

VERORDNUNG (EU) 2015/1599 DER EUROPÄISCHEN ZENTRALBANK
vom 10. September 2015
zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 über Geldmarktstatistiken (EZB/2015/30)

DER EZB-RAT —

gestützt auf die Satzung des Europäischen Systems der Zentralbanken und der Europäischen Zentralbank, insbesondere auf Artikel 5,

gestützt auf die Verordnung (EG) Nr. 2533/98 des Rates vom 23. November 1998 über die Erfassung statistischer Daten durch die Europäische Zentralbank ⁽¹⁾, insbesondere auf Artikel 5 Absatz 1 und Artikel 6 Absatz 4,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Die Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 der Europäischen Zentralbank (EZB/2014/48) ⁽²⁾ verpflichtet die Berichtspflichtigen zur Meldung statistischer Daten, damit das Europäische System der Zentralbanken in Erfüllung seiner Aufgaben Statistiken über Geldmarktgeschäfte erstellen kann.
- (2) An die nationalen Zentralbanken wird ein Satz von Meldeanweisungen ausgegeben, in denen die Parameter für die Meldung statistischer Daten nach Maßgabe der Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 (EZB/2014/48) im Einzelnen aufgeführt sind. Da in den Meldeanweisungen eine Reihe wichtiger in der genannten Verordnung verwendeter Begriffe näher bestimmt werden, sollte die Verordnung aus Gründen der Einheitlichkeit diesen Änderungen ebenfalls Rechnung tragen.
- (3) Die Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 (EZB/2014/48) sollte daher entsprechend geändert werden —

HAT FOLGENDE VERORDNUNG ERLASSEN:

Artikel 1

Änderungen

- (1) Anhang I der Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 (EZB/2014/48) erhält die Fassung des Anhangs I der vorliegenden Verordnung.
- (2) Die Anhänge II und III der Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 (EZB/2014/48) werden entsprechend Anhang II der vorliegenden Verordnung geändert.

Artikel 2

Schlussbestimmungen

Diese Verordnung tritt am zwanzigsten Tag nach ihrer Veröffentlichung im *Amtsblatt der Europäischen Union* in Kraft.

Diese Verordnung ist in allen ihren Teilen verbindlich und gilt gemäß den Verträgen unmittelbar in den Mitgliedstaaten.

Geschehen zu Frankfurt am Main am 10. September 2015.

Für den EZB-Rat
Der Präsident der EZB
Mario DRAGHI

⁽¹⁾ ABl. L 318 vom 27.11.1998, S. 8.

⁽²⁾ Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 der Europäischen Zentralbank vom 26. November 2014 über Geldmarktstatistiken (EZB/2014/48) (ABl. L 359 vom 16.12.2014, S. 97).

ANHANG I

„ANHANG I

Berichtsschema für Geldmarktstatistiken in Bezug auf besicherte Transaktionen

TEIL 1

ART DER INSTRUMENTE

Die Berichtspflichtigen melden der Europäischen Zentralbank (EZB) oder der jeweiligen nationalen Zentralbank (NZB) sämtliche auf Euro lautende Rückkaufsvereinbarungen und sämtliche der im Rahmen dieser Rückkaufsvereinbarungen abgeschlossenen Geschäfte, einschließlich Tri-Party Repogeschäfte, mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) zwischen dem Berichtspflichtigen und anderen monetären Finanzinstituten (MFIs), sonstigen Finanzinstituten (SFIs), Versicherungsgesellschaften, Altersvorsorgeeinrichtungen, dem Staat oder mit Zentralbanken zu Investmentzwecken sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als ‚Großkunden‘ gelten.

