alle omstandigheden waarbij een wederpartij een dergelijke identificatiecode kreeg, worden gebruikt. De sector van de wederpartij en de vestigingsplaats van de wederpartij moeten gerapporteerd worden als geen LEI-code is toegekend.
Sector van de wederpartij	De institutionele sector van de wederpartij.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Vestigingsplaats wederpartij	De Internationale Organisatie voor Standardisatie (ISO)- landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Identificatie van de tripartiete agent	Wederpartij-identificatiecode van de tripartiete agent.	Rapportage in dit veld is vereist voor driepartijtransacties. De LEI-code moet in alle omstandigheden gebruikt worden waarbij de agent een dergelijke identificatiecode heeft gekregen.
Rapportagedatum	De startdatum en einddatum van de periode waarnaar de transactiegegevens in het bestand verwijzen.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de financiële transactie aangaan.	
Afwikkelingsdatum	De datum waarop het contant geld oorspronkelijk wordt uitgewisseld tegen de contractueel overeengekomen activa.	In geval van een rollover van openbasisrepotransacties is dat de datum waarop de rollover afgewikkeld wordt (zelfs als geen contant geld wordt uitgewisseld).
Vervaldatum	De terugkoopdatum, d.w.z. de datum waarop het contant geld moet worden teruggegeven of ontvangen in ruil voor de actiefpost die als zekerheid is verstrekt of ontvangen.	
Soort transactie	Dit attribuut specificeert of de transactie wordt uitgevoerd voor geldleningen opnemen of verstrekken.	
Nominaal transactiebedrag	Het initieel opgenomen of verstrekte bedrag.	
Rentevoettype	Om aan te geven of het instrument een vast of een variabel rentepercentage heeft.	
Rentepercentage van overeenkomst	Het rentetarief uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-geldmarktconventie waartegen de retrocessieovereenkomst werd afgesloten en welk rentetarief wordt toegepast op het verstrekte contante geld.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor vastrentende instrumenten.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Referentierente-index	Het internationaal identificatienummer voor waardepapieren (ISIN) van het onderliggende referentietarief op basis waarvan de periodieke rentebetalingen berekend worden.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor instrumenten met variabele rente.
Basispuntenverschil	Het aantal aan de onderliggende referentierente toegevoegde (indien positief) of daarvan afgetrokken (indien negatief) basispunten ter berekening van de voor een bepaalde periode werkelijke toepasselijke rentevoet bij de uitgifte van het instrument met variabele rente.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor instrumenten met variabele rente.
Onderpand ISIN	De ISIN van het door onderpand gedekte actief	Rapportage van dit veld is optioneel voor tripartiete retrocessieovereenkomsten die niet worden gesloten tegen een mandje van effecten waarvoor een generieke ISIN bestaat, of soorten onderpand waarvoor geen ISIN bestaat. Wanneer de ISIN van het door onderpand gedekte actief niet wordt verstrekt, moeten het soort onderpand, de emittent van het onderpand en de onderpandpool worden verstrekt.
Onderpandpool	Ter indicatie of de in pand gegeven activa een onderpandpool is.	
Type van het onderpand	Ter identificatie van de activacategorie die als onderpand in pand is gegeven.	Verplicht indien de Onderpand-ISIN niet verstrekt wordt.
Sector van onderpandemittent	De institutionele sector van de emittent van het onderpand.	Verplicht indien de Onderpand-ISIN niet verstrekt wordt.
Indicator specifiek onderpand	Ter identificering van alle retrocessieovereenkomsten die uitgevoerd worden tegen verstrekking van algemeen onderpand en retrocessieovereenkomsten die uitgevoerd worden tegen verstrekking van specifiek onderpand.	Alleen in te vullen indien zulks voor de informatieplichtige haalbaar is.
Nominaal onderpandbedrag	Het nominale bedrag in euro van de activa die als onderpand worden gegeven.	Optioneel voor driepartijenrepo's en alle transacties waarin de verstrekte zekerheid niet middels een ISIN geïdentificeerd wordt.
Onderpandsurpluspercentage	Een risicobeheersingsmaatregel die wordt toegepast op het onderliggende onderpand, waarvan de waarde wordt berekend als de marktwaarde van de activa verminderd met een bepaald percentage (surpluspercentage (haircut)).	Rapportage in dit veld is vereist voor individuele onderpandtransacties, in andere gevallen optioneel.

