

**ΚΑΝΟΝΙΣΜΟΣ (ΕΕ) 2019/113 ΤΗΣ ΕΥΡΩΠΑΪΚΗΣ ΚΕΝΤΡΙΚΗΣ ΤΡΑΠΕΖΑΣ****της 7ης Δεκεμβρίου 2018****που τροποποιεί τον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 σχετικά με τα στατιστικά στοιχεία χρηματαγορών (ΕΚΤ/2018/33)**

ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ ΤΗΣ ΕΥΡΩΠΑΪΚΗΣ ΚΕΝΤΡΙΚΗΣ ΤΡΑΠΕΖΑΣ,

Έχοντας υπόψη τη Συνθήκη για τη λειτουργία της Ευρωπαϊκής Ένωσης,

Έχοντας υπόψη το καταστατικό του Ευρωπαϊκού Συστήματος Κεντρικών Τραπεζών και της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας, και ιδίως το άρθρο 5,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΚ) αριθ. 2533/98 του Συμβουλίου, της 23ης Νοεμβρίου 1998, σχετικά με τη συλλογή στατιστικών πληροφοριών από την Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα <sup>(1)</sup>, και ιδίως τα άρθρα 5 παράγραφος 1 και 6 παράγραφος 4,

Αφού διαβουλευτήκε με την Ευρωπαϊκή Επιτροπή,

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

- (1) Ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας (ΕΚΤ/2014/48) <sup>(2)</sup> απαιτεί από τις μονάδες παροχής στοιχείων να παρέχουν στατιστικά στοιχεία, προκειμένου το Ευρωπαϊκό Σύστημα Κεντρικών Τραπεζών (ΕΣΚΤ) να είναι σε θέση να καταρτίζει στατιστικά στοιχεία για τη χρηματαγορά του ευρώ στο πλαίσιο της εκπλήρωσης των καθηκόντων του.
- (2) Η διασφάλιση υψηλής ποιότητας στατιστικών στοιχείων για τη χρηματαγορά του ευρώ καθιστά απαραίτητη την τροποποίηση ορισμένων διατάξεων του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48). Συγκεκριμένα, είναι σημαντικό να διασφαλιστεί ότι κάθε μονάδα παροχής στοιχείων παρέχει στην Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα (ΕΚΤ) ή στην οικεία εθνική κεντρική τράπεζα (ΕθνΚΤ) στοιχεία για όλες τις συναλλαγές που η ίδια αυτή μονάδα συνάπτει με χρηματοοικονομικές εταιρείες (πλην των κεντρικών τραπεζών εφόσον ορισμένη συναλλαγή δεν εξυπηρετεί επενδυτικούς σκοπούς), καθώς και με τη γενική κυβέρνηση και ορισμένες μη χρηματοοικονομικές εταιρείες. Επίσης, είναι αναγκαίο να διασφαλιστεί ότι η συλλογή στοιχείων υποστηρίζεται από τη διευρυμένη υποχρεωτική χρήση του κωδικού αναγνώρισης νομικής οντότητας (LEI) κατά την παροχή στοιχείων στην Ένωση.
- (3) Αν είναι σημαντική η διασφάλιση της διαθεσιμότητας έγκαιρων στατιστικών στοιχείων για τη χρηματαγορά του ευρώ, καθίσταται αναγκαία και η εναρμόνιση και ενίσχυση των υποχρεώσεων των μονάδων παροχής στοιχείων για έγκαιρη διαβίβαση πληροφοριών στις ΕθνΚΤ ή στην ΕΚΤ.
- (4) Προκειμένου να διασφαλιστεί ότι οι μονάδες παροχής στοιχείων συλλέγουν, καταρτίζουν και διαβιβάζουν τα στατιστικά στοιχεία με τρόπο που διαφυλάσσει την ακεραιότητά τους, ενδείκνυται η λήψη προληπτικών μέτρων. Είναι σημαντικό ιδίως να τονιστεί ότι οι στατιστικές πληροφορίες που περιέχονται στις ΕθνΚΤ ή την ΕΚΤ θα πρέπει να είναι αμερόληπτες, δηλαδή να αποτελούν ουδέτερη απεικόνιση παρατηρήσιμων συναλλαγών τις οποίες συνάπτει η μονάδα παροχής στοιχείων τηρουμένων των ίσων αποστάσεων, αντικειμενικές και αξιόπιστες, προκειμένου να συνάδουν με τις γενικές αρχές που διαλαμβάνονται στη Δημόσια δέσμευση του ΕΣΚΤ σχετικά με τις ευρωπαϊκές στατιστικές <sup>(3)</sup>. Επιπλέον, οι μονάδες παροχής στοιχείων θα πρέπει να διασφαλίζουν ότι τυχόν λάθη στα παρεχόμενα στατιστικά στοιχεία θα διορθώνονται και θα γνωστοποιούνται στην ΕΚΤ και στην οικεία ΕθνΚΤ το συντομότερο δυνατό.
- (5) Η εφαρμογή των εν λόγω διατάξεων θα διασφαλίσει για το ΕΣΚΤ πιο έγκαιρα, ολοκληρωμένα, λεπτομερή, εναρμονισμένα και αξιόπιστα στατιστικά στοιχεία για τη χρηματαγορά του ευρώ, τα οποία θα επιτρέπουν μεγαλύτερη εμβάθυνση στην ανάλυση του μηχανισμού μετάδοσης της νομισματικής πολιτικής. Επιπλέον, τα συλλεγόμενα στοιχεία μπορούν να χρησιμοποιούνται για την ανάπτυξη και διαχείριση επιτοκίου ευρώ μίας ημέρας για μη εξασφαλισμένες συναλλαγές.
- (6) Για τους λόγους αυτούς ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48) θα πρέπει να τροποποιηθεί,

<sup>(1)</sup> ΕΕ L 318 της 27.11.1998, σ. 8.<sup>(2)</sup> Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας, της 26ης Νοεμβρίου 2014, σχετικά με τα στατιστικά στοιχεία χρηματαγορών (ΕΚΤ/2014/48) (ΕΕ L 359 της 16.12.2014, σ. 97).<sup>(3)</sup> Διαθέσιμη στον δικτυακό τόπο της ΕΚΤ ([www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)).

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΟΝ ΠΑΡΟΝΤΑ ΚΑΝΟΝΙΣΜΟ:

## Άρθρο 1

### Τροποποιήσεις

Ο κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48) τροποποιείται ως εξής:

1. το άρθρο 1 τροποποιείται ως εξής:

α) παρεμβάλλεται το ακόλουθο σημείο 5α:

«5α) «χρηματοοικονομικές εταιρείες»: θεσμικές μονάδες που είναι ανεξάρτητες νομικές οντότητες και παραγωγοί εμπορεύσιμου προϊόντος, των οποίων η βασική δραστηριότητα συνίσταται στην παροχή χρηματοοικονομικών υπηρεσιών, όπως καθορίζονται στο αναθεωρημένο Ευρωπαϊκό Σύστημα Λογαριασμών (ΕΣΛ 2010) που προβλέπεται στον κανονισμό (ΕΕ) αριθ. 549/2013 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου (\*).

(\*) Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 549/2013 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 21ης Μαΐου 2013, για το ευρωπαϊκό σύστημα εθνικών και περιφερειακών λογαριασμών της Ευρωπαϊκής Ένωσης (ΕΕ L 174 της 26.6.2013, σ. 1).»