TEIL 2

ART DER DATEN**1. Art der für jede Transaktion zu meldenden transaktionsbasierten Daten ⁽¹⁾:**

Feld	Beschreibung der Daten	Alternative Berichtsmöglichkeiten (sofern vorhanden) und weitere Vorgaben
Transaktionskennung	Die interne eindeutige Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für jede Transaktion verwendet.	Die Transaktionskennung bezieht sich eindeutig auf eine an einem bestimmten Berichtstag gemeldete Transaktion eines Geldmarktsegments.
Berichtstag	Der Tag, an dem die Daten der EZB oder der NZB gemeldet werden.	
Elektronischer Zeitstempel	Der Zeitpunkt, an dem eine Transaktion abgeschlossen oder gebucht wird.	
Geschäftspartnerkennziffer	Eine Kennziffer, die verwendet wird, um den Geschäftspartner des Berichtspflichtigen bei der gemeldeten Transaktion zu identifizieren.	Wenn Transaktionen über eine zentrale Clearing-Gegenpartei (Central Clearing Counterparty — CCP) durchgeführt werden, muss für die CCP die Kennung der juristischen Person (legal entity identifier — LEI) angegeben werden. Wenn Transaktionen mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, SFIs, Versicherungsgesellschaften, Altersvorsorgeeinrichtungen, dem Staat und Zentralbanken getätigt werden sowie bei jeder sonstigen gemeldeten Transaktion, bei der die LEI des Geschäftspartners nicht angegeben ist, ist die Klasse des Geschäftspartners anzugeben.
Identifikationskürzel des Geschäftspartners	Eine Kennzeichnung, die die Art der gemeldeten individuellen Geschäftspartnerkennziffer näher bestimmt.	Unter allen Umständen zu verwenden. Eine individuelle Geschäftspartnerkennziffer wird angegeben.

⁽¹⁾ Die elektronischen Berichtsstandards sowie die technischen Spezifikationen der Daten sind gesondert festgelegt. Sie sind auf der Website der EZB unter www.ecb.europa.eu abrufbar.

Feld	Beschreibung der Daten	Alternative Berichtsmöglichkeiten (sofern vorhanden) und weitere Vorgaben
Standort des Geschäftspartners	ISO-Ländercode des Landes, in dem der Geschäftspartner seinen Sitz hat.	Obligatorisch, falls die individuelle Geschäftspartnerkennziffer nicht angegeben ist. Andernfalls optional.
Transaktionsnennwert	Der ursprünglich aufgenommene oder bereitgestellte Betrag.	
Nennwert der Sicherheiten	Der Nennwert der als Sicherheit hinterlegten Wertpapiere.	Mit Ausnahme von Tri-Party-Repogeschäften sowie sonstigen Transaktionen, bei denen die hinterlegten Sicherheiten nicht durch eine einzelne Internationale Wertpapier-Identifikationsnummer (ISIN) gekennzeichnet sind.
Handelstag	Der Tag, an dem die Parteien die Finanztransaktion tätigen.	
Abwicklungstag	Der Kauftag, d. h. der Tag, an dem der Kreditgeber den Betrag an den Kreditnehmer zu zahlen und der Kreditnehmer die Sicherheit an den Kreditgeber zu übertragen hat.	Bei Bis-auf-Weiteres-Repogeschäften ist dies der Tag, an dem die Verlängerung abgewickelt wird (auch wenn keine Barzahlung stattfindet).
Fälligkeitsdatum	Der Rückkaufstag, d. h. der Tag, an dem der Geldbetrag fällig und vom Kreditnehmer an den Kreditgeber zurückzuzahlen ist.	Bei Bis-auf-Weiteres-Repogeschäften ist dies der Tag, an dem Tilgungs- und Zinszahlungen fällig sind, falls die Transaktion nicht verlängert wird.
Transaktionsvorzeichen	Geldaufnahme von Geldbeträgen bei Repogeschäften oder Geldvergabe von Geldbeträgen bei Reverse-Repogeschäften.	
ISIN der Sicherheiten	Die ISIN, die den an den Finanzmärkten begebenen Wertpapieren zugewiesen wird, aus zwölf alphanumerischen Zeichen besteht und eine Sicherheit eindeutig kennzeichnet (wie in ISO 6166 definiert).	Zu melden mit Ausnahmen bei bestimmten Arten der Sicherheit.
Art der Sicherheit	Dient dazu, die Kategorie des als Sicherheit hinterlegten Vermögenswertes zu bestimmen, wenn keine individuelle ISIN angegeben wird.	In allen Fällen anzugeben, in denen keine ISIN angegeben wird.
Sektor des Emittenten der Sicherheit	Dient dazu, den Sektor des Emittenten der Sicherheit zu bestimmen, wenn keine individuelle ISIN angegeben wird.	Anzugeben, wenn keine ISIN angegeben wird.
Kennzeichen für besondere Sicherheiten	Dient dazu, sämtliche Repogeschäfte zu identifizieren, die gegen allgemeine oder spezielle Sicherheiten abgeschlossen wurden. Optionales Feld; nur anzugeben, wenn es dem Berichtspflichtigen möglich ist.	Meldung dieses Feldes ist optional.

