

RICHTSNOEREN

EUROPESE CENTRALE BANK

RICHTSNOER VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK

van 7 mei 2009

tot wijziging van Richtsnoer ECB/2007/2 betreffende een geautomatiseerd trans-Europees realtimebruto-vereveningssysteem (TARGET2)

(ECB/2009/9)

(2009/390/EG)

DE RAAD VAN BESTUUR VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK,

Gelet op het Verdrag tot oprichting van de Europese Gemeenschap, inzonderheid op het eerste streepje en het vierde streepje van artikel 105, lid 2,

Gelet op de statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank, inzonderheid op artikel 3.1 en de artikelen 17, 18 en 22,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) De Raad van bestuur van de Europese Centrale Bank (ECB) heeft Richtsnoer ECB/2007/2 van 26 april 2007 betreffende een geautomatiseerd trans-Europees realtimebruto-vereveningssysteem (TARGET2) ⁽¹⁾, aangaande TARGET2, gekenmerkt door één technisch platform, het Single Shared Platform (SSP) genaamd, aangenomen.
- (2) Richtsnoer ECB/2007/2 dient te worden gewijzigd: a) gezien de invoering van de nieuwe versie van het SSP en gezien de noodzaak de nieuw ingevoerde systeemoverschrijdende afwikkeling te definiëren, en b) om toegang tot TARGET2 te geven aan kredietinstellingen die in handen zijn van de overheid en die gezien hun specifiek institutionele aard krachtens Gemeenschapsrecht onderworpen zijn aan toezicht dat vergelijkbaar is met de standaarden voor toezicht door bevoegde nationale autoriteiten,

HEEFT HET VOLGENDE RICHTSNOER VASTGESTELD:

Artikel 1

Bijlagen II, III en IV, bij Richtsnoer ECB/2007/2 worden overgenomen met de bijlage bij dit richtsnoer gewijzigd.

*Artikel 2***Inwerkingtreding**

1. Dit richtsnoer treedt in werking op 8 mei 2009.
2. Artikel 1 is met ingang van 11 mei 2009 van toepassing.

*Artikel 3***Geadresseerden en uitvoeringsmaatregelen**

1. Dit richtsnoer geldt voor alle centrale banken van het Eurosysteem.
2. De nationale centrale banken van de lidstaten die de euro aangenomen hebben stellen de ECB tegen 11 mei 2009 in kennis van de maatregelen waarmee zij voornemens zijn te voldoen aan dit richtsnoer.

Gedaan te Frankfurt am Main, 7 mei 2009.

Namens de Raad van bestuur van de ECB

De president van de ECB

Jean-Claude TRICHET

⁽¹⁾ PB L 237 van 8.9.2007, blz. 1.

BIJLAGE

1. Bijlage II bij Richtsnoer ECB/2007/2 wordt als volgt gewijzigd:

De definitie van „kredietinstelling” in artikel 1 wordt als volgt vervangen:

„— „kredietinstelling” betekent ofwel: a) een kredietinstelling in de zin van [voeg nationale nationale wetgeving in ter uitvoering van artikel 4, lid 1, onder a), en, indien van toepassing, artikel 2 van de Bankenrichtlijn] die onderworpen is aan toezicht door een bevoegde autoriteit, of b) een andere kredietinstelling in de zin van artikel 101, lid 2, van het Verdrag die onderworpen is aan toezicht dat vergelijkbaar is met de standaarden voor toezicht door een bevoegde autoriteit.”.

2. Bijlage III bij Richtsnoer ECB/2007/2 wordt als volgt gewijzigd:

De definitie van „kredietinstelling” in de lijst van definities van deze bijlage wordt als volgt vervangen:

„— „kredietinstelling” betekent ofwel: a) een kredietinstelling in de zin van artikel 2 en artikel 4, lid 1, onder a) van de Bankenrichtlijn, zoals uitgevoerd in nationale wetgeving die onderworpen is aan toezicht door een bevoegde autoriteit; of b) een andere kredietinstelling in de zin van artikel 101, lid 2, van het Verdrag die onderworpen is aan toezicht dat vergelijkbaar is met de standaarden voor toezicht door een bevoegde autoriteit.”.