β) τα σημεία 3 έως 5 διαγράφονται·

γ) το σημείο 9 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«9) «στατιστικά στοιχεία χρηματαγορών»: στατιστικά στοιχεία για τις εξασφαλισμένες και μη εξασφαλισμένες συναλλαγές και τις συναλλαγές επί παραγώγων που αφορούν μέσα της χρηματαγοράς και συνάπτονται στην οικεία περίοδο παροχής στοιχείων μεταξύ μονάδων παροχής στοιχείων και χρηματοοικονομικών εταιρειών (πλην των κεντρικών τραπεζών όταν η συναλλαγή δεν διενεργείται για επενδυτικούς σκοπούς), της γενικής κυβέρνησης ή μη χρηματοοικονομικών εταιρειών που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» σύμφωνα με το πλαίσιο LCR της Βασιλείας III, εξαιρουμένων πάντως των ενδοομιλικών συναλλαγών.»

δ) το σημείο 14 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«14) «πληθυσμός αναφοράς παροχής στοιχείων»: NXI κάτοικοι της ζώνης του ευρώ, εξαιρουμένων των κεντρικών τραπεζών και των ΑΚΧΑ, τα οποία δέχονται καταθέσεις εκφρασμένες σε ευρώ και/ή εκδίδουν οποιοδήποτε άλλο χρέογραφο και/ή χορηγούν δάνεια εκφρασμένα σε ευρώ, όπως παρατίθενται στα παραρτήματα I, II ή III, από/προς άλλες χρηματοοικονομικές εταιρείες, τη γενική κυβέρνηση ή μη χρηματοοικονομικές εταιρείες.»

ε) παρεμβάλλεται το ακόλουθο σημείο 20α:

«20α) «πιστωτικό ίδρυμα»: ο όρος αυτός νοείται όπως ορίζεται στο σημείο 1 του άρθρου 4 παράγραφος 1 του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 575/2013 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου (\*).

(\*) Κανονισμός (ΕΕ) αριθ. 575/2013 του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου, της 26ης Ιουνίου 2013, σχετικά με τις απαιτήσεις προληπτικής εποπτείας για πιστωτικά ιδρύματα και επιχειρήσεις επενδύσεων και την τροποποίηση του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 648/2012 (ΕΕ L 176 της 27.6.2013, σ. 1).»

στ) το σημείο 25 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«25) «πράξη ανταλλαγής δεικτών επιτοκίου διάρκειας μίας ημέρας» ή «OIS» (overnight index swap): πράξη ανταλλαγής επιτοκίου της οποίας το περιοδικά κυμαινόμενο επιτόκιο αντιστοιχεί στον γεωμετρικό μέσο όρο επιτοκίου διάρκειας μίας ημέρας (ή δείκτη επιτοκίου διάρκειας μίας ημέρας) στη διάρκεια συγκεκριμένης περιόδου. Η τελική πληρωμή υπολογίζεται ως η διαφορά μεταξύ του σταθερού επιτοκίου και του σύνθετου επιτοκίου διάρκειας μίας ημέρας που καταγράφεται κατά τη διάρκεια ζωής της OIS, εφαρμοζόμενη στο ονομαστικό ποσό της συναλλαγής.»

2. το άρθρο 3 τροποποιείται ως εξής:

α) η παράγραφος 1 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«1. Για τους σκοπούς της τακτικής κατάρτισης στατιστικών στοιχείων της χρηματαγοράς οι μονάδες παροχής στοιχείων υποβάλλουν στην ΕθνΚΤ του κράτους μέλους του οποίου είναι κάτοικοι ημερήσιες στατιστικές πληροφορίες για μέσα χρηματαγοράς σε ενοποιημένη βάση, περιλαμβανομένων όλων των υποκαταστημάτων τους στην Ένωση και στην ΕΖΕΣ. Οι απαιτούμενες στατιστικές πληροφορίες καθορίζονται στα παραρτήματα I, II και III. Οι μονάδες παροχής στοιχείων παρέχουν τις απαιτούμενες στατιστικές πληροφορίες σύμφωνα με τα ελάχιστα πρότυπα διαβίβασης, ακρίβειας, εννοιολογικής συμβατότητας, αναθεωρήσεων και ακεραιότητας των στοιχείων του παραρτήματος IV. Η ΕθνΚΤ διαβιβάζει στην ΕΚΤ τις στατιστικές πληροφορίες που λαμβάνει από τις μονάδες παροχής στοιχείων σύμφωνα με το άρθρο 4 παράγραφος 2 του παρόντος κανονισμού.»

β) η παράγραφος 2 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«2. Οι ΕθνΚΤ καθορίζουν και εφαρμόζουν τις ρυθμίσεις περί παροχής στοιχείων που πρέπει να τηρούν οι μονάδες παροχής στοιχείων σχετικά με τα μέσα χρηματαγοράς. Οι εν λόγω ρυθμίσεις διασφαλίζουν την παροχή των απαιτούμενων στατιστικών πληροφοριών και επιτρέπουν τον ακριβή έλεγχο της τήρησης των ελάχιστων προτύπων του παραρτήματος IV.»

γ) η παράγραφος 5 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«5. Οι ΕθνΚΤ καθορίζουν και εφαρμόζουν τις ρυθμίσεις περί παροχής στοιχείων που πρέπει να τηρούν οι πρόσθετες μονάδες παροχής στοιχείων σύμφωνα με τις οικείες εθνικές υποχρεώσεις παροχής στατιστικών στοιχείων. Οι ΕθνΚΤ διασφαλίζουν ότι οι εθνικές ρυθμίσεις περί παροχής στοιχείων απαιτούν από τις πρόσθετες μονάδες παροχής στοιχείων να συμμορφώνονται με υποχρεώσεις ανάλογες των προβλεπόμενων στα άρθρα 6 έως 8, στο άρθρο 10 παράγραφος 3 και στα άρθρα 11 και 12 του παρόντος κανονισμού. Οι ΕθνΚΤ διασφαλίζουν ότι μέσω των παραπάνω ρυθμίσεων περί παροχής στοιχείων παρέχονται οι απαιτούμενες στατιστικές πληροφορίες και επιτρέπεται ο ακριβής έλεγχος της τήρησης των ελάχιστων προτύπων του παραρτήματος IV.»

3. το άρθρο 4 τροποποιείται ως εξής:

α) η παράγραφος 1 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«1. Στην περίπτωση που ορισμένη ΕθνΚΤ αποφασίζει, σύμφωνα με το άρθρο 3 παράγραφος 3, ότι οι μονάδες παροχής στοιχείων παρέχουν απευθείας στην ΕΚΤ τις στατιστικές πληροφορίες των παραρτημάτων I, II και III, οι μονάδες αυτές διαβιβάζουν στην ΕΚΤ τις εν λόγω πληροφορίες μία φορά ημερησίως, μεταξύ 6 μ.μ. της ημερομηνίας συναλλαγής και 7 π.μ. (ώρα Κεντρικής Ευρώπης) (\*) της πρώτης ημέρας διακανονισμού TARGET2 μετά την ημερομηνία συναλλαγής.

(\*) Η αναφορά στην ώρα Κεντρικής Ευρώπης λαμβάνει υπόψη και την αλλαγή στη θερινή ώρα Κεντρικής Ευρώπης.»