## 2. Materialiteitsdrempel:

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moeten alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geïdentificeerde niet-financiële vennootschappen (\*\*).

(\*) De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op de ECB-website: <http://www.ecb.europa.eu>

(\*\*) Zie „Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools”, Bazel Comité voor banktoezicht, januari 2013, blz. 23-27, beschikbaar op de website van de Bank voor Internationale Betalingen: <http://www.bis.org/>

## BIJLAGE II

## „BIJLAGE II

**Rapportageschema voor met ongedekte transacties verband houdende geldmarktstatistieken**

## DEEL 1

## TYPE INSTRUMENT

1. Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB):
- alle leenactiviteiten die de in de volgende tabel opgesomde instrumenten gebruiken, die luiden in euro met een looptijd van hoogstens één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum) tussen de informatieplichtige en financiële vennootschappen (met uitsluiting van centrale banken wanneer de transactie niet bestemd is voor investeringen), overheid, of niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader;
  - alle leenactiviteiten luidende in euro aan andere kredietinstellingen met een looptijd van hoogstens één jaar (zijnde transacties met een looptijd van ten hoogste 397 dagen na de afwikkelingsdatum) middels ongedekte deposito's of zichtrekeningen, of middels de aankoop van de uitgevende instellingen van commercial papier, depositocertificaten, floating rate notes en overige schuldbewijzen met een looptijd van ten hoogste één jaar.
- Voor de toepassing van bovenstaande de leden 1(a) en (b) worden intragroep transacties uitgesloten.
2. De hiernavolgende tabel bevat een gedetailleerde standaardbeschrijving van de instrumentcategorieën voor transacties die informatieplichtigen aan de ECB moeten rapporteren. Indien de informatieplichtigen aan hun betrokken NCB de transacties moeten rapporteren, moet de betrokken NCB deze beschrijvingen van de instrumentcategorieën op nationaal niveau overeenkomstig deze verordening omzetten.

Type instrument	Beschrijving
Deposito's	Ongedekte rentedragende deposito's (waaronder zichtrekeningen met uitzondering van rekeningen courant) met hetzij een opzegtermijn, hetzij een looptijd van hoogstens één jaar, d.w.z. hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum, die de informatieplichtige hetzij opneemt (opgenomen lening), hetzij plaatst.
Zichtrekening/daggeld	Kasrekeningen met een dagelijks wijzigend rentetarief waaruit regelmatige rentebetalingen of renteberekeningen voortvloeien, en een aankondigingstermijn voor het opnemen van geld. Spaarrekening met een aankondigingstermijn voor het opnemen van geld.
Depositocertificaat	Een schuldbewijs met een vaste looptijd in een verhandelbare of niet-verhandelbare vorm, uitgegeven door een MFI die de houder recht geeft op een bepaalde vaste rentevoet gedurende een vaste termijn van hoogstens een jaar, d.w.z. hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum en hetzij rentedragend, hetzij met disagio is uitgegeven.
Commercieel papier	Een ongedekt schuldbewijs uitgegeven door een MFI met een looptijd van ten hoogste één jaar, d.w.z. hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum en hetzij rentedragend is of met disagio is uitgegeven.
Asset-backed commercial paper	Een door een MFI uitgegeven schuldbewijs met een looptijd van ten hoogste één jaar, d.w.z. ten hoogste 397 dagen na de afwikkelingsdatum, dat hetzij rentedragend, hetzij met disagio is uitgegeven en gedekt is door een zekerheid in de vorm van onderpand.
Obligaties met een variabel tarief („Floating rate note”)	Een schuldbewijs waarvoor de periodieke interestbetalingen zijn berekend op basis van de waarde, d.w.z. het vastleggen van een onderliggend rentetarief zoals de euro interbank offered rate (Euribor), op vooraf bepaalde data die ook wel vaststellingsdata genoemd worden, met een looptijd van ten hoogste één jaar, d.w.z. hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum.



Type instrument	Beschrijving
Overige kortlopende schuldbewijzen	<p>Door informatieplichtigen uitgegeven niet-achtergestelde effecten, andere dan eigenvermogensbeleggingen, met een looptijd van ten hoogste één jaar, d.w.z. hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum, welke instrumenten doorgaans verhandelbaar zijn en op secundaire markten worden verhandeld of op de markt kunnen worden verrekend en die de houder geen eigendomsrechten verlenen met betrekking tot de emitterende instelling. Hiertoe behoren:</p> <p>a) effecten die de houder een onvoorwaardelijk recht geven op een vast of contractueel bepaald inkomen in de vorm van couponbetalingen en/of vast bedrag op een bepaalde datum (of op bepaalde data), dan wel vanaf een bij de emissie vastgestelde datum;</p> <p>b) niet-verhandelbare door informatieplichtigen uitgegeven instrumenten die nadien verhandelbaar worden en als „schuldbewijzen” geherclassificeerd dienen te worden.</p>

## DEEL 2

## SOORT GEGEVENS

1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens (\*) die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Gerapporteerde status van de transactie	Dit attribuut specificeert of de transactie een nieuwe transactie is, een wijziging van een eerder gerapporteerde transactie of een correctie van een eerder gerapporteerde transactie.	
Status schuldvernieuwing	Dit attribuut specificeert of de transactie een schuldvernieuwing is.	
Unieke transactie-identificatiecode	De unieke code waarmee een transactie kan geïdentificeerd worden in het desbetreffende marktsegment.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.
Identificatie transactie met eigen vermogen	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte unieke interne identificatiecode. De identificatie van de transactie met eigen vermogen is uniek voor elke gerapporteerde transactie per geldmarktsegment en informatieplichtige.	
Identificatie gerelateerde transactie met eigen vermogen	De unieke interne transactie-identificatiecode die door de informatieplichtige wordt gebruikt voor de oorspronkelijke transactie die vervolgens is vernieuwd.	Rapportage van dit veld is verplicht indien toepasselijk.
Identificatie transactie met eigen vermogen wederpartij	De identificatie van de transactie met eigen vermogen die door de wederpartij van de informatieplichtige wordt toegekend voor dezelfde transactie.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Identificatie wederpartij	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	De Identificatiecode voor juridische entiteiten (Legal Entity Identifier (LEI)) moet onder alle omstandigheden waarbij een wederpartij een dergelijke identificatiecode kreeg, worden gebruikt. De sector van de wederpartij en de vestigingsplaats van de wederpartij moeten gerapporteerd worden als geen LEI-code is toegekend.
Sector van de wederpartij	De institutionele sector van de wederpartij.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Vestigingsplaats wederpartij	De Internationale Organisatie voor Standardisatie (ISO)- landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Rapportagedatum	De startdatum en einddatum van de periode waarnaar de transactiegegevens in het bestand verwijzen.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de gerapporteerde financiële transactie aangaan.	
Afwikkelingsdatum	De datum waarop het bedrag aan geld door wederpartijen wordt uitgewisseld of waarop de aankoop of verkoop van een schuldbewijs afgewikkeld wordt.	In geval van zichtrekeningen en andere ongedekte opgenomen/verstrekte leningen met opzegtermijn, de datum waarop het deposito wordt gecontinueerd (d.w.z. op de datum waarop het deposito terugbetaald zou zijn indien het opgeëist en gediscontinueerd zou zijn).
Vervaldatum	De datum waarop de geldnemer het verschuldigde geld aan de geldgever terug moet betalen of waarop een schuldinstrument vervalt en terugbetaald moet worden.	
Type instrument	Het instrument waarmee het opnemen/verstrekken van leningen plaatsvindt.	
Soort transactie	Dit attribuut specificiert of de transactie wordt uitgevoerd voor geldleningen opnemen of verstrekken.	
Nominaal transactiebedrag	Het bedrag aan geld in euro dat op deposito's opgenomen of verstrekt wordt. In geval van schuldbewijzen is dit het nominale bedrag van het uitgegeven/aangekochte schuldbewijs.	
Werkelijke prijs van de transactie	De „dirty price” (d.w.z. de prijs die alle opgebouwde rente omvat) waartegen het effect wordt uitgegeven of verhandeld.	Moet voor ongedekte deposito's als 100 gerapporteerd worden.
Rentevoettipe	Om aan te geven of het instrument een vast of een variabel rentepercentage heeft.	

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Rentepercentage van overeenkomst	Het rentetarief (uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-dagen geldmarktconventie) waartegen het deposito werd afgesloten en welk rentetarief wordt toegepast op het verstrekte contante geld. Voor schuldinstrumenten, het effectieve rentepercentage (uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-dagen geldmarktconventie) tegen welk percentage het instrument werd uitgegeven of aangekocht.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor vastrentende instrumenten.
Referentierente-index	Het internationaal identificatienummer voor waardepapieren (ISIN) van het onderliggende referentietarief op basis waarvan de periodieke rentebetalingen berekend worden.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor instrumenten met variabele rente.
Basispuntenverschil	Het aantal aan het referentietarief toegevoegde (indien positief) of daarvan afgetrokken (indien negatief) basispunten ter berekening van de voor een bepaalde periode werkelijke toepasselijke rentevoet.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor instrumenten met variabele rente.
Call of put	Om aan te geven of het instrument een call- of putoptie heeft.	Rapportage in dit veld is uitsluitend vereist voor opeisbare instrumenten/instrumenten met terugneemverplichting.
Eerste call-/putdatum	De eerste datum waarop de call-of putoptie uitgeoefend kan worden.	Rapportage in dit veld is uitsluitend verplicht voor instrumenten met een call-optie of een put-optie die kan uitgeoefend worden op één of meerdere vooraf bepaalde datums.
Call-/putopzegtermijn	Het aantal aan de houder van het instrument/de emittent van het instrument door de emittent/houder van het instrument te notificeren kalenderdagen, zulks voorafgaande aan de uitoefening van de put/call-optie.	Rapportage van dit veld is uitsluitend vereist voor alle instrumenten/transacties met een call-/putopzegtermijn en voor deposito's met een vooraf overeengekomen opzegtermijn.

## 2. Materialiteitsdrempel:

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moeten alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geclassificeerde niet-financiële vennootschappen.

(\*) De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op de ECB-website: <http://www.ecb.europa.eu>

## BIJLAGE III

## „BIJLAGE III

**Rapportageschema voor met derivatentransacties verband houdende geldmarktstatistieken**

## DEEL 1

**TYPE INSTRUMENT**

Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB):

- a) alle deviezenswaps waarbij euro contant worden aangekocht tegen betaling van een vreemde valuta en die euro op een toekomstige datum worden herverkocht of heraangekocht tegen een vooraf overeengekomen deviezenkoers met een looptijd tot en met één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de afwikkelingsdatum van het contante deel van de deviezenswaptransactie) tussen de informatieplichtige en financiële vennootschappen (met uitsluiting van centrale banken wanneer de transactie niet bestemd is voor investeringen), overheid, of niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader;
- b) oversight index swaps (OIS) transacties, luidend in euro, tussen de informatieplichtige en financiële vennootschappen (met uitsluiting van centrale banken wanneer de transactie niet bestemd is voor investeringen), overheid, of niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader.

Voor de toepassing van bovenstaande de leden 1(a) en (b) worden intragroep transacties uitgesloten.