3. Bijlage IV bij Richtsnoer ECB/2007/2 wordt als volgt gewijzigd:

1) In paragraaf 1 worden de volgende definities toegevoegd:

„— „systeemoverschrijdende afwikkeling”: de realtimeafwikkeling van debiteringsopdrachten onder welke betalingen uitgevoerd worden van een afwikkelingsbank van een AS die afwikkelingsprocedure 6 toepast naar een afwikkelingsbank van een ander AS die afwikkelingsprocedure 6 toepast;

— „Static Data (Management) Module”: de SSP-module waarin statische gegevens verzameld en opgeslagen worden.”.

2) In paragraaf 3 wordt punt 7 toegevoegd:

„(7) De ASCB waarborgt dat een AS waarmee zij een bilaterale regeling heeft afgesloten, de naam en de BIC van het AS levert waarmee zij voornemens is de systeemoverschrijdende afwikkeling uit te voeren en de datum vanaf welke een systeemoverschrijdende afwikkeling met een bepaalde AS dient te beginnen of op te houden. Deze informatie wordt opgeslagen in de Static Data (Management) Module.”.

3) Paragraaf 4, punt 3, wordt als volgt vervangen:

„(3) Een betalingsinstructie wordt als aanvaard beschouwd, indien:

- a) de betalingsinstructie voldoet aan de door de netwerkdienstverlener vastgestelde regels;
- b) de betalingsinstructie voldoet aan de formateringsregels en -voorwaarden van het ASCB TARGET2-deelsysteem;
- c) de afwikkelingsbank is opgenomen in de lijst van de in paragraaf 3, punt 1, opgenomen afwikkelingsbanken;
- d) het desbetreffende AS bij een systeemoverschrijdende verevening op de lijst staat van AS's waarmee een systeemoverschrijdende afwikkeling mag worden uitgevoerd;
- e) indien de deelneming van een afwikkelingsbank aan TARGET2 is opgeschort, de expliciete instemming van de SCB van de geschorste afwikkelingsbank werd verkregen.”.

4) Paragraaf 6, punt 1 onder f), wordt als volgt vervangen:

„f) afwikkelingsprocedure 6 (geormerkte liquiditeiten en systeemoverschrijdende afwikkeling).”.

5) Paragraaf 8, punt 5, wordt als volgt vervangen:

„(5) Wanneer een ASCB de afwikkelingsprocedure 6 aanbiedt voor gekoppelde modellen, openen de SCB's in hun TARGET2-deelsystemen voor afwikkelingsbanken één of meerdere subrekeningen voor de oormerking van liquiditeiten en, indien relevant, systeemoverschrijdende afwikkeling. Subrekeningen worden geïdentificeerd met de BIC van de ermee verbonden PM-rekening in combinatie met een voor de betrokken subrekening specifiek rekeningnummer. Het rekeningnummer bestaat uit de landcode plus maximaal 32 karakters (volgens de desbetreffende nationale bankrekeningstructuur).”.

6) Paragraaf 14 wordt als volgt vervangen:

„14. Afwikkelingsprocedure 6 — Geoomerkte liquiditeiten en systeemoverschrijdende afwikkeling