Feld	Beschreibung der Daten	Alternative Berichtsmöglichkeiten (sofern vorhanden) und weitere Vorgaben
Transaktionszinssatz	Der Zinssatz gemäß der ACT/360-Geldmarktkonvention, zu dem das Repogeschäft abgeschlossen wurde und der aufgenommene Geldbetrag vergütet wird.	
Sicherheitsabschlag	Eine auf die gestellte Sicherheit angewandte Risikokontrollmaßnahme, wobei der Wert einer Sicherheit als deren Marktwert abzüglich eines bestimmten Prozentsatzes (Sicherheitsabschlag) berechnet wird. Zu Meldezwecken wird der Sicherheitsabschlag berechnet als 100 abzüglich der Quote zwischen dem aufgenommenen/bereitgestellten Geldbetrag und dem Marktwert einschließlich der aufgelaufenen Zinsen der verpfändeten Sicherheit.	Die Meldung dieses Feldes ist nur bei Transaktionen erforderlich, die mit einer einzigen Sicherheit besichert sind.
Geschäftspartnerkennziffer des Tri-Party-Agenten	Geschäftspartnerkennziffer des Tri-Party-Agenten.	Zu melden bei Tri-Party-Repogeschäften.
Identifikationskürzel des Tri-Party-Agenten	Eine Kennzeichnung, die die Art des gemeldeten individuellen Identifikationskürzels des Tri-Party-Agenten näher bestimmt.	In allen Fällen zu verwenden, in denen ein individuelles Kürzel des Tri-Party-Agenten angegeben wird.

2. Wesentlichkeitsschwellenwert

Transaktionen mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften sollten nur gemeldet werden, wenn diese mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften getätigt werden, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als ‚Großkunden‘ gelten ⁽¹⁾.

3. Ausnahmeregelung

Gruppeninterne Transaktionen sollen nicht gemeldet werden.“

⁽¹⁾ Siehe ‚Basel III: Mindestliquiditätsquote und Instrumente zur Überwachung des Liquiditätsrisikos‘, Basler Ausschuss für Bankenaufsicht, Januar 2013, S. 23 bis 27, abrufbar auf der Website der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich unter www.bis.org.

ANHANG II

Die Anhänge II und III der Verordnung (EU) Nr. 1333/2014 (EZB/2014/48) werden wie folgt geändert:

1. Anhang II Teil 1 erhält folgende Fassung:

„TEIL 1

ART DER INSTRUMENTE

1. Die Berichtspflichtigen melden der Europäischen Zentralbank (EZB) oder der jeweiligen nationalen Zentralbank (NZB):
 - a) jegliche auf Euro lautende Geldaufnahme des Berichtspflichtigen unter Verwendung der in nachstehender Tabelle bestimmten Instrumente mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) von anderen monetären Finanzinstituten (MFIs), sonstigen Finanzinstituten (SFIs), Versicherungsgesellschaften, Altersvorsorgeeinrichtungen, dem Staat oder von Zentralbanken zu Investitionszwecken sowie von nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als ‚Großkunden‘ gelten;
 - b) jegliche Geldvergabe an andere Kreditinstitute mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag) mittels unbesicherter Einlagen oder Tagesgeldkonten oder mittels des Erwerbs von Commercial Papers, Einlagenzertifikaten, variabel verzinslichen Anleihen und anderen Schuldverschreibungen mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr von emittierenden Kreditinstituten.
2. Die nachstehende Tabelle enthält eine detaillierte und standardisierte Beschreibung der Kategorien von Instrumenten für Transaktionen, die die Berichtspflichtigen an die EZB zu melden haben. Sofern die Berichtspflichtigen verpflichtet sind, die Transaktionen ihrer NZB zu melden, sollte die betreffende NZB die Beschreibungen dieser Kategorien im Einklang mit dieser Verordnung auf nationaler Ebene umsetzen.

Art des Instruments	Beschreibung
Einlagen	Unbesicherte verzinsliche Einlagen (einschließlich Tagesgeldkonten, jedoch ausgenommen Girokonten) mit einer Kündigungsfrist oder einer Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr, die entweder von dem Berichtspflichtigen hereingenommen (aufgenommen) oder platziert werden.
Tagesgeldkonten	Barkonten mit täglich wechselndem Zinssatz, für die in regelmäßigen Zeitabständen Zinsen gezahlt oder berechnet werden und bei denen Geldabhebungen einer Kündigungsfrist unterliegen.
Einlagenzertifikat	Ein von einem MFI ausgegebener Schuldtitel mit fester Laufzeit, der den Inhaber für einen festgelegten Zeitraum von bis zu einem Jahr zu einem bestimmten Festzins berechtigt.
Commercial Paper	Ein Schuldtitel, der entweder unbesichert oder durch vom Emittenten bereitgestellte Sicherheiten gedeckt ist, eine Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr hat und entweder verzinslich oder diskontiert ist.
Variabel verzinsliche Schuldverschreibungen	Ein Schuldtitel, für den die periodischen Zinszahlungen auf Grundlage des Wertes berechnet werden, d. h. durch die Festlegung eines zugrunde liegenden Referenzzinssatzes (wie etwa Euribor), zu im Voraus festgelegten Tagen (sogenannten Fixing-Terminen) und der eine Laufzeit von nicht mehr als einem Jahr aufweist.

Art des Instruments	Beschreibung
Sonstige kurzfristige Schuldverschreibungen	<p>Nichtnachrangige Schuldverschreibungen außer sonstigen Anteilsrechten mit einer Laufzeit von bis zu einem Jahr, die von Berichtspflichtigen ausgegeben werden; dabei handelt es sich um Finanzinstrumente, die in der Regel handelbar sind und an Sekundärmärkten gehandelt werden oder am Markt verrechnet werden können, dem Inhaber aber keine Eigentumsrechte am Emissionsinstitut einräumen. Hierunter fallen:</p> <p>a) Wertpapiere, die dem Inhaber ein uneingeschränktes Recht auf ein festes oder vertraglich vereinbartes Einkommen in Form von Kuponzahlungen und/oder einem angegebenen festen Betrag zu einem bestimmten Tag (oder bestimmten Tagen) oder ab einem zum Zeitpunkt der Emission festgelegten Tag einräumen;</p> <p>b) von Berichtspflichtigen ausgegebene nicht börsenfähige Instrumente, die zu einem späteren Zeitpunkt börsenfähig werden und als ‚Schuldverschreibungen‘ reklassifiziert werden.“</p>

2. Anhang III Teil 1 erhält folgende Fassung:

„TEIL 1

ART DER INSTRUMENTE

Die Berichtspflichtigen melden der Europäischen Zentralbank (EZB) oder der jeweiligen nationalen Zentralbank (NZB):

- a) alle Devisenswapgeschäfte zwischen dem Berichtspflichtigen und anderen monetären Finanzinstituten (MFIs), sonstigen Finanzinstituten (SFIs), Versicherungsgesellschaften, Altersvorsorgeeinrichtungen, dem Staat oder mit Zentralbanken zu Investitionszwecken sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als ‚Großkunden‘ gelten, bei denen Euro gegen Fremdwährung gekauft bzw. verkauft werden und an einem zukünftigen Zeitpunkt zu einem vorher festgelegten Devisenterminkurs wieder verkauft bzw. zurückgekauft werden mit einer Laufzeit von bis zu und einschließlich einem Jahr (definiert als Transaktionen mit einer Laufzeit von nicht mehr als 397 Tagen nach dem Abwicklungstag der Kassaposition des Devisenswapgeschäfts);
- b) auf Euro lautende Tagesgeldsatz-Swapgeschäfte (Overnight Index Swaps — OIS) zwischen dem Berichtspflichtigen und anderen monetären Finanzinstituten (MFIs), sonstigen Finanzinstituten (SFIs), Versicherungsgesellschaften, Altersvorsorgeeinrichtungen, dem Staat oder mit Zentralbanken zu Investitionszwecken sowie mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, die gemäß dem Basel-III-LCR-Rahmenwerk als ‚Großkunden‘ gelten.“

3. Die Tabelle in Anhang III Teil 2 Nummer 1 erhält folgende Fassung:

„Feld	Beschreibung der Daten	Alternative Berichtsmöglichkeiten (sofern vorhanden) und weitere Vorgaben
Transaktionskennung	Die interne eindeutige Transaktionskennung, die der Berichtspflichtige für jede Transaktion verwendet.	Die Transaktionskennung bezieht sich eindeutig auf eine an einem bestimmten Berichtstag gemeldete Transaktion eines Geldmarktsegments.
Berichtstag	Der Tag, an dem die Daten der EZB oder der NZB gemeldet werden.	
Elektronischer Zeitstempel	Der Zeitpunkt, an dem eine Transaktion abgeschlossen oder gebucht wird.	

„Feld	Beschreibung der Daten	Alternative Berichtsmöglichkeiten (sofern vorhanden) und weitere Vorgaben
Geschäftspartnerkennziffer	Eine Kennziffer, die verwendet wird, um den Geschäftspartner des Berichtspflichtigen bei der gemeldeten Transaktion zu identifizieren.	Wenn Transaktionen über eine zentrale Clearing-Gegenpartei (Central Clearing Counterparty — CCP) durchgeführt werden, muss für die CCP die Kennung der juristischen Person (legal entity identifier — LEI) angegeben werden. Wenn Transaktionen mit nichtfinanziellen Kapitalgesellschaften, SFIs, Versicherungsgesellschaften, Altersvorsorgeeinrichtungen, dem Staat und Zentralbanken getätigt werden sowie bei jeder sonstigen gemeldeten Transaktion, bei der die LEI des Geschäftspartners nicht angegeben ist, ist die Klasse des Geschäftspartners anzugeben.
Identifikationskürzel des Geschäftspartners	Eine Kennzeichnung, die die Art der gemeldeten individuellen Geschäftspartnerkennziffer näher bestimmt.	Unter allen Umständen zu verwenden. Eine individuelle Geschäftspartnerkennziffer wird angegeben.
Standort des Geschäftspartners	ISO-Ländercode des Landes, in dem der Geschäftspartner seinen Sitz hat.	Obligatorisch, falls die individuelle Geschäftspartnerkennziffer nicht angegeben ist. Andernfalls optional.
Handelstag	Der Tag, an dem die Parteien die gemeldete Finanztransaktion tätigen.	
Kassa-Abrechnungstag:	Der Tag, an dem eine Partei der anderen Partei einen bestimmten Betrag einer bestimmten Währung gegen Zahlung eines vereinbarten Betrags einer bestimmten anderen Währung auf Grundlage eines vereinbarten Devisenkurses, des sogenannten Devisenkassakurses, veräußert.	
Fälligkeitsdatum	Der Tag, an dem das Devisenswapgeschäft ausläuft und die am Kassa-Abrechnungstag verkaufte Währung zurückgekauft wird.	
Transaktionsvorzeichen	Zu verwenden um zu kennzeichnen, ob der als Transaktionsnennwert ausgewiesene Eurobetrag am Kassa-Abrechnungstag gekauft oder verkauft wird.	Diese Angabe sollte sich auf Euro per Kasse beziehen, d. h., ob am Kassa-Abrechnungstag Euro gekauft oder verkauft werden.
Transaktionsnennwert	Der am Kassa-Abrechnungstag gekaufte oder verkaufte Eurobetrag.	
Devisenbestände	Das internationale dreistellige ISO-Kürzel der im Austausch gegen Euro gekauften/verkauften Währung.	

„Feld	Beschreibung der Daten	Alternative Berichtsmöglichkeiten (sofern vorhanden) und weitere Vorgaben
Devisenkassakurs	Der Devisenkurs zwischen dem Euro und der auf die Kassaposition des Devisen- swapgeschäfts anzuwendenden Devisen.	
Devisentermingeschäfte	Der Unterschied zwischen dem Kassa- und dem Terminkurs der Devisen, auszu- drücken in Basispunkten gemäß den vor- herrschenden Markkonventionen für das betreffende Währungspaar.“	