## DEEL 2

**SOORT GEGEVENS**

1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens (\*) voor deviezenswaps die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Gerapporteerde status van de transactie	Dit attribuut specificeert of de transactie een nieuwe transactie is, een wijziging van een eerder gerapporteerde transactie of een correctie van een eerder gerapporteerde transactie.	
Status schuldvernieuwing	Dit attribuut specificeert of de transactie een schuldvernieuwing is.	
Unieke transactie-identificatiecode	De unieke code waarmee een transactie kan geïdentificeerd worden in het desbetreffende marktsegment.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.
Identificatie transactie met eigen vermogen	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte unieke interne identificatiecode. De identificatie van de transactie met eigen vermogen is uniek voor elke gerapporteerde transactie per geldmarktsegment en informatieplichtige.	
Identificatie gerelateerde transactie met eigen vermogen	De unieke interne transactie-identificatiecode die door de informatieplichtige wordt gebruikt voor de oorspronkelijke transactie die vervolgens is vernieuwd.	Rapportage van dit veld is verplicht indien toepasselijk.
Identificatie transactie met eigen vermogen wederpartij	De identificatie van de transactie met eigen vermogen die door de wederpartij van de informatieplichtige wordt toegekend voor dezelfde transactie.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Identificatie wederpartij	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	De Identificatiecode voor juridische entiteiten (Legal Entity Identifier (LEI)) moet onder alle omstandigheden waarbij een wederpartij een dergelijke identificatiecode kreeg, worden gebruikt. De sector van de wederpartij en de vestigingsplaats van wederpartij moeten gerapporteerd worden als geen LEI-code werd toegekend.
Sector van de wederpartij	De institutionele sector van de wederpartij.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Vestigingsplaats wederpartij	De Internationale Organisatie voor Standardisatie (ISO)- landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Rapportagedatum	De startdatum en einddatum van de periode waarnaar de transactiegegevens in het bestand verwijzen.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de gerapporteerde financiële transactie aangaan.	
Contante valutadatum	De datum waarop een partij aan de andere partij een specifiek bedrag van een specifieke valuta verkoopt tegen betaling van een overeengekomen bedrag van een specifieke andere valuta gebaseerd op een overeengekomen wisselkoers, ook wel de contante koers van de vreemde valuta genoemd.	
Vervaldatum	De datum waarop de swaptransactie van de vreemde valuta afloopt en de verkochte valuta op de contante valutadatum weer wordt aangekocht.	
Soort valutamarktoperatie	Dit attribuut specificeert of het eurobedrag dat uit hoofde van het nominale transactiebedrag werd gerapporteerd op de contante valutadatum wordt aangekocht of verkocht. Dit moet verwijzen naar de contante euro (euro spot), d.w.z. of euro wordt aangekocht of verkocht op de contante valutadatum.	
Nominaal transactiebedrag	Het nominale bedrag in euro van deviezenswap.	
Deviezencode	De internationale driecijfer ISO-code van in ruil voor euro aangekochte/verkochte valuta.	
Contante koers van de deviezen	De wisselkoers tussen de euro en de op het eerste deel van de deviezenswaptransactie toepasselijke vreemde valuta.	

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Deviezentermijntransacties	Het verschil tussen de deviezentermijnkoers en contante koers van de deviezen, uitgedrukt in basispunten genoteerd volgens de heersende marktconventies voor het deviezenpaar.	

2. Soort van op transacties gebaseerde gegevens voor OIS-transacties die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Gerapporteerde status van de transactie	Dit attribuut specificeert of de transactie een nieuwe transactie is, een wijziging van een eerder gerapporteerde transactie of een correctie van een eerder gerapporteerde transactie.	
Status schuldvernieuwing	Dit attribuut specificeert of de transactie een schuldvernieuwing is.	
Unieke transactie-identificatiecode	De unieke code waarmee een transactie kan geïdentificeerd worden in het desbetreffende marktsegment.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.
Identificatie transactie met eigen vermogen	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte unieke interne identificatiecode. De identificatie van de transactie met eigen vermogen is uniek voor elke gerapporteerde transactie per geldmarktsegment en informatieplichtige.	
Identificatie gerelateerde transactie met eigen vermogen	De unieke interne transactie-identificatiecode die door de informatieplichtige wordt gebruikt voor de oorspronkelijke transactie die vervolgens is vernieuwd.	Rapportage van dit veld is verplicht indien toepasselijk.
Identificatie transactie met eigen vermogen wederpartij	De identificatie van de transactie met eigen vermogen die door de wederpartij van de informatieplichtige wordt toegekend voor dezelfde transactie.	Rapportage van dit veld is verplicht indien beschikbaar.
Identificatie wederpartij	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	De LEI-code moet in alle omstandigheden waarbij de wederpartij een dergelijke identificatiecode heeft gekregen, gebruikt worden. De sector van de wederpartij en de vestigingsplaats van de wederpartij moeten gerapporteerd worden als geen LEI-code is toegekend.
Sector van de wederpartij	De institutionele sector van de wederpartij.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Vestigingsplaats wederpartij	ISO-landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de identificatie van de wederpartij niet verstrekt wordt.
Rapportagedatum	De startdatum en einddatum van de periode waarnaar de transactiegegevens in het bestand verwijzen.	

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	Facultatief.
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de financiële transactie aangaan.	
Startdatum	De datum waarop het overnighttarief van het variabelrentend deel berekend wordt.	
Vervaldatum	De laatste datum van de periode waarover het samengestelde overnighttarief berekend wordt.	
Vaste rentevoet	De bij de berekening van de OIS-uitbetaling gehanteerde vaste rentevoet.	
Soort transactie	Een attribuut dat aangeeft of het vaste rentetarief door de informatieplichtige wordt betaald of ontvangen.	
Nominaal transactiebedrag	Het notionele IOS-bedrag.	

### 3. Materialiteitsdrempel:

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moeten alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geclassificeerde niet-financiële vennootschappen.

(\*) De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op de ECB-website: <http://www.ecb.europa.eu>

## BIJLAGE IV

## „BIJLAGE IV

**Door de werkelijke populatie van informatieplichtigen toe te passen minimumnormen**

Informatieplichtigen moeten de volgende minimumnormen in acht nemen, om aan de statistische rapportagevereisten van de Europese Centrale Bank (ECB) te voldoen.

## 1. Minimumnormen voor transmissie:

- i) de rapportage gebeurt tijdig en binnen de termijn die door de ECB en de betreffende nationale centrale bank (NCB) is vastgesteld;
- ii) vorm en formaat van de statistische rapporten moeten voldoen aan de technische rapportagevereisten die door de ECB en betreffende NCB zijn vastgesteld;
- iii) de informatieplichtige moet de ECB en de betrokken NCB details verstrekken inzake één of meerdere contactpersonen;
- iv) de datatransmissie aan de ECB en desbetreffende NCB moet gebeuren met inachtneming van de daarvoor vastgestelde technische specificaties.

## 2. Minimumnormen voor nauwkeurigheid:

- i) statistische informatie moet juist zijn;
- ii) informatieplichtigen moeten in staat zijn gegevens te verschaffen met betrekking tot de door de verzonden gegevens geïmpliceerde ontwikkelingen;
- iii) statistische gegevens moeten volledig zijn en mogen geen voortdurende en structurele leemten bevatten; er moet gewezen worden op eventuele leemten, waarvoor aan de ECB en de betrokken NCB een verklaring moet worden gegeven en die, waar van toepassing, zo snel mogelijk moeten worden verholpen;
- iv) informatieplichtigen moeten voor de technische gegevenstransmissie de door de ECB en de betrokken NCB vastgestelde afmetingen, afrondingsbeleid en decimalen in acht nemen.

## 3. Minimumnormen voor conceptuele naleving:

- i) statistische gegevens worden gepresenteerd met inachtneming van de definities en indelingen zoals vervat in deze verordening;
- ii) in geval van afwijking van deze definities en indelingen, moeten informatieplichtigen op gezette tijden het verschil monitoren en kwantificeren tussen de gebruikte maatstaf en de maatstaf in deze verordening;
- iii) informatieplichtigen moeten een verklaring kunnen geven voor een eventuele breuk in de verstrekte gegevens ten opzichte van de cijfers van voorgaande perioden.

## 4. Minimumnormen voor herzieningen:

De informatieplichtigen moeten het herzieningsbeleid en de herzieningsprocedures volgen die door de ECB en de desbetreffende NCB zijn vastgesteld. Herzieningen die afwijken van regelmatige herzieningen worden van een toelichting voorzien.

## 5. Minimumnormen voor integriteit van de gegevens:

- i) statistische gegevens moeten door informatieplichtigen gecompileerd en verzonden worden op een onpartijdige en objectieve manier;
  - ii) fouten in de verstrekte gegevens moeten gecorrigeerd worden en zo snel mogelijk meegedeeld worden aan de ECB en de betrokken NCB.”
-