- (1) Afwikkelingsprocedure 6 kan zowel voor het gekoppelde als het geïntegreerde model worden toegepast, zoals hierna bepaald onder de subparagrafen 4 tot en met 13 en 14 tot en met 18 respectievelijk. Bij het geïntegreerde model gebruikt het desbetreffende AS een kopierekening om de nodige door haar afwikkelingsbank gereserveerde liquiditeit te innen. Bij het gekoppelde model opent de afwikkelingsbank minstens één subrekening die verband houdt met een specifiek AS.
- (2) Op hun verzoek worden de afwikkelingsbanken middels een SWIFT MT 900 of een MT-910 bericht op de hoogte gebracht van de creditering en de debitering van hun PM-rekeningen en, indien toepasselijk, hun subrekeningen.
- (3) Wanneer zij systeemoverschrijdende afwikkeling krachtens afwikkelingsprocedure 6 aanbieden, ondersteunen de ASCB's en SCB's de systeemoverschrijdende afwikkelingsbetalingen, indien zij door de desbetreffende AS's geïnitieerd werden. Een AS kan uitsluitend tot een systeemoverschrijdende afwikkeling overgaan gedurende haar verwerkingscyclus, en afwikkelingsprocedure 6 dient te lopen in het AS dat de betalingsopdracht ontvangt. Systeemoverschrijdende afwikkeling staat open voor verwerking overdag en nachtelijke verwerking krachtens afwikkelingsprocedure 6. De mogelijkheid systeemoverschrijdende afwikkeling uit te voeren tussen twee individuele AS's wordt opgeslagen in de Static Data (Management) Module.

A) *Gekoppeld model*

- (4) Wanneer zij afwikkelingsprocedure 6 aanbieden, ondersteunen de ASCB's en SCB's de afwikkeling van bilaterale en/of multilaterale cashsaldi van AS-transacties door:
 - a) een afwikkelingsbank de mogelijkheid te geven haar toekomstige afwikkelingsverplichtingen te prefinancieren middels aan de AS-verwerking voorafgaande liquiditeitsovermakingen van haar PM-rekening naar haar subrekening (verder „geoomerkte liquiditeit”), en
 - b) de AS-betalingsinstructies af te wikkelen na de voltooiing van de AS-verwerking: met betrekking tot afwikkelingsbanken die geld verschuldigd zijn (short) door de debitering van hun subrekeningen (ten belope van de gelden op deze rekening) en de AS-technische rekening te crediteren en met betrekking tot afwikkelingsbanken met een vordering (long) door de creditering van hun subrekeningen en de debitering van de AS's technische rekening.
- (5) Wanneer zij afwikkelingsprocedure 6 aanbieden:
 - a) openen de SCB's ten minste één subrekening met betrekking tot één AS voor elke afwikkelingsbank, en
 - b) opent de ASCB een technische rekening voor het AS voor: i) de creditering van gelden die vanaf de specifieke subrekeningen van de afwikkelingsbanken die geld verschuldigd zijn (short) geïnd werden, en ii) de debitering van gelden bij creditering van de specifieke subrekeningen van de afwikkelingsbanken met een vordering (long).
- (6) Afwikkelingsprocedure 6 staat open voor verwerking overdag en nachtelijke transacties van AS's. In dat laatste geval start de nieuwe werkdag onmiddellijk nadat aan vereisten inzake minimumreserves is voldaan; een daarop volgende creditering of een debitering op de betrokken rekeningen wordt gevaluteerd op de nieuwe werkdag.
- (7) Onder afwikkelingsprocedure 6 en betreffende de oormerking van liquiditeiten, bieden ASCB's en SCB's de volgende types liquiditeitsovermakingsdiensten naar en van een subrekening aan:
 - a) permanente opdrachten die de afwikkelingsbanken gedurende een werkdag op elk ogenblik middels de ICM (indien beschikbaar) kunnen aanleveren of wijzigen. Permanente opdrachten die na het versturen van het „start-procedure-bericht” op een bepaalde werkdag zijn aangeleverd, gelden pas voor de volgende werkdag. Indien er meerdere permanente opdrachten zijn voor het crediteren van meerdere subrekeningen, worden zij afgewikkeld in de bedragenvolgorde, te beginnen met het hoogste bedrag. Bij nachtelijke AS-operaties, indien voor meerdere permanente opdrachten op de PM-rekening onvoldoende gelden staan, worden deze opdrachten volgens een pro-rata reductie van alle opdrachten afgewikkeld;

- b) Lopende opdrachten die alleen tijdens de afwikkelingsprocedure 6 (dat wil zeggen, de tijdspanne vanaf het „start-procedure-bericht” tot het „einde-procedure-bericht”) ofwel door een afwikkelingsbank (via de ICM), ofwel door het desbetreffende AS middels een XML-bericht mogen worden aangeleverd en die alleen afgewikkeld worden zolang de AS-verwerkingscyclus nog niet is gestart. Indien voor een door het AS aangeleverde lopende opdracht op de PM-rekening onvoldoende gelden staan, wordt die opdracht gedeeltelijk afgewikkeld;
- c) SWIFT-opdrachten die via een MT-202-bericht verlopen, mogen alleen worden aangeleverd terwijl procedure 6 loopt en alleen gedurende verwerking overdag. Dergelijke opdrachten worden onmiddellijk afgewikkeld. Als een cyclus gestart is, gebeurt dit zonder kennisgeving aan het AS.
- (8) Afwikkelingsprocedure 6 start met een „start-procedure-bericht” en eindigt met een „einde-procedure-bericht”, beide door het AS te versturen. Bij nachtelijke AS-operaties verstuurt evenwel de ASCB het „start-procedure-bericht”. „Start-procedure-berichten” doen de afwikkeling van permanente opdrachten voor de liquiditeitovermaking naar de subrekeningen van start gaan. Het „einde-procedure-bericht” zorgt voor een automatische terugboeking van liquiditeiten van de subrekening naar de PM-rekening.
- (9) Binnen afwikkelingsprocedure 6 worden geormerkte liquiditeiten op de subrekeningen bevroren zolang de AS-verwerkingscyclus loopt (beginnend met een „start-cyclus-bericht” en eindigend met een „einde-cyclus-bericht”, beide door het AS te versturen) en daarna vrijgegeven. Het geblokkeerde saldo kan gedurende de verwerkingscyclus gewijzigd worden ten gevolge van systeemoverschrijdende afwikkelingsbetalingen.
- (10) Binnen alle AS-procescycli worden de betalingsinstructies met geormerkte liquiditeiten afgewikkeld, in de regel door toepassing van algoritme 5 (zoals bedoeld in appendix 1 van bijlage II).
- (11) Binnen elke AS-verwerkingscyclus kan de geormerkte liquiditeit van een afwikkelingsbank verhoogd worden door haar subrekeningen direct te crediteren met binnenkomende betalingen, bijvoorbeeld coupons en aflossingsbetalingen). In dat geval moet de technische rekening eerst met de liquiditeiten gecrediteerd worden en daarna moet een dergelijke rekening gedebiteerd worden vooraleer de subrekening (of de PM-rekening) met die liquiditeiten gecrediteerd wordt.
- (12) Systeemoverschrijdende afwikkeling tussen twee gekoppelde AS's kan alleen geïnitieerd worden door een AS (of zijn ASCB in zijn naam) waarvan de subrekening van de deelnemer gedebiteerd werd. De betalingsinstructie wordt afgewikkeld door de debitering van het in de betalingsinstructie vermelde bedrag van de subrekening van een deelnemer van een de betalingsinstructie initiërend AS en door de creditering van de subrekening van een deelnemer van een ander AS.

Het AS dat de betalingsinstructie initieert en het andere AS worden op de hoogte gebracht van de voltooide afwikkeling.

- (13) De systeemoverschrijdende afwikkeling van een AS die het gekoppelde model gebruikt kan geïnitieerd worden door het AS (of zijn ASCB in zijn naam) dat van het gekoppelde model gebruikmaakt. De betalingsinstructie wordt afgewikkeld door de debitering van het in de betalingsinstructie vermelde bedrag van de subrekening van een deelnemer van een AS die van het gekoppelde model gebruikmaakt en de creditering van de kopierekening van het AS dat van het geïntegreerde model gebruikmaakt. De betaling kan niet worden geïnitieerd door het AS dat van het geïntegreerde model gebruik maakt en wiens kopierekening zal worden gecrediteerd.

Het AS dat de betalingsinstructie initieert en het andere AS worden op de hoogte gebracht van de voltooide afwikkeling.

B) Geïntegreerde model

- (14) Wanneer zij afwikkelingsprocedure 6 voor geïntegreerde modellen aanbieden, ondersteunen de ASCB's en de SCB's die afwikkeling. Als de afwikkelingsprocedure 6 wordt gebruikt voor het geïntegreerde model gedurende de verwerking overdag, wordt slechts een beperkte functionaliteit aangeboden.
- (15) Onder afwikkelingsprocedure 6 en betreffende het geïntegreerde model, bieden de ASCB's en de SCB's de volgende types liquiditeitsovermakingsdiensten naar een kopierekening aan:
- a) permanente opdrachten (voor verwerking overdag en nachtelijke AS-operaties) die de afwikkelingsbanken gedurende een werkdag op elk ogenblik middels de ICM (indien beschikbaar) kunnen aanleveren of wijzigen. Permanente opdrachten die na het versturen van het „start-procedure-bericht” op een bepaalde werkdag zijn aangeleverd, zijn pas geldig voor de volgende werkdag. Indien er meerdere permanente opdrachten zijn, worden zij afgewikkeld in de bedragenvolgorde, te beginnen met het hoogste bedrag. Een niet-gedekte permanente opdracht voor verwerking overdag wordt geweigerd. Bij nachtelijke AS-operaties, indien voor meerdere permanente opdrachten op de PM-rekening onvoldoende gelden staan, worden deze opdrachten volgens een pro-ratareductie van alle opdrachten afgewikkeld;

- b) lopende opdrachten die alleen tijdens de afwikkelingsprocedure 6 (dat wil zeggen, de tijdsperiode vanaf het „start-procedure-bericht” tot het „einde-procedure-bericht”) ofwel door een afwikkelingsbank (via de ICM), ofwel door het desbetreffende AS middels een XML-bericht mogen worden aangeleverd en die alleen afgewikkeld worden zolang de AS-verwerkingscyclus nog niet is gestart. Indien voor een lopende opdracht op de PM-rekening onvoldoende gelden staan, wordt die opdracht gedeeltelijk afgewikkeld;
- c) SWIFT-opdrachten die via een MT 202 lopen, mogen alleen aangeleverd worden gedurende de verwerking overdag. Dergelijke opdrachten worden onmiddellijk afgewikkeld.
- (16) De regels betreffende de „start-procedure-” en „einde-procedure-berichten”, en betreffende het begin en het einde van een cyclus voor het gekoppelde model gelden dienovereenkomstig.
- (17) Systeemoverschrijdende afwikkeling tussen twee AS's die van het geïntegreerde model gebruikmaken kan alleen geïnitieerd worden door een AS (of zijn ASCB in zijn naam) waarvan de kopierekening gedebiteerd werd. De betalingsinstructie wordt afgewikkeld door de debitering van het in de betalingsinstructie vermelde bedrag van de kopierekening die wordt gebruikt door het de betalingsinstructie initiërende AS en creditering van de kopierekening die een ander AS gebruikt. De betalingsinstructie kan niet worden geïnitieerd door het AS wiens kopierekening zal worden gecrediteerd.

Het AS dat de betalingsinstructie initieert en het andere AS worden op de hoogte gebracht van de voltooide afwikkeling.

- (18) De systeemoverschrijdende afwikkeling van een AS die het geïntegreerde model gebruikt naar een AS die het gekoppelde model gebruikt kan worden geïnitieerd door het AS (of zijn ASCB in zijn naam) dat van het geïntegreerde model gebruikmaakt. De betalingsinstructie wordt afgewikkeld door de debitering van het in de betalingsinstructie vermelde bedrag van de kopierekening van een AS die van het geïntegreerde model gebruikmaakt en door de creditering van de subrekening van een deelnemer van een ander AS. De betalingsinstructie kan niet worden geïnitieerd door het AS dat van het gekoppelde model gebruikmaakt, en waarvan de subrekening van de AS-deelnemer zal worden gecrediteerd.

Het AS dat de betalingsinstructie initieert en het andere AS worden op de hoogte gebracht van de voltooide afwikkeling.”.