β) η παράγραφος 2 αντικαθίσταται από το ακόλουθο κείμενο:

«2. Σε κάθε άλλη περίπτωση πέραν εκείνων της παραγράφου 1, οι ΕθνΚΤ διαβιβάζουν στην ΕΚΤ τις ημερήσιες στατιστικές πληροφορίες χρηματαγοράς, όπως καθορίζονται στα παραρτήματα I, II και III, τις οποίες λαμβάνουν από τις επιλεγμένες κατά το άρθρο 2 παράγραφοι 2, 3 και 4 μονάδες παροχής στοιχείων ή από τις επιλεγμένες κατά το άρθρο 2 παράγραφος 6 πρόσθετες μονάδες παροχής στοιχείων, μία φορά ημερησίως, πριν από τις 7 π.μ. (ώρα Κεντρικής Ευρώπης) της πρώτης ημέρας διακανονισμού TARGET2 μετά την ημερομηνία συναλλαγής.»

γ) προστίθεται η ακόλουθη παράγραφος 5:

«5. Ως προς την αξιολόγηση της συμμόρφωσης με τις υποχρεώσεις του παρόντος άρθρου η παράβαση από μονάδα παροχής στοιχείων οποιουδήποτε εκ των ελάχιστων προτύπων διαβίβασης της παραγράφου 1 σημεία i) και ii) του παραρτήματος IV συνιστά περίπτωση μη συμμόρφωσης με υποχρέωση παροχής στοιχείων της ίδιας κατηγορίας για τους σκοπούς στοιχειοθέτησης της μη συμμόρφωσης βάσει του πλαισίου μη συμμόρφωσης αναφορικά με τα στατιστικά στοιχεία της ΕΚΤ.»

4. το άρθρο 5 διαγράφεται·

5. το παράρτημα I του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48) αντικαθίσταται από το κείμενο του παραρτήματος I του παρόντος κανονισμού·

6. το παράρτημα II του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48) αντικαθίσταται από το κείμενο του παραρτήματος II του παρόντος κανονισμού·

7. το παράρτημα III του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48) αντικαθίσταται από το κείμενο του παραρτήματος III του παρόντος κανονισμού·

8. το παράρτημα IV του κανονισμού (ΕΕ) αριθ. 1333/2014 (ΕΚΤ/2014/48) αντικαθίσταται από το κείμενο του παραρτήματος IV του παρόντος κανονισμού.

## Άρθρο 2

### Τελικές διατάξεις

Ο παρών κανονισμός αρχίζει να ισχύει την εικοστή ημέρα από τη δημοσίευσή του στην *Επίσημη Εφημερίδα της Ευρωπαϊκής Ένωσης*.

Εφαρμόζεται από την 15η Μαρτίου 2019.

Ο παρών κανονισμός είναι δεσμευτικός ως προς όλα τα μέρη του και ισχύει άμεσα στα κράτη μέλη σύμφωνα με τις Συνθήκες.

Φρανκφούρτη, 7 Δεκεμβρίου 2018.

Για το διοικητικό συμβούλιο της ΕΚΤ

Ο Πρόεδρος της ΕΚΤ

Mario DRAGHI

---

## ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Ι

## «ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ Ι

**Πλαίσιο παροχής στατιστικών στοιχείων χρηματαγορών που αφορούν εξασφαλισμένες συναλλαγές**

## ΜΕΡΟΣ ΠΡΩΤΟ

## ΕΙΔΟΣ ΜΕΣΩΝ

Οι μονάδες παροχής στοιχείων παρέχουν στην Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα (ΕΚΤ) ή στην οικεία εθνική κεντρική τράπεζα (ΕθνΚΤ) στοιχεία για κάθε συμφωνία επαναγοράς και σχετική πράξη επαναγοράς, περιλαμβανομένων των τριμερών πράξεων επαναγοράς, οι οποίες εκφράζονται σε ευρώ, έχουν μέγιστη διάρκεια ενός έτους (συναλλαγές μέγιστης διάρκειας 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού) και συνάπτονται μεταξύ των εν λόγω μονάδων και χρηματοοικονομικών εταιρειών (πλην των κεντρικών τραπεζών όταν η συναλλαγή δεν διενεργείται για επενδυτικούς σκοπούς), της γενικής κυβέρνησης ή μη χρηματοοικονομικών εταιρειών που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» σύμφωνα με το πλαίσιο LCR της Βασιλείας III. Εξαιρούνται οι ενδοομιλικές συναλλαγές.

## ΜΕΡΟΣ ΔΕΥΤΕΡΟ

## ΕΙΔΟΣ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ

## 1. Είδος των στοιχείων συναλλαγής (\*) που παρέχονται ανά συναλλαγή:

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Reported transaction status (Καθεστώς αναγγελλόμενης συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί νέα συναλλαγή ή τροποποίηση, ακύρωση ή διόρθωση ήδη αναγγελθείσας συναλλαγής.	
Novation status (Καθεστώς ανανέωσης οφειλής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί ανανέωση οφειλής.	
Unique transaction identifier (Μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός που επιτρέπει την ταυτοποίηση συναλλαγής στο οικείο τμήμα της αγοράς.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.
Proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για κάθε συναλλαγή. Είναι μοναδικός για κάθε αναγγελλόμενη συναλλαγή ανά τμήμα της χρηματαγοράς και μονάδα παροχής στοιχείων.	
Related proprietary transaction identification (Σχετικός αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για την αρχική συναλλαγή η οποία στη συνέχεια ανανεώθηκε.	Η αναγγελία του πεδίου είναι υποχρεωτική εφόσον συντρέχει περίπτωση.
Counterparty proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής αντισυμβαλλομένου)	Ο αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής που αποδίδεται στην ίδια συναλλαγή από τον αντισυμβαλλόμενο της μονάδας παροχής στοιχείων.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Counterparty identification (Κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου)	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου της μονάδας παροχής στοιχείων σε σχέση με την αναγγελόμενη συναλλαγή.	Ο κωδικός αναγνώρισης νομικής οντότητας (LEI) πρέπει να χρησιμοποιείται σε κάθε περίπτωση, εφόσον έχει αποδοθεί στον αντισυμβαλλόμενο. Εφόσον δεν έχει αποδοθεί, πρέπει να παρέχονται ο τομέας αντισυμβαλλομένου και ο τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty sector (Τομέας αντισυμβαλλομένου)	Ο θεσμικός τομέας του αντισυμβαλλομένου.	Υποχρεωτική αναγγελία εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty location (Τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου)	Ο κωδικός χώρας της χώρας εγκατάστασης του αντισυμβαλλομένου βάσει του Διεθνούς Οργανισμού Τυποποίησης (ISO)	Υποχρεωτική αναγγελία, εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Tri-party agent identification (Κωδικός αναγνώρισης της τριμερούς μονάδας)	Ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου της τριμερούς μονάδας.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται για τις τριμερείς συναλλαγές. Ο κωδικός LEI πρέπει να χρησιμοποιείται σε κάθε περίπτωση, εφόσον έχει αποδοθεί στη μονάδα.
Reporting date (Ημερομηνία παροχής στοιχείων)	Η ημερομηνία και ώρα έναρξης και λήξης της περιόδου στην οποία αναφέρονται τα στοιχεία της συναλλαγής που περιέχονται στο αρχείο.	
Electronic time stamp (Ηλεκτρονική χρονοσφραγίδα)	Ο χρόνος σύναψης ή καταχώρισης της συναλλαγής.	
Trade date (Ημερομηνία συναλλαγής)	Η ημερομηνία σύναψης της χρηματοοικονομικής συναλλαγής μεταξύ των αντισυμβαλλομένων.	
Settlement date (Ημερομηνία διακανονισμού)	Η ημερομηνία αρχικής ανταλλαγής των μετρητών με το περιουσιακό στοιχείο κατά τα συμβατικά συμφωνηθέντα.	Στην περίπτωση ανανέωσης (roll-over) πράξεων επαναγοράς ανοικτού τύπου, είναι η ημερομηνία διακανονισμού της ανανέωσης, ακόμη και όταν δεν λαμβάνει χώρα ανταλλαγή μετρητών.
Maturity date (Ημερομηνία λήξης)	Η ημερομηνία επαναγοράς, δηλαδή η ημερομηνία κατά την οποία πρέπει να επιστραφούν ή να παραληφθούν τα μετρητά έναντι του περιουσιακού στοιχείου που έχει ενεχυρασθεί ή ληφθεί ως ασφάλεια.	
Transaction type (Είδος συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή διενεργείται για τη χορήγηση ή λήψη μετρητών ως δανείου.	
Transaction nominal amount (Ονομαστικό ποσό συναλλαγής)	Το ποσό σε ευρώ του αρχικά χορηγούμενου ή λαμβανόμενου δανείου.	
Rate type (Είδος επιτοκίου)	Προσδιορίζει εάν το μέσο είναι σταθερού ή κυμαινόμενου επιτοκίου.	
Deal rate (Επιτόκιο συναλλαγής)	Το επιτόκιο που είναι εκφρασμένο σύμφωνα με τη συνθήκη χρηματαγοράς του πραγματικού αριθμού ημερών και του έτους των 360 ημερών (ACT/360), βάσει του οποίου συνάπτεται η συμφωνία επαναγοράς και τοκίζονται τα μετρητά που χορηγούνται ως δάνειο.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για τα μέσα σταθερού επιτοκίου.

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Reference rate index (Δείκτης επιτοκίου αναφοράς)	Ο Διεθνής Αριθμός Αναγνώρισης Τίτλων (ISIN) του υποκειμένου επιτοκίου αναφοράς βάσει του οποίου υπολογίζονται οι περιοδικές πληρωμές τόκων.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για τα μέσα κυμαινόμενου επιτοκίου.
Basis point spread (Περιθώριο μονάδων βάσης)	Ο αριθμός μονάδων βάσης που προστίθενται (θετικό) στο ή αφαιρούνται (αρνητικό) από το υποκείμενο επιτόκιο αναφοράς για τον υπολογισμό του πραγματικού επιτοκίου που εφαρμόζεται για δεδομένη χρονική περίοδο κατά την έκδοση του μέσου κυμαινόμενου επιτοκίου.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για τα μέσα κυμαινόμενου επιτοκίου.
Collateral ISIN (ISIN της ασφάλειας)	Ο ISIN του περιουσιακού στοιχείου που παρέχεται ως ασφάλεια.	Προαιρετική αναγγελία του πεδίου για τριμερείς συμφωνίες επαναγοράς που δεν συνάπτονται έναντι καλαθιού τίτλων για το οποίο υπάρχει γενικός ISIN ή για είδη ασφαλειών για τα οποία δεν υπάρχει ISIN. Όταν δεν παρέχεται ο ISIN του περιουσιακού στοιχείου που χρησιμοποιείται ως ασφάλεια, θα πρέπει να αναφέρεται το είδος της ασφάλειας, ο τομέας του εκδότη της ασφάλειας και το χαρτοφυλάκιο ασφαλειών.
Collateral pool (Χαρτοφυλάκιο ασφαλειών)	Προσδιορίζει εάν το περιουσιακό στοιχείο που χρησιμοποιείται ως ασφάλεια αποτελεί χαρτοφυλάκιο ασφαλειών.	
Collateral type (Είδος ασφάλειας)	Προσδιορίζει την κατηγορία περιουσιακών στοιχείων που χρησιμοποιούνται ως ασφάλεια.	Υποχρεωτική αναγγελία, εάν δεν παρέχεται ο ISIN της ασφάλειας.
Collateral issuer sector (Τομέας του εκδότη της ασφάλειας)	Ο θεσμικός τομέας του εκδότη της ασφάλειας.	Υποχρεωτική αναγγελία, εάν δεν παρέχεται ο ISIN της ασφάλειας.
Special collateral indicator (Δείκτης αναγνώρισης ειδικής ασφάλειας)	Προσδιορίζει όλες τις συμφωνίες επαναγοράς που συνάπτονται έναντι γενικής ασφάλειας και όσες συνάπτονται έναντι ειδικής ασφάλειας.	Αναγγέλλεται μόνο εάν είναι εφικτό για τη μονάδα παροχής στοιχείων.
Collateral nominal amount (Ονομαστικό ποσό ασφάλειας)	Το ονομαστικό ποσό σε ευρώ των περιουσιακών στοιχείων που χρησιμοποιούνται ως ασφάλεια.	Προαιρετική αναγγελία για τριμερείς πράξεις επαναγοράς και κάθε συναλλαγή στην οποία τα ενεχυραζόμενα περιουσιακά στοιχεία δεν ταυτοποιούνται μέσω ISIN.
Collateral haircut (Περικοπή ασφάλειας)	Μέτρο ελέγχου κινδύνου που εφαρμόζεται στην υποκείμενη ασφάλεια και σύμφωνα με το οποίο η αξία της ασφάλειας υπολογίζεται ως η αγοραία αξία των περιουσιακών στοιχείων μειωμένη κατά ορισμένο ποσοστό (περικοπή).	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται για τις συναλλαγές με μία ασφάλεια, κατά τα λοιπά είναι προαιρετική.

## 2. Όριο σημαντικότητας:

Η παροχή στοιχείων για συναλλαγές που συνάπτονται με μη χρηματοοικονομικές εταιρείες απαιτείται μόνο για συναλλαγές οι οποίες αφορούν μη χρηματοοικονομικές εταιρείες που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» βάσει του πλαισίου LCR της Βασιλείας III (\*\*).

(\*) Τα πρότυπα ηλεκτρονικής παροχής στοιχείων και οι τεχνικές προδιαγραφές των στοιχείων καθορίζονται χωριστά. Είναι διαθέσιμα στον δικτυακό τόπο της ΕΚΤ ([www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)).

(\*\*) Βλέπε κείμενο με τίτλο «Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools» («Βασιλεία III: Συντελεστής κάλυψης ρευστότητας και εργαλεία παρακολούθησης κινδύνων»), Επιτροπή Τραπεζικής Εποπτείας της Βασιλείας, Ιανουάριος 2013, σ. 23 έως 27, διαθέσιμο στον δικτυακό τόπο της Τράπεζας Διεθνών Διακανονισμών ([www.bis.org](http://www.bis.org)).

## ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ II

## «ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ II

**Πλαίσιο παροχής στατιστικών στοιχείων χρηματαγορών που αφορούν μη εξασφαλισμένες συναλλαγές**

## ΜΕΡΟΣ ΠΡΩΤΟ

## ΕΙΔΟΣ ΜΕΣΩΝ

1. Οι μονάδες παροχής στοιχείων παρέχουν στην Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα (ΕΚΤ) ή στην οικεία εθνική κεντρική τράπεζα (ΕθνΚΤ) στοιχεία για:
- α) κάθε δάνειο που λαμβάνουν με χρήση των μέσων που προσδιορίζονται στον παρακάτω πίνακα, τα οποία εκφράζονται σε ευρώ και έχουν μέγιστη διάρκεια ενός έτους (συναλλαγές μέγιστης διάρκειας 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού), από χρηματοοικονομικές εταιρείες (πλην των κεντρικών τραπεζών όταν η συναλλαγή δεν διενεργείται για επενδυτικούς σκοπούς), τη γενική κυβέρνηση ή μη χρηματοοικονομικές εταιρείες που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» σύμφωνα με το πλαίσιο LCR της Βασιλείας III·
- β) κάθε δάνειο εκφρασμένο σε ευρώ προς άλλα πιστωτικά ιδρύματα, μέγιστης διάρκειας ενός έτους (συναλλαγές μέγιστης διάρκειας 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού), μέσω μη εξασφαλισμένων καταθέσεων ή λογαριασμών καταθέσεων ή μέσω αγοράς από τα εκδίδοντα πιστωτικά ιδρύματα εμπορικών γραμματίων, πιστοποιητικών καταθέσεων, γραμματίων κυμαινόμενου επιτοκίου και άλλων χρεογράφων διάρκειας μέχρι ενός έτους.
- Για τους σκοπούς των ανωτέρω στοιχείων α) και β) εξαιρούνται οι ενδοομιλικές συναλλαγές.
2. Ο παρακάτω πίνακας παρέχει αναλυτική τυποποιημένη περιγραφή των κατηγοριών μέσων που χρησιμοποιούνται σε συναλλαγές ως προς τις οποίες οι μονάδες παροχής στοιχείων απαιτείται να παρέχουν στοιχεία στην ΕΚΤ. Στην περίπτωση που οι μονάδες παροχής στοιχείων υποχρεούνται να παρέχουν στοιχεία στην οικεία ΕθνΚΤ, αυτή θα πρέπει να ενσωματώσει τις εν λόγω περιγραφές των κατηγοριών μέσων σε εθνικό επίπεδο σύμφωνα με τον παρόντα κανονισμό.

Είδος μέσου	Περιγραφή
Deposits (Καταθέσεις)	Μη εξασφαλισμένες έντοκες καταθέσεις (συμπεριλαμβανομένων των καταθέσεων, αλλά εξαιρουμένων των τρεχούμενων λογαριασμών) υπό προειδοποίηση ή προθεσμίας μέχρι ενός έτους, δηλαδή μέγιστης προθεσμίας 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού, οι οποίες είτε λαμβάνονται από τη μονάδα παροχής στοιχείων (ως δανειολήπτρια) είτε πραγματοποιούνται από αυτή (ως δανείστρια).
Call account/Call money (Λογαριασμοί καταθέσεων/Λογαριασμοί όψεως)	Λογαριασμοί μετρητών με ημερήσιες μεταβολές του εφαρμοστέου επιτοκίου, για τους οποίους οι τόκοι καταβάλλονται ή υπολογίζονται ανά τακτά χρονικά διαστήματα, οι δε αναλήψεις υπόκεινται σε προθεσμία. Λογαριασμοί ταμειυτηρίου, οι αναλήψεις από τους οποίους υπόκεινται σε προθεσμία.
Certificate of deposit (Πιστοποιητικό κατάθεσης)	Χρεόγραφο καθορισμένης διάρκειας και διαπραγματεύσιμης ή μη διαπραγματεύσιμης μορφής που εκδίδεται από NXI ως έντοκο ή υπό το άρτιο και παρέχει στον κάτοχο του καθορισμένο σταθερό επιτόκιο για καθορισμένη μέγιστη διάρκεια ενός έτους, δηλαδή 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού.
Commercial paper (Εμπορικό γραμμάτιο)	Μη εξασφαλισμένο χρεόγραφο που εκδίδεται από NXI ως έντοκο ή υπό το άρτιο και με μέγιστη διάρκεια ενός έτους, δηλαδή 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού.
Asset backed commercial paper (Εμπορικό γραμμάτιο καλυπτόμενο από ασφάλεια)	Χρεόγραφο που εκδίδεται από NXI ως έντοκο ή υπό το άρτιο και με μέγιστη διάρκεια ενός έτους, δηλαδή 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού, και καλύπτεται από κάποιου είδους ασφάλεια.
Floating rate note (Γραμμάτιο κυμαινόμενου επιτοκίου)	Χρεόγραφο μέγιστης διάρκειας ενός έτους, δηλαδή 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού, για το οποίο οι περιοδικές πληρωμές τόκων υπολογίζονται με βάση τη διαμόρφωση της αξίας (δηλαδή το "fixing") ενός υποκείμενου επιτοκίου αναφοράς, όπως το διατραπεζικό επιτόκιο δανεισμού σε ευρώ (Euro Interbank Offered Rate – Euribor), σε προκαθορισμένες ημερομηνίες γνωστές ως ημερομηνίες "fixing".



Είδος μέσου	Περιγραφή
Other short-term debt securities (Λοιπά βραχυπρόθεσμα χρεόγραφα)	<p>Μη μειωμένης εξασφάλισης τίτλοι, εκτός των μετοχικών τίτλων, μέγιστης διάρκειας ενός έτους, δηλαδή 397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού, που εκδίδονται από τις μονάδες παροχής στοιχείων, συνήθως είναι διαπραγματεύσιμοι και αποτελούν αντικείμενο συναλλαγών σε δευτερογενείς αγορές ή αντικείμενο συμψηφισμού στην αγορά και οι οποίοι δεν παρέχουν στον κάτοχο δικαιώματα ιδιοκτησίας επί του ιδρύματος έκδοσης. Εν προκειμένω περιλαμβάνονται:</p> <p>α) τίτλοι που παρέχουν στον κάτοχο το ανεπιφύλακτο δικαίωμα απόληψης προκαθορισμένου ή συμβατικά καθορισμένου εισοδήματος με τη μορφή πληρωμών τοκομεριδίων και/ή ρητώς προκαθορισμένου ποσού σε μία ή περισσότερες καθορισμένες ημερομηνίες ή αρχής γενομένης από ημερομηνία καθοριζόμενη κατά το χρόνο έκδοσης·</p> <p>β) μη διαπραγματεύσιμα μέσα τα οποία εκδίδονται από μονάδες παροχής στοιχείων, στη συνέχεια καθίστανται διαπραγματεύσιμα και ταξινομούνται εκ νέου ως "χρεόγραφα".</p>

## ΜΕΡΟΣ ΔΕΥΤΕΡΟ

## ΕΙΔΟΣ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ

1. Είδος των στοιχείων συναλλαγής (\*) που παρέχονται ανά συναλλαγή:

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Reported transaction status (Καθεστώς αναγγελόμενης συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί νέα συναλλαγή ή τροποποίηση, ακύρωση ή διόρθωση ήδη αναγγελθείσας συναλλαγής.	
Novation status (Καθεστώς ανανέωσης οφειλής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί ανανέωση οφειλής.	
Unique transaction identifier (Μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός που επιτρέπει την ταυτοποίηση μιας συναλλαγής στο οικείο τμήμα της αγοράς.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.
Proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για κάθε συναλλαγή. Είναι μοναδικός για κάθε αναγγελόμενη συναλλαγή ανά τμήμα της χρηματαγοράς και μονάδα παροχής στοιχείων.	
Related proprietary transaction identification (Σχετικός αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για την αρχική συναλλαγή η οποία στη συνέχεια ανανεώθηκε.	Η αναγγελία του πεδίου είναι υποχρεωτική εφόσον συντρέχει περίπτωση.
Counterparty proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής αντισυμβαλλομένου)	Ο αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής που αποδίδεται στην ίδια συναλλαγή από τον αντισυμβαλλόμενο της μονάδας παροχής στοιχείων.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Counterparty identification (Κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου)	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου της μονάδας παροχής στοιχείων σε σχέση με την αναγγελλόμενη συναλλαγή.	Ο κωδικός αναγνώρισης νομικής οντότητας (LEI) πρέπει να χρησιμοποιείται σε κάθε περίπτωση, εφόσον έχει αποδοθεί στον αντισυμβαλλόμενο. Εφόσον δεν έχει αποδοθεί, πρέπει να παρέχονται ο τομέας αντισυμβαλλομένου και ο τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty sector (Τομέας αντισυμβαλλομένου)	Ο θεσμικός τομέας του αντισυμβαλλομένου.	Υποχρεωτική αναφορά εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty location (Τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου)	Ο κωδικός χώρας της χώρας εγκατάστασης του αντισυμβαλλομένου βάσει του Διεθνούς Οργανισμού Τυποποίησης (ISO).	Υποχρεωτική αναγγελία, εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Reporting date (Ημερομηνία παροχής στοιχείων)	Η ημερομηνία και ώρα έναρξης και λήξης της περιόδου στην οποία αναφέρονται τα στοιχεία της συναλλαγής που περιέχονται στο αρχείο.	
Electronic time stamp (Ηλεκτρονική χρονοσφραγίδα)	Ο χρόνος σύναψης ή καταχώρισης της συναλλαγής.	
Trade date (Ημερομηνία συναλλαγής)	Η ημερομηνία σύναψης της αναγγελλόμενης χρηματοοικονομικής συναλλαγής μεταξύ των αντισυμβαλλομένων.	
Settlement date (Ημερομηνία διακανονισμού)	Η ημερομηνία κατά την οποία οι αντισυμβαλλόμενοι ανταλλάσσουν το χρηματικό ποσό ή κατά την οποία διακανονίζεται η αγορά ή πώληση χρεογράφου.	Στην περίπτωση καταθέσεων (call accounts) και άλλης μη εξασφαλισμένης μορφής χορήγησης/λήψης δανείου υπό προθεσμία, η ημερομηνία ανανέωσης (roll-over) (δηλαδή η ημερομηνία λήξης της αρχικής προθεσμίας κατά την οποία το δάνειο θα είχε αποπληρωθεί και δεν θα είχε ανανεωθεί).
Maturity date (Ημερομηνία λήξης)	Ημερομηνία κατά την οποία ο δανειολήπτης πρέπει να αποπληρώσει το χρηματικό ποσό στον δανειστή ή κατά την οποία το χρεόγραφο λήγει και καθίσταται εξοφλητέο.	
Instrument type (Είδος μέσου)	Το μέσο διά του οποίου χορηγείται ή λαμβάνεται το δάνειο.	
Transaction type (Είδος συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν πρόκειται για συναλλαγή χορήγησης ή για συναλλαγή λήψης μετρητών ως δανείου.	
Transaction nominal amount (Ονομαστικό ποσό συναλλαγής)	Το χρηματικό ποσό σε ευρώ που δίνεται ή λαμβάνεται ως δάνειο επί καταθέσεων. Στην περίπτωση χρεογράφων, το ονομαστικό ποσό του τίτλου που εκδίδεται/αγοράζεται.	
Transaction deal price (Τιμή συναλλαγής)	Η εκφρασμένη σε εκατοστιαίες μονάδες ακαθάριστη τιμή (δηλαδή με τυχόν δεδουλευμένους τόκους) στην οποία εκδίδεται ή αποτελεί αντικείμενο συναλλαγής ο τίτλος.	Αναφέρεται η τιμή "100" για τις μη εξασφαλισμένες καταθέσεις.
Rate type (Είδος επιτοκίου)	Προσδιορίζει εάν το μέσο είναι σταθερού ή κυμαινόμενου επιτοκίου.	

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Deal rate (Επιτόκιο συναλλαγής)	Το επιτόκιο της κατάθεσης με το οποίο τοκίζεται το ποσό των μετρητών που χορηγείται ως δάνειο, εκφρασμένο σύμφωνα με τη συνθήκη χρηματαγοράς του πραγματικού αριθμού ημερών και του έτους των 360 ημερών (ACT/360). Στην περίπτωση χρεογράφων, το πραγματικό επιτόκιο έκδοσης ή αγοράς του χρεογράφου, εκφρασμένο σύμφωνα με τη συνθήκη χρηματαγοράς ACT/360.	Η αναφορά απαιτείται μόνο για τα μέσα σταθερού επιτοκίου.
Reference rate index (Δείκτης επιτοκίου αναφοράς)	Ο Διεθνής Αριθμός Αναγνώρισης Τίτλων (ISIN) του υποκείμενου επιτοκίου αναφοράς βάσει του οποίου υπολογίζονται οι περιοδικές πληρωμές τόκων.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για τα μέσα κυμαινόμενου επιτοκίου.
Basis point spread (Περιθώριο μονάδων βάσης)	Ο αριθμός μονάδων βάσης που προστίθενται (θετικό) στο ή αφαιρούνται (αρνητικό) από τον δείκτη επιτοκίου αναφοράς για τον υπολογισμό του πραγματικού επιτοκίου που εφαρμόζεται για τη δεδομένη χρονική περίοδο κατά την έκδοση του μέσου κυμαινόμενου επιτοκίου.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για τα μέσα κυμαινόμενου επιτοκίου.
Call or put (Προαίρεση για αγορά ή πώληση)	Προσδιορίζει εάν το μέσο παρέχει δικαίωμα προαίρεσης για αγορά ή πώληση.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για τα μέσα που παρέχουν δικαίωμα προαίρεσης για αγορά/πώληση.
First call/put date (Πρώτη ημερομηνία άσκησης δικαιώματος προαίρεσης για αγορά/πώληση)	Η πρώτη ημερομηνία κατά την οποία μπορεί να ασκηθεί το δικαίωμα προαίρεσης για αγορά ή πώληση.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για μέσα που παρέχουν δικαίωμα προαίρεσης το οποίο μπορεί να ασκηθεί σε μία ή περισσότερες προκαθορισμένες ημερομηνίες.
Call/put notice period (Περίοδος προειδοποίησης άσκησης δικαιώματος προαίρεσης για αγορά/πώληση)	Ο αριθμός των ημερολογιακών ημερών που ο κάτοχος/εκδότης του μέσου παραχωρεί στον εκδότη/κάτοχο του μέσου πριν από την άσκηση του δικαιώματος προαίρεσης για πώληση/αγορά.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται μόνο για όλα τα μέσα/συναλλαγές με περίοδο προειδοποίησης άσκησης δικαιώματος προαίρεσης για αγορά/πώληση και για τις καταθέσεις με προσυμφωνημένη περίοδο προειδοποίησης.

## 2. Όριο σημαντικότητας:

Η παροχή στοιχείων για συναλλαγές που συνάπτονται με μη χρηματοοικονομικές εταιρείες απαιτείται μόνο για συναλλαγές που αφορούν μη χρηματοοικονομικές εταιρείες που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» βάσει του πλαισίου LCR της Βασιλείας III.

(\*) Τα πρότυπα ηλεκτρονικής παροχής στοιχείων και οι τεχνικές προδιαγραφές των στοιχείων καθορίζονται χωριστά. Είναι διαθέσιμα στον δικτυακό τόπο της ΕΚΤ ([www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)).

## ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ ΙΙΙ

## «ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ ΙΙΙ

**Πλαίσιο παροχής στατιστικών στοιχείων χρηματαγορών που αφορούν συναλλαγές παραγώγων**

## ΜΕΡΟΣ ΠΡΩΤΟ

## ΕΙΔΟΣ ΜΕΣΩΝ

Οι μονάδες παροχής στοιχείων παρέχουν στην Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα (ΕΚΤ) ή στην οικεία εθνική κεντρική τράπεζα (ΕθνΚΤ) στοιχεία για:

- α) συναλλαγές επί πράξεων ανταλλαγής νομισμάτων, στο πλαίσιο των οποίων αγοράζεται/πωλείται ευρώ έναντι ξένου νομίσματος που επαναπωλείται/επαναγοράζεται σε μελλοντική ημερομηνία και με προσυμφωνημένη προθεσμιακή συναλλαγματική ισοτιμία, οι οποίες έχουν μέγιστη διάρκεια ενός έτους [397 ημερών από την ημερομηνία διακανονισμού του άμεσου (spot) σκέλους τους] και συνάπτονται μεταξύ της μονάδας παροχής στοιχείων και χρηματοοικονομικών εταιρειών (πλην των κεντρικών τραπεζών όταν η συναλλαγή δεν διενεργείται για επενδυτικούς σκοπούς), της γενικής κυβέρνησης ή μη χρηματοοικονομικών εταιρειών που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» σύμφωνα με το πλαίσιο LCR της Βασιλείας ΙΙΙ·
- β) εκφρασμένες σε ευρώ συναλλαγές επί πράξεων ανταλλαγής επί του δείκτη μίας ημέρας (overnight index swaps, εφεξής «OIS») μεταξύ της μονάδας παροχής στοιχείων και χρηματοοικονομικών εταιρειών (πλην των κεντρικών τραπεζών όταν η συναλλαγή δεν διενεργείται για επενδυτικούς σκοπούς), της γενικής κυβέρνησης ή μη χρηματοοικονομικών εταιρειών που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» σύμφωνα με το πλαίσιο LCR της Βασιλείας ΙΙΙ.

Για τους σκοπούς της ανωτέρω παραγράφου 1 στοιχεία α) και β) εξαιρούνται οι ενδοομιλικές συναλλαγές.

## ΜΕΡΟΣ ΔΕΥΤΕΡΟ

## ΕΙΔΟΣ ΣΤΟΙΧΕΙΩΝ

1. Είδος των στοιχείων συναλλαγής (\*) όσον αφορά πράξεις ανταλλαγής νομισμάτων, τα οποία παρέχονται ανά συναλλαγή:

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Reported transaction status (Καθεστώς αναγγελλόμενης συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί νέα συναλλαγή ή τροποποίηση, ακύρωση ή διόρθωση ήδη αναγγελθείσας συναλλαγής.	
Novation status (Καθεστώς ανανέωσης οφειλής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί ανανέωση οφειλής.	
Unique transaction identifier (Μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός που επιτρέπει την ταυτοποίηση μιας συναλλαγής στο οικείο τμήμα της αγοράς.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.
Proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για κάθε συναλλαγή. Είναι μοναδικός για κάθε αναγγελλόμενη συναλλαγή ανά τμήμα της χρηματαγοράς και μονάδα παροχής στοιχείων.	
Related proprietary transaction identification (Σχετικός αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για την αρχική συναλλαγή η οποία στη συνέχεια ανανεώθηκε.	Η αναγγελία του πεδίου είναι υποχρεωτική εφόσον συντρέχει περίπτωση.
Counterparty proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής αντισυμβαλλομένου)	Ο αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής που αποδίδεται στην ίδια συναλλαγή από τον αντισυμβαλλόμενο της μονάδας παροχής στοιχείων.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Counterparty identification (Κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου)	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου της μονάδας παροχής στοιχείων σε σχέση με την αναγγελλόμενη συναλλαγή.	Ο κωδικός αναγνώρισης νομικής οντότητας (LEI) πρέπει να χρησιμοποιείται σε κάθε περίπτωση, εφόσον έχει αποδοθεί στον αντισυμβαλλόμενο. Εφόσον δεν έχει αποδοθεί, πρέπει να παρέχονται ο τομέας αντισυμβαλλομένου και ο τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty sector (Τομέας αντισυμβαλλομένου)	Ο θεσμικός τομέας του αντισυμβαλλομένου.	Υποχρεωτική αναγγελία εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty location (Τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου)	Ο κωδικός χώρας της χώρας εγκατάστασης του αντισυμβαλλομένου βάσει του Διεθνούς Οργανισμού Τυποποίησης (ISO).	Υποχρεωτική αναγγελία εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Reporting date (Ημερομηνία παροχής στοιχείων)	Η ημερομηνία και ώρα έναρξης και λήξης της περιόδου στην οποία αναφέρονται τα στοιχεία της συναλλαγής που περιέχονται στο αρχείο.	
Electronic time stamp (Ηλεκτρονική χρονοσφραγίδα)	Ο χρόνος σύναψης ή καταχώρισης της συναλλαγής.	
Trade date (Ημερομηνία συναλλαγής)	Η ημερομηνία σύναψης της αναγγελλόμενης χρηματοοικονομικής συναλλαγής μεταξύ των αντισυμβαλλομένων.	
Spot value date (Ημερομηνία τρέχουσας αξίας)	Η ημερομηνία κατά την οποία ο ένας εκ των συμβαλλομένων πωλεί στον άλλον καθορισμένη ποσότητα συγκεκριμένου νομίσματος έναντι καταβολής συμφωνούμενης ποσότητας σε συγκεκριμένο διαφορετικό νόμισμα βάσει συμφωνούμενης συναλλαγματικής ισοτιμίας γνωστής ως "τρέχουσας συναλλαγματικής ισοτιμίας".	
Maturity date (Ημερομηνία λήξης)	Η ημερομηνία κατά την οποία λήγει η πράξη ανταλλαγής νομισμάτων και επαναγοράζεται το νόμισμα που είχε πωληθεί κατά την ημερομηνία τρέχουσας αξίας.	
Foreign exchange transaction type (Είδος πράξης συναλλαγματος)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η ποσότητα ευρώ που αναφέρεται στο πεδίο του ονομαστικού ποσού συναλλαγής πωλείται ή αγοράζεται κατά την ημερομηνία τρέχουσας αξίας. Πρέπει να αναφέρεται στο άμεσο σκέλος της αγοραπωλησίας (euro spot), δηλαδή στο αν ευρώ πωλούνται ή αγοράζονται κατά την ημερομηνία τρέχουσας αξίας.	
Transaction nominal amount (Ονομαστικό ποσό συναλλαγής)	Το ονομαστικό ποσό σε ευρώ της πράξης ανταλλαγής νομισμάτων.	
Foreign currency code (Κωδικός ξένου νομίσματος)	Ο διεθνής τριψήφιος κωδικός ISO του νομίσματος που πωλείται/αγοράζεται έναντι ευρώ.	
Foreign exchange spot rate (Άμεση συναλλαγματική ισοτιμία)	Η συναλλαγματική ισοτιμία μεταξύ ευρώ και ξένου νομίσματος που εφαρμόζεται στο πρώτο σκέλος της πράξης ανταλλαγής νομισμάτων.	

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Foreign exchange forward points (Διαφορά μεταξύ προθεσμιακής και τρέχουσας ισοτιμίας)	Η εκφρασμένη σε μονάδες βάσης διαφορά μεταξύ της προθεσμιακής και άμεσης συναλλαγματικής ισοτιμίας, η οποία καθορίζεται με βάση τις συνθήκες που επικρατούν στην αγορά όσον αφορά το αντίστοιχο ζεύγος νομισμάτων.	

2. Είδος των στοιχείων συναλλαγής όσον αφορά συναλλαγές OIS, τα οποία παρέχονται ανά συναλλαγή:

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Reported transaction status (Καθεστώς αναγγελλόμενης συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί νέα συναλλαγή ή τροποποίηση, ακύρωση ή διόρθωση ήδη αναγγελθείσας συναλλαγής.	
Novation status (Καθεστώς ανανέωσης οφειλής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η συναλλαγή αποτελεί ανανέωση οφειλής.	
Unique transaction identifier (Μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός που επιτρέπει την ταυτοποίηση μιας συναλλαγής στο οικείο τμήμα της αγοράς.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.
Proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για κάθε συναλλαγή. Είναι μοναδικός για κάθε αναγγελλόμενη συναλλαγή ανά τμήμα της χρηματαγοράς και μονάδα παροχής στοιχείων.	
Related proprietary transaction identification (Σχετικός αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής)	Ο μοναδικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής τον οποίο χρησιμοποιεί εσωτερικά η μονάδα παροχής στοιχείων για την αρχική συναλλαγή η οποία στη συνέχεια ανανεώθηκε.	Η αναγγελία του πεδίου είναι υποχρεωτική εφόσον συντρέχει περίπτωση.
Counterparty proprietary transaction identification (Αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής αντισυμβαλλομένου)	Ο αποκλειστικός κωδικός αναγνώρισης συναλλαγής που αποδίδεται στην ίδια συναλλαγή από τον αντισυμβαλλόμενο της μονάδας παροχής στοιχείων.	Η αναγγελία του πεδίου απαιτείται εφόσον υπάρχουν στοιχεία.
Counterparty identification (Κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου)	Κωδικός που χρησιμοποιείται για την αναγνώριση του αντισυμβαλλομένου της μονάδας παροχής στοιχείων σε σχέση με τη συναλλαγή για την οποία παρέχονται στοιχεία.	Ο κωδικός LEI πρέπει να χρησιμοποιείται σε κάθε περίπτωση, εφόσον έχει αποδοθεί στον αντισυμβαλλόμενο. Εφόσον δεν έχει αποδοθεί, πρέπει να παρέχονται ο τομέας αντισυμβαλλομένου και ο τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty sector (Τομέας αντισυμβαλλομένου)	Ο θεσμικός τομέας του αντισυμβαλλομένου.	Υποχρεωτική αναγγελία εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Counterparty location (Τόπος εγκατάστασης αντισυμβαλλομένου)	Ο κωδικός χώρας της χώρας εγκατάστασης του αντισυμβαλλομένου βάσει του ISO.	Υποχρεωτική αναγγελία εάν δεν παρέχεται ο κωδικός αναγνώρισης αντισυμβαλλομένου.
Reporting date (Ημερομηνία παροχής στοιχείων)	Η ημερομηνία και ώρα έναρξης και λήξης της περιόδου στην οποία αναφέρονται τα στοιχεία της συναλλαγής που περιέχονται στο αρχείο.	

Πεδίο	Περιγραφή στοιχείου	Εναλλακτικοί όροι παροχής στοιχείου (κατά περίπτωση) και λοιπά χαρακτηριστικά
Electronic time stamp (Ηλεκτρονική χρονοσφραγίδα)	Ο χρόνος σύναψης ή καταχώρισης της συναλλαγής.	Προαιρετική.
Trade date (Ημερομηνία συναλλαγής)	Η ημερομηνία σύναψης της χρηματοοικονομικής συναλλαγής μεταξύ των αντισυμβαλλομένων.	
Start date (Ημερομηνία έναρξης)	Η ημερομηνία κατά την οποία υπολογίζεται το επιτόκιο μίας ημέρας του κυμαινόμενου σκέλους.	
Maturity date (Ημερομηνία λήξης)	Η τελευταία ημερομηνία της περιόδου στη διάρκεια της οποίας υπολογίζεται το σύνθετο επιτόκιο μίας ημέρας.	
Fixed interest rate (Σταθερό επιτόκιο)	Το σταθερό επιτόκιο που χρησιμοποιείται για τον υπολογισμό της αποπληρωμής των OIS.	
Transaction type (Είδος συναλλαγής)	Το χαρακτηριστικό γνώρισμα που καθορίζει εάν η μονάδα παροχής στοιχείων πληρώνει ή εισπράττει το σταθερό επιτόκιο.	
Transaction nominal amount (Ονομαστικό ποσό συναλλαγής)	Το ονομαστικό ποσό των OIS.	

### 3. Όριο σημαντικότητας:

Η παροχή στοιχείων για συναλλαγές που συνάπτονται με μη χρηματοοικονομικές εταιρείες απαιτείται μόνο για συναλλαγές που αφορούν μη χρηματοοικονομικές εταιρείες που ταξινομούνται ως εταιρείες «χονδρικής» βάσει του πλαισίου LCR της Βασιλείας III.

(\*) Τα πρότυπα ηλεκτρονικής παροχής στοιχείων και οι τεχνικές προδιαγραφές των στοιχείων καθορίζονται χωριστά. Είναι διαθέσιμα στον δικτυακό τόπο της ΕΚΤ ([www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)).

## ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ IV

## «ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ IV

**Ελάχιστα πρότυπα που πρέπει να εφαρμόζει ο πραγματικός πληθυσμός παροχής στοιχείων**

Προς εκπλήρωση της υποχρέωσης παροχής στατιστικών στοιχείων που επιβάλλει η Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα (ΕΚΤ), οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να εφαρμόζουν τα ακόλουθα ελάχιστα πρότυπα:

## 1. Ελάχιστα πρότυπα διαβίβασης:

- i) η παροχή στοιχείων πρέπει να πραγματοποιείται έγκαιρα και εντός των προθεσμιών που τάσσουν η ΕΚΤ και η οικεία εθνική κεντρική τράπεζα (ΕθνΚΤ).
- ii) οι στατιστικές εκθέσεις πρέπει να λαμβάνουν τη μορφή και τον μορφότυπο που προβλέπονται βάσει των τεχνικών προϋποθέσεων παροχής στοιχείων που καθορίζουν η ΕΚΤ και η οικεία ΕθνΚΤ.
- iii) η μονάδα παροχής στοιχείων πρέπει να παρέχει στην ΕΚΤ και την οικεία ΕθνΚΤ λεπτομερή στοιχεία ενός ή περισσότερων υπευθύνων επικοινωνίας.
- iv) πρέπει να τηρούνται οι τεχνικές προδιαγραφές διαβίβασης στοιχείων στην ΕΚΤ και την οικεία ΕθνΚΤ.

## 2. Ελάχιστα πρότυπα ακριβείας:

- i) τα στατιστικά στοιχεία πρέπει να είναι ακριβή.
- ii) οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να είναι σε θέση να παρέχουν στοιχεία σχετικά με τις εξελίξεις που υποδηλώνουν τα διαβιβαζόμενα στοιχεία.
- iii) τα στατιστικά στοιχεία πρέπει να είναι πλήρη και να μην περιέχουν συνεχή και διαρθρωτικά κενά: τυχόν κενά πρέπει να επισημαίνονται, να αιτιολογούνται στην ΕΚΤ και την οικεία ΕθνΚΤ και κατά περίπτωση να καλύπτονται το συντομότερο δυνατόν.
- iv) οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να τηρούν τις διαστάσεις, την πολιτική στρογγυλοