

REGULAMENTUL (UE) 2019/113 AL BĂNCII CENTRALE EUROPENE**din 7 decembrie 2018****de modificare a Regulamentului (UE) nr. 1333/2014 privind statisticile referitoare la piețele monetare (BCE/2018/33)**

CONSILIUL GUVERNATORILOR BĂNCII CENTRALE EUROPENE,

având în vedere Tratatul privind funcționarea Uniunii Europene,

având în vedere Statutul Sistemului European al Băncilor Centrale și al Băncii Centrale Europene, în special articolul 5,

având în vedere Regulamentul (CE) nr. 2533/98 al Consiliului din 23 noiembrie 1998 privind colectarea informațiilor statistice de către Banca Centrală Europeană ⁽¹⁾, în special articolul 5 alineatul (1) și articolul 6 alineatul (4),

după consultarea Comisiei Europene,

întrucât:

- (1) Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 al Băncii Centrale Europene (BCE/2014/48) ⁽²⁾ prevede raportarea datelor statistice de către agenții raportori pentru ca Sistemul European al Băncilor Centrale (SEBC), în îndeplinirea atribuțiilor ce îi revin, să poată produce statistici privind piața monetară în euro.
- (2) Pentru a se asigura existența unor statistici de calitate privind piața monetară în euro, este necesară modificarea anumitor dispoziții ale Regulamentului (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48). În special, este important să se asigure că fiecare agent raportor raportează Băncii Centrale Europene (BCE) sau băncii centrale naționale (BCN) relevante toate tranzacțiile efectuate de agentul raportor cu societăți financiare (cu excepția băncilor centrale atunci când tranzacția nu este în scopuri de investiții), precum și cu administrația publică și anumite societăți nefinanciare. În plus, este necesar să se asigure că colectarea datelor beneficiază de utilizarea obligatorie extinsă a identificatorului persoanei juridice (*legal entity identifier* – LEI) în raportarea în Uniune.
- (3) Dată fiind importanța asigurării disponibilității în timp util a statisticilor privind piața monetară în euro, este de asemenea necesară armonizarea și întărirea obligațiilor agenților raportori de a transmite BCN sau BCE informații în timp util.
- (4) Ar trebui luate măsuri de precauție pentru a se asigura colectarea, compilarea și transmiterea informațiilor statistice de către agenții raportori într-o modalitate care să protejeze integritatea informațiilor. În special, este important să se sublinieze că informațiile statistice primite de BCN sau de BCE ar trebui să fie imparțiale, respectiv să constituie o reprezentare neutră a unor tranzacții observabile inițiate în condiții de concurență normală de agentul raportor, obiective și fiabile, pentru a respecta principiile generale din Angajamentul public al SEBC privind statisticile europene ⁽³⁾. În plus, agenții raportori ar trebui să asigure că orice erori în informațiile statistice raportate sunt corectate și comunicate BCE și BCN relevante cât mai repede posibil.
- (5) Punerea în aplicare a acestor dispoziții va asigura că SEBC dispune de informații statistice mai prompte, cuprinzătoare, detaliate, armonizate și fiabile privind piața monetară în euro, care vor permite o analiză mai aprofundată a mecanismului de transmisie a politicii monetare. În plus, datele colectate pot fi utilizate pentru elaborarea și administrarea unei rate a dobânzii overnight la operațiunile negarantate în euro.
- (6) Prin urmare, Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) ar trebui modificat în mod corespunzător,

⁽¹⁾ JO L 318, 27.11.1998, p. 8.

⁽²⁾ Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 al Băncii Centrale Europene din 26 noiembrie 2014 privind statisticile referitoare la piețele monetare (BCE/2014/48) (JO L 359, 16.12.2014, p. 97).

⁽³⁾ Disponibil pe website-ul BCE, la adresa www.ecb.europa.eu

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

Articolul 1

Modificări

Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se modifică după cum urmează:

1. Articolul 1 se modifică după cum urmează:

(a) se introduce următorul punct 5a:

„5a. «societăți financiare» înseamnă unități instituționale dotate cu personalitate juridică, care sunt producători de piață și a căror activitate principală constă în producerea de servicii financiare, astfel cum se stabilește în Sistemul european de conturi revizuit (SEC 2010), prevăzut de Regulamentul (UE) nr. 549/2013 al Parlamentului European și al Consiliului (*);

(*) Regulamentul (UE) nr. 549/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 21 mai 2013 privind Sistemul european de conturi naționale și regionale din Uniunea Europeană (JO L 174, 26.6.2013, p. 1).”;

(b) punctele 3-5 se elimină;

(c) punctul 9 se înlocuiește cu următorul text:

„9. «statistici referitoare la piețele monetare» înseamnă statisticile referitoare la tranzacții garantate, negarantate și cu instrumente financiare derivate având ca obiect instrumente de piață monetară, încheiate în perioada de raportare relevantă între agenți raportori și societăți financiare (cu excepția băncilor centrale atunci când tranzacția nu este în scopuri de investiții), administrația publică sau societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR, dar excluzând tranzacțiile intragrup.”;

(d) punctul 14 se înlocuiește cu următorul text:

„14. «unități de observare statistică de referință cu obligații de raportare» înseamnă IFM rezidente în zona euro, cu excepția băncilor centrale și a FPM, care atrag depozite exprimate în euro și/sau emit orice alt instrument de natura datoriei și/sau acordă credite exprimate în euro, astfel cum sunt enumerate în anexele I, II sau III, de la/către alte societăți financiare, administrația publică sau societăți nefinanciare.”;

(e) se introduce următorul punct 20a:

„20a. «instituție de credit» are sensul definit la articolul 4 alineatul (1) punctul 1 din Regulamentul (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului (*);

(*) Regulamentul (UE) nr. 575/2013 al Parlamentului European și al Consiliului din 26 iunie 2013 privind cerințele prudențiale pentru instituțiile de credit și firmele de investiții și de modificare a Regulamentului (UE) nr. 648/2012 (JO L 176, 27.6.2013, p. 1).”;

(f) punctul 25 se înlocuiește cu următorul text:

„25. «swap pe indicii ratei dobânzii overnight» sau «OIS» (*overnight index swap*) înseamnă un swap pe rata dobânzii în care rata variabilă periodică a dobânzii este egală cu media geometrică a unei rate overnight (sau a unui indice al ratei dobânzii overnight) pe o perioadă de timp specificată. Plata finală va fi calculată ca diferența dintre rata fixă a dobânzii și rata overnight compusă înregistrată pe durata vieții OIS aplicată valorii nominale a tranzacției.”;

2. Articolul 3 se modifică după cum urmează:

(a) alineatul (1) se înlocuiește cu următorul text:

„(1) În scopul elaborării periodice a statisticilor referitoare la piețele monetare, agenții raportori raportează către BCN a statului membru în care sunt rezidenți, pe bază consolidată, inclusiv pentru toate sucursalele acestora din Uniune și AELS, informații statistice zilnice referitoare la instrumentele de piață monetară. Informațiile statistice solicitate sunt specificate în anexele I, II și III. Agenții raportori raportează informațiile statistice cerute în conformitate cu standardele minime de transmitere, de acuratețe, de conformitate cu conceptele, de revizuire și de integritate a datelor prevăzute în anexa IV. BCN transmite informațiile statistice pe care le primește de la agenții raportori către BCE în conformitate cu articolul 4 alineatul (2) din prezentul regulament.”;

(b) alineatul (2) se înlocuiește cu următorul text:

„(2) BCN definesc și pun în aplicare mecanismele de raportare care trebuie urmate de agenții raportori cu privire la instrumentele de piață monetară. Aceste mecanisme de raportare asigură furnizarea informațiilor statistice solicitate și permit verificarea cu precizie a respectării standardelor minime prevăzute în anexa IV.”;

(c) alineatul (5) se înlocuiește cu următorul text:

„(5) BCN definesc și pun în aplicare mecanismele de raportare care trebuie respectate de către agenții raportori suplimentari în conformitate cu cerințele de raportare statistică naționale ale acestora. BCN se asigură că mecanismele naționale de raportare impun agenților raportori suplimentari să respecte cerințe care sunt echivalente articolelor 6-8, articolului 10 alineatul (3) și articolelor 11-12 din prezentul regulament. BCN se asigură că aceste mecanisme de raportare furnizează informațiile statistice solicitate și permit verificarea cu precizie a respectării standardelor minime prevăzute în anexa IV.”

3. Articolul 4 se modifică după cum urmează:

(a) alineatul (1) se înlocuiește cu următorul text:

„(1) În cazul în care BCN decide, în conformitate cu articolul 3 alineatul (3), ca agenții raportori să raporteze informațiile statistice specificate în anexele I, II și III direct către BCE, agenții raportori transmit zilnic aceste informații către BCE, între ora 18.00 în data tranzacției și ora 7.00 ora Europei Centrale (CET) (*), în prima zi de decontare TARGET2 după data tranzacției.

(*) CET ia în considerare trecerea la ora de vară a Europei Centrale.”;

(b) alineatul (2) se înlocuiește cu următorul text:

„(2) În orice alt caz decât cel de la alineatul (1), BCN transmit zilnic către BCE informațiile statistice zilnice privind piața monetară, astfel cum se specifică la anexele I, II și III, pe care le primesc de la agenții raportori selectați în conformitate cu articolul 2 alineatele (2), (3) și (4) sau de la agenții raportori suplimentari selectați în conformitate cu articolul 2 alineatul (6), înainte de ora 7.00 CET în prima zi de decontare TARGET2 după data tranzacției.”;

(c) se adaugă următorul alineat (5):

„(5) La evaluarea măsurii în care un agent raportor a îndeplinit cerințele prevăzute la prezentul articol, încălcarea oricăruia dintre standardele minime de transmitere stabilite în anexa IV punctul 1 subpunctele (i)-(ii) constituie un caz de nerespectare a aceluiași tip de cerință de raportare în scopul stabilirii nerespectării în cadrul BCE privind nerespectarea.”

4. Articolul 5 se elimină.

5. Anexa I la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se înlocuiește cu textul din anexa I la prezentul regulament.

6. Anexa II la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se înlocuiește cu textul din anexa II la prezentul regulament.

7. Anexa III la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se înlocuiește cu textul din anexa III la prezentul regulament.

8. Anexa IV la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se înlocuiește cu textul din anexa IV la prezentul regulament.

Articolul 2

Dispoziții finale

Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Se aplică de la 15 martie 2019.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în statele membre în conformitate cu tratatele.

Adoptat la Frankfurt pe Main, 7 decembrie 2018.

Pentru Consiliul guvernatorilor BCE

Președintele BCE

Mario DRAGHI

ANEXA I

„ANEXA I

Sistem de raportare pentru statisticile referitoare la piețele monetare în ceea ce privește tranzacțiile garantate

PARTEA 1

TIP DE INSTRUMENTE

Agenții raportori raportează către Banca Centrală Europeană (BCE) sau banca centrală națională (BCN) relevantă toate acordurile de răscumpărare și tranzacțiile inițiate în cadrul acestora, inclusiv operațiunile repo tripartite, care sunt exprimate în euro cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 de zile după data decontării), între agentul raportor și societăți financiare (cu excepția băncilor centrale atunci când tranzacția nu este în scopuri de investiții), administrația publică sau societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR. Tranzacțiile intragrup sunt excluse.

PARTEA 2

TIP DE DATE

1. Tipul de date bazate pe tranzacții (*) care trebuie raportate pentru fiecare tranzacție:

Câmp	Descrierea datelor	Opțiuni de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Statutul tranzacției raportate	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o tranzacție nouă, o modificare a unei tranzacții raportate anterior, o anulare sau o corectare a unei tranzacții raportate anterior.	
Statutul privind novația	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o novație.	
Identificatorul unic al tranzacției	Codul unic care permite identificarea unei tranzacții în respectivul segment de piață.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.
Identificarea internă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru fiecare tranzacție. Identificarea internă a tranzacției este unică pentru fiecare tranzacție raportată la nivel de segment de piață monetară și agent de raportare.	
Identificarea internă conexă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru tranzacția inițială care a fost ulterior novată.	Raportarea acestui câmp este obligatorie, atunci când este aplicabil.
Identificarea internă a tranzacției atribuită de contraparte	Identificarea internă a tranzacției atribuită de contrapartea agentului raportor aceleiași tranzacții.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Identificarea contrapărții	Un cod de identificare utilizat pentru a recunoaște contrapartea agentului raportor pentru tranzacția raportată.	Codul LEI (identificatorul persoanei juridice) trebuie utilizat în toate împrejurările în care contrapărții i-a fost atribuit un asemenea identificator. Sectorul contrapărții și localizarea contrapărții trebuie raportate dacă nu este atribuit un cod LEI.
Sectorul contrapărții	Sectorul instituțional al contrapărții.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Localizarea contrapărții	Codul de țară al Organizației Internaționale de Standardizare (ISO) pentru țara în care este înregistrată contrapartea.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Identificarea agentului tripartit	Identificatorul contrapărții pentru agentul tripartit.	Raportarea acestui câmp este necesară pentru tranzacțiile tripartite. Codul LEI trebuie utilizat în toate împrejurările în care agentului i-a fost atribuit un asemenea identificator.
Data raportării	Data și ora de început și de sfârșit ale perioadei la care se referă datele privind tranzacțiile din fișier.	
Marca temporală electronică	Momentul în care o tranzacție este încheiată sau înregistrată.	
Data tranzacției	Data la care părțile încheie tranzacția financiară.	
Data decontării	Data la care numerarul este transmis inițial în schimbul activului, astfel cum s-a convenit prin contract.	În cazul unei reinnoiri a unor tranzacții de răscumpărare pe bază deschisă, aceasta este data la care reinnoirea se decontează, chiar dacă nu are loc un schimb de numerar.
Data scadenței	Data răscumpărării, respectiv data la care numerarul trebuie rambursat sau primit în schimbul activului depus sau primit drept colateral.	
Tipul tranzacției	Acest atribut precizează dacă tranzacția se desfășoară pentru luarea sau darea de numerar cu împrumut.	
Valoarea nominală a tranzacției	Suma în euro dată sau luată cu împrumut inițial.	
Tipul de rată	Pentru a identifica dacă instrumentul are o rată fixă sau variabilă.	
Rata tranzacției	Rata dobânzii, exprimată în conformitate cu convenția ACT/360 a piețelor monetare, la care a fost încheiat acordul de răscumpărare și la care este remunerat numerarul împrumutat.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu rată fixă.

Câmp	Descrierea datelor	Opțiuni de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Indicele ratei de referință	Numărul internațional de identificare a valorilor mobiliare (<i>International Securities Identification Number – ISIN</i>) al ratei de referință de bază în funcție de care sunt calculate plățile periodice ale dobânzii.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu rată variabilă.
Marja în puncte de bază	Numărul de puncte de bază adăugate (dacă este pozitiv) la rata de referință de bază sau scăzute (dacă este negativ) din aceasta pentru a calcula rata efectivă a dobânzii aplicabilă pentru o anumită perioadă la emiterea instrumentului cu rată variabilă.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu rată variabilă.
Numărul ISIN al colateralului	Numărul ISIN al activului constituit drept colateral.	Raportarea acestui câmp este opțională pentru acordurile de răscumpărare tripartite care nu sunt efectuate în schimbul unui coș de valori mobiliare pentru care există un număr ISIN generic sau pentru tipurile de colateral pentru care nu este disponibil un număr ISIN. Atunci când nu este furnizat numărul ISIN al activului adus în garanție, trebuie furnizate tipul de colateral, sectorul emitentului de colateral și portofoliul de colateral.
Portofoliul de colateral	Pentru a se indica dacă activul constituit drept colateral este un portofoliu de colateral.	
Tipul de colateral	Pentru a se identifica clasa de active constituită drept colateral.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizat numărul ISIN al colateralului.
Sectorul emitentului de colateral	Sectorul instituțional al emitentului colateralului.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizat numărul ISIN al colateralului.
Indicatorul colateralului special	Pentru a identifica toate acordurile de răscumpărare desfășurate cu colateral general și cele desfășurate cu colateral special.	A se raporta numai dacă este fezabil pentru agentul raportor.
Valoarea nominală a colateralului	Valoarea nominală în euro a activelor constituite drept colateral.	Opțional pentru operațiuni repo tripartite și pentru orice tranzacție în care activele constituite drept colateral nu sunt identificate printr-un număr ISIN.
Marja de ajustare a colateralului	O măsură de control al riscurilor aplicată colateralului suport, unde valoarea acestui colateral se calculează ca valoare de piață a activelor minus un anumit procent (marjă de ajustare).	Raportarea acestui câmp este necesară pentru tranzacțiile cu colateral unic, în rest este opțională.

2. Prag de semnificație

Tranzacțiile încheiate cu societățile nefinanciare ar trebui raportate numai atunci când sunt încheiate cu societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» pe baza cadrului Basel III LCR (**).

(*) Standardele de raportare electronică și specificațiile tehnice ale datelor sunt stabilite separat. Acestea sunt disponibile pe website-ul BCE, la adresa www.ecb.europa.eu

(**) A se vedea «Basel III: Indicele de acoperire a lichidității și instrumentele de monitorizare a riscurilor legate de lichiditate» (*Basel III: The Liquidity Coverage Ratio and liquidity risk monitoring tools*), Comitetul de la Basel pentru supraveghere bancară, ianuarie 2013, pp. 23-27, disponibil pe website-ul Băncii Reglementelor Internaționale, la adresa www.bis.org

ANEXA II

„ANEXA II

Sistem de raportare pentru statisticile referitoare la piețele monetare în ceea ce privește tranzacțiile negarantate

PARTEA 1

TIP DE INSTRUMENTE

1. Agenții raportori raportează către Banca Centrală Europeană (BCE) sau banca centrală națională (BCN) relevantă:

- (a) toate împrumuturile luate utilizând instrumentele definite în tabelul de mai jos, care sunt exprimate în euro cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 de zile după data decontării), de agentul raportor de la societăți financiare (cu excepția băncilor centrale atunci când tranzacția nu este în scopuri de investiții), administrația publică sau societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR;
- (b) toate tranzacțiile de creditare exprimate în euro acordate altor instituții de credit cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 de zile după data decontării) prin depozite negarantate sau depozite la vedere sau prin cumpărarea de la instituțiile de credit emitente de efecte de comerț, certificate de depozit, valori mobiliare cu rată variabilă și alte titluri de natura datoriei cu o scadență de până la un an.

În sensul punctului 1 literele (a) și (b) de mai sus, tranzacțiile intragrup sunt excluse.

2. Tabelul de mai jos oferă o descriere standard detaliată a categoriilor de instrumente pentru tranzacțiile pentru care agenții raportori trebuie să transmită raportări BCE. În cazul în care agenții raportori trebuie să raporteze tranzacțiile către BCN ale acestora, BCN relevantă ar trebui să transpună aceste descrieri ale categoriilor de instrumente la nivel național în conformitate cu prezentul regulament.

Tipul de instrument	Descriere
Depozite	Depozite negarantate purtătoare de dobândă (inclusiv depozite la vedere, dar exclusiv conturile curente) care sunt fie rambursabile la cerere, fie au o scadență de cel mult un an, respectiv cel mult 397 de zile de la data decontării, și care sunt fie luate cu împrumut, fie plasate de agentul raportor.
Depozit la vedere/Sume la vedere	Conturi de numerar cu modificări zilnice ale ratei dobânzii aplicabile, care generează plăți ale dobânzii sau calcule la intervale regulate, și cu o perioadă de notificare pentru retragerea banilor. Cont de economii cu o perioadă de notificare pentru retragerea banilor.
Certificat de depozit	Un instrument de natura datoriei cu rată fixă a dobânzii, în formă negociabilă sau nu, emis de o IFM, care dă dreptul titularului la o rată specifică fixă a dobânzii pe o durată fixă definită, de până la un an, respectiv cel mult 397 de zile de la data decontării, și care este fie purtător de dobânzi, fie cu discount.
Efecte de comerț	Un instrument de natura datoriei negarantat emis de o IFM, care are o scadență de cel mult un an, respectiv cel mult 397 de zile de la data decontării, care este fie purtător de dobânzi, fie cu discount.
Titluri pe termen scurt garantate cu active	Un instrument de natura datoriei emis de o IFM, care are o scadență de cel mult un an, respectiv cel mult 397 de zile de la data decontării, care este fie purtător de dobânzi, fie cu discount, și care este garantat de un anumit tip de colateral.
Valoare mobilă cu rată variabilă	Un instrument de natura datoriei pentru care plățile periodice ale dobânzii se calculează pe baza valorii, respectiv prin fixarea unei rate de referință de bază, precum rata dobânzii interbancare oferită la operațiunile în euro (<i>Euro Interbank Offered Rate – Euribor</i>), la date predefinite cunoscute drept date de fixare, și care are o scadență de cel mult un an, respectiv cel mult 397 de zile de la data decontării.

Tipul de instrument	Descriere
Alte titluri de natura datoriei pe termen scurt	<p>Valori mobiliare nesubordonate, altele decât titlurile de participație, cu o scadență de până la un an, respectiv cel mult 397 de zile de la data decontării, emise de agenții raportori, care sunt instrumente negociabile și tranzacționate în mod obișnuit pe piețele secundare sau care pot fi compensate pe piață și care nu conferă deținătorului vreun drept de proprietate asupra instituției emitente. Acest post include:</p> <p>(a) valori mobiliare care conferă deținătorului un drept necondiționat la un venit fix sau determinat prin contract sub forma plății de cupoane și/sau a unei sume fixe stabilite la o anumită dată (sau date) sau începând de la o dată definită la momentul emisiunii;</p> <p>(b) instrumente nenegociabile emise de agenții raportori care, ulterior, devin negociabile și ar trebui reclasificate ca «titluri de natura datoriei».</p>

PARTEA 2

TIP DE DATE

1. Tipul de date bazate pe tranzacții (*) care trebuie raportate pentru fiecare tranzacție:

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și rezerve suplimentare
Statutul tranzacției raportate	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o tranzacție nouă, o modificare a unei tranzacții raportate anterior, o anulare sau o corectare a unei tranzacții raportate anterior.	
Statutul privind novația	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o novație.	
Identificatorul unic al tranzacției	Codul unic care permite identificarea unei tranzacții în respectivul segment de piață.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.
Identificarea internă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru fiecare tranzacție. Identificarea internă a tranzacției este unică pentru fiecare tranzacție raportată la nivel de segment de piață monetară și agent de raportare.	
Identificarea internă conexă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru tranzacția inițială care a fost ulterior novată.	Raportarea acestui câmp este obligatorie, atunci când este aplicabil.
Identificarea internă a tranzacției atribuită de contraparte	Identificarea internă a tranzacției atribuită de contrapartea agentului raportor aceleiași tranzacții.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și rezerve suplimentare
Identificarea contrapărții	Un cod de identificare utilizat pentru a recunoaște contrapartea agentului raportor pentru tranzacția raportată.	Codul LEI (identificatorul persoanei juridice) trebuie utilizat în toate împrejurările în care contrapărții i-a fost atribuit un asemenea identificator. Sectorul contrapărții și localizarea contrapărții trebuie raportate dacă nu este atribuit un cod LEI.
Sectorul contrapărții	Sectorul instituțional al contrapărții.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Localizarea contrapărții	Codul de țară al Organizației Internaționale de Standardizare (ISO) pentru țara în care este înregistrată contrapartea.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Data raportării	Data și ora de început și de sfârșit ale perioadei la care se referă datele privind tranzacțiile din fișier.	
Marca temporală electronică	Momentul în care o tranzacție este încheiată sau înregistrată.	
Data tranzacției	Data la care părțile încheie tranzacția financiară raportată.	
Data decontării	Data la care suma de bani este transmisă de contrapărți sau la care se decontează cumpărarea sau vânzarea unui instrument de natura datoriei.	În cazul depozitelor la vedere și al altor împrumuturi/credite negarantate rambursabile la cerere, data la care depozitul este reinnoit (respectiv la care ar fi fost rambursat dacă ar fi fost închis și nu ar fi fost reinnoit).
Data scadenței	Data la care suma de bani trebuie rambursată de către debitor creditorului sau la care un instrument de natura datoriei ajunge la scadență și trebuie rambursat.	
Tipul de instrument	Instrumentul prin care are loc creditarea.	
Tipul tranzacției	Acest atribut precizează dacă tranzacția constă în luare de numerar cu împrumut sau în dare de numerar cu împrumut.	
Valoarea nominală a tranzacției	Suma de bani în euro dată sau luată cu împrumut în depozite. În cazul titlurilor de natura datoriei, este valoarea nominală a valorii mobiliare emise/cumpărate.	
Prețul de încheiere al tranzacției	Prețul brut (respectiv, prețul care include orice dobândă acumulată) la care valoarea mobilă este emisă sau tranzacționată, în puncte procentuale.	A se raporta ca 100 pentru depozitele negarantate.
Tipul de rată	Pentru a identifica dacă instrumentul are o rată fixă sau variabilă.	

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și rezerve suplimentare
Rata tranzacției	Rata dobânzii, exprimată în conformitate cu convenția ACT/360 a piețelor monetare, la care a fost efectuat depozitul și la care este remunerată suma în numerar dată cu împrumut. În cazul instrumentelor de natura datoriei, aceasta este rata efectivă a dobânzii, exprimată în conformitate cu convenția ACT/360 a piețelor monetare, la care a fost emis sau cumpărat instrumentul.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu rată fixă.
Indicele ratei de referință	Numărul internațional de identificare a valorilor mobiliare (<i>International Securities Identification Number – ISIN</i>) al ratei de referință de bază în funcție de care sunt calculate plățile periodice ale dobânzii.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu rată variabilă.
Marja în puncte de bază	Numărul de puncte de bază adăugate (dacă este pozitiv) la indicele ratei de referință sau scăzute (dacă este negativ) din acesta pentru a calcula rata efectivă a dobânzii aplicabilă pentru o anumită perioadă la emiterea instrumentului cu rată variabilă.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu rată variabilă.
Opțiune de cumpărare sau de vânzare	Pentru a identifica dacă instrumentul are o opțiune de cumpărare sau o opțiune de vânzare.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele care pot fi răscumpărate/lichidate înainte de scadență.
Prima dată de exercitare a opțiunii de cumpărare/vânzare	Prima dată la care opțiunea de cumpărare sau opțiunea de vânzare poate fi exercitată.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru instrumentele cu o opțiune de cumpărare sau o opțiune de vânzare care poate fi exercitată la una sau mai multe date predefinite.
Perioadă de preaviz pentru cumpărare/vânzare	Numărul de zile calendaristice pe care deținătorul/emitentul instrumentului le va acorda emitentului/deținătorului instrumentului înainte de exercitarea opțiunii de vânzare/cumpărare.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru toate instrumentele/tranzacțiile cu o perioadă de preaviz pentru opțiunea de cumpărare/vânzare și pentru depozitele rambursabile cu o perioadă de preaviz convenită în prealabil.

2. Prag de semnificație:

Tranzacțiile încheiate cu societățile nefinanciare ar trebui raportate numai atunci când sunt încheiate cu societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» pe baza cadrului Basel III LCR.

(*) Standardele de raportare electronică și specificațiile tehnice ale datelor sunt stabilite separat. Acestea sunt disponibile pe website-ul BCE, la adresa www.ecb.europa.eu”

ANEXA III

„ANEXA III

Sistem de raportare pentru statisticile referitoare la piețele monetare în ceea ce privește tranzacțiile cu instrumente financiare derivate

PARTEA 1

TIP DE INSTRUMENTE

Agenții raportori raportează către Banca Centrală Europeană (BCE) sau banca centrală națională (BCN) relevantă:

- (a) toate tranzacțiile de swap pe cursul de schimb, în care se cumpără/vinde euro la vedere în schimbul unei monede străine și se vinde/cumpără înapoi la o dată forward la un curs de schimb valutar forward convenit în prealabil cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 zile de la data decontării componente la vedere a tranzacției de swap pe cursul de schimb), între agentul raportor și societăți financiare (cu excepția băncilor centrale atunci când tranzacția nu este în scopuri de investiții), administrația publică sau societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR;
- (b) tranzacții swap pe indicii ratei dobânzii overnight (*overnight index swaps*) (OIS) exprimate în euro între agentul raportor și societăți financiare (cu excepția băncilor centrale atunci când tranzacția nu este în scopuri de investiții), administrația publică sau societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR.

În sensul literelor (a) și (b) de mai sus, tranzacțiile intragrup sunt excluse.

PARTEA 2

TIP DE DATE

1. Tipul de date bazate pe tranzacții (*) pentru tranzacțiile de swap pe cursul de schimb care trebuie raportate pentru fiecare tranzacție:

Câmp	Descrierea datelor	Opțiuni de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Statutul tranzacției raportate	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o tranzacție nouă, o modificare a unei tranzacții raportate anterior, o anulare sau o corectare a unei tranzacții raportate anterior.	
Statutul privind novația	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o novație.	
Identificatorul unic al tranzacției	Codul unic care permite identificarea unei tranzacții în respectivul segment de piață.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.
Identificarea internă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru fiecare tranzacție. Identificarea internă a tranzacției este unică pentru fiecare tranzacție raportată la nivel de segment de piață monetară și agent de raportare.	
Identificarea internă conexă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru tranzacția inițială care a fost ulterior novată.	Raportarea acestui câmp este obligatorie, atunci când este aplicabil.
Identificarea internă a tranzacției atribuită de contraparte	Identificarea internă a tranzacției atribuită de contrapartea agentului raportor aceleiași tranzacții.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Identificarea contrapărții	Un cod de identificare utilizat pentru a recunoaște contrapartea agentului raportor pentru tranzacția raportată.	Codul LEI (identificatorul persoanei juridice) trebuie utilizat în toate împrejurările în care contrapărții i-a fost atribuit un asemenea identificator. Sectorul contrapărții și localizarea contrapărții trebuie raportate dacă nu este atribuit un cod LEI.
Sectorul contrapărții	Sectorul instituțional al contrapărții.	Obligativ în cazul în care nu este furnizat codul contrapărții.
Localizarea contrapărții	Codul de țară al Organizației Internaționale de Standardizare (ISO) pentru țara în care este înregistrată contrapartea.	Obligativ în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Data raportării	Data și ora de început și de sfârșit ale perioadei la care se referă datele privind tranzacțiile din fișier.	
Marca temporală electronică	Momentul în care o tranzacție este încheiată sau înregistrată.	
Data tranzacției	Data la care părțile încheie tranzacția financiară raportată.	
Data valorii la vedere	Data la care o parte vinde celeilalte părți o cantitate specificată dintr-o monedă specificată în schimbul plății unei sume convenite dintr-o monedă specificată diferită, pe baza unui curs de schimb valutar cunoscut drept cursul de schimb valutar la vedere.	
Data scadenței	Data la care tranzacția de swap pe cursul de schimb expiră, iar moneda vândută la data valorii la vedere este răscumpărată.	
Tipul de tranzacție valutară	Acest atribut precizează dacă suma în euro raportată la valoarea nominală a tranzacției este cumpărată sau vândută la data valorii la vedere. Acesta ar trebui să se refere la operațiunea cu euro la vedere, respectiv dacă euro este vândut sau cumpărat la data valorii la vedere.	
Valoarea nominală a tranzacției	Valoarea nominală în euro a tranzacției de swap pe cursul de schimb.	
Codul monedei străine	Codul internațional ISO de trei cifre al monedei cumpărate/vândute în schimbul euro.	
Cursul de schimb valutar la vedere	Cursul de schimb valutar între euro și moneda străină aplicabil primei componente a tranzacției de swap pe cursul de schimb.	

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Puncte forward valutare	Diferența dintre cursul de schimb valutar forward și cursul de schimb valutar la vedere exprimată în puncte de bază, cotate în conformitate cu convențiile predominante ale pieței pentru perechea valutară respectivă.	

2. Tipul de date bazate pe tranzacții pentru tranzacțiile OIS care trebuie raportate pentru fiecare tranzacție:

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Statutul tranzacției raportate	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o tranzacție nouă, o modificare a unei tranzacții raportate anterior, o anulare sau o corectare a unei tranzacții raportate anterior.	
Statutul privind novația	Acest atribut precizează dacă tranzacția este o novație.	
Identificatorul unic al tranzacției	Codul unic care permite identificarea unei tranzacții în respectivul segment de piață.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.
Identificarea internă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru fiecare tranzacție. Identificarea internă a tranzacției este unică pentru fiecare tranzacție raportată la nivel de segment de piață monetară și agent de raportare.	
Identificarea internă conexă a tranzacției	Identificatorul intern unic al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru tranzacția inițială care a fost ulterior novată.	Raportarea acestui câmp este obligatorie, atunci când este aplicabil.
Identificarea internă a tranzacției atribuită de contraparte	Identificarea internă a tranzacției atribuită de contrapartea agentului raportor aceleiași tranzacții.	Raportarea acestui câmp este necesară, dacă este disponibil.
Identificarea contrapărții	Un cod de identificare utilizat pentru a recunoaște contrapartea agentului raportor pentru tranzacția raportată.	Codul LEI trebuie utilizat în toate împrejurările în care contrapărții i-a fost atribuit un asemenea identificator. Sectorul contrapărții și localizarea contrapărții trebuie raportate dacă nu este atribuit un cod LEI.
Sectorul contrapărții	Sectorul instituțional al contrapărții.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Localizarea contrapărții	Codul ISO de țară pentru țara în care este înregistrată contrapartea.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizată identificarea contrapărții.
Data raportării	Data și ora de început și de sfârșit ale perioadei la care se referă datele privind tranzacțiile din fișier.	

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Marca temporală electronică	Momentul în care o tranzacție este încheiată sau înregistrată.	Opțional.
Data tranzacției	Data la care părțile încheie tranzacția financiară.	
Data inițială	Data la care se calculează rata overnight a componentei variabile.	
Data scadenței	Ultima dată a intervalului în care se calculează rata overnight compusă.	
Rată fixă a dobânzii	Rată fixă utilizată în calcularea profitului OIS.	
Tipul tranzacției	Acest atribut precizează dacă rata fixă a dobânzii este plătită sau primită de agentul raportor.	
Valoarea nominală a tranzacției	Valoarea nominală a OIS.	

3. Prag de semnificație:

Tranzacțiile încheiate cu societățile nefinanciare ar trebui raportate numai atunci când sunt încheiate cu societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» pe baza cadrului Basel III LCR.

(*) Standardele de raportare electronică și specificațiile tehnice ale datelor sunt stabilite separat. Acestea sunt disponibile pe website-ul BCE, la adresa www.ecb.europa.eu”

ANEXA IV

„ANEXA IV

Standarde minime ce trebuie aplicate de către unitățile de observare statistică efective cu obligații de raportare

Agenții raportori trebuie să îndeplinească următoarele standarde minime pentru a respecta cerințele de raportare statistică ale Băncii Centrale Europene (BCE).

1. Standarde minime de transmitere:

- (i) raportarea trebuie să se efectueze la timp și în termenele stabilite de BCE și banca centrală națională (BCN) relevantă;
- (ii) forma și modul de prezentare a rapoartelor statistice trebuie să respecte cerințele tehnice de raportare stabilite de BCE și BCN relevantă;
- (iii) agentul raportor trebuie să furnizeze BCE și BCN relevante detaliile uneia sau mai multor persoane de contact;
- (iv) trebuie respectate specificațiile tehnice pentru transmiterea datelor către BCE și BCN relevantă.

2. Standarde minime de acuratețe:

- (i) informațiile statistice trebuie să fie corecte;
- (ii) agenții raportori trebuie să fie în măsură să furnizeze informații privind evoluțiile reflectate de datele transmise;
- (iii) informațiile statistice trebuie să fie complete și să nu conțină lacune continue și structurale; lacunele existente trebuie să fie semnalate, explicate BCE și BCN relevante și, acolo unde este cazul, completate cât mai curând posibil;
- (iv) agenții raportori trebuie să respecte dimensiunile, politica de rotunjire și zecimalele stabilite de BCE și BCN relevantă pentru transmiterea tehnică a datelor.

3. Standarde minime de conformitate cu conceptele:

- (i) informațiile statistice trebuie să fie conforme cu definițiile și clasificările din prezentul regulament;
- (ii) în cazul unor abateri de la aceste definiții și clasificări, agenții raportori trebuie să monitorizeze și să cuantifice periodic diferența dintre măsura utilizată și măsura prevăzută în prezentul regulament;
- (iii) agenții raportori trebuie să fie în măsură să explice diferențele dintre datele transmise și cifrele pentru perioadele anterioare.

4. Standarde minime de revizuire:

Trebuie respectate politica și procedurile de revizuire stabilite de BCE și de BCN relevantă. Revizuirile care se abat de la revizuirile obișnuite trebuie să fie însoțite de note explicative.

5. Standarde minime pentru integritatea datelor:

- (i) informațiile statistice trebuie compilate și transmise de agenții raportori în mod imparțial și obiectiv;
 - (ii) erorile în datele transmise trebuie corectate și comunicate de agenții raportori BCE și BCN relevante cât mai repede posibil.”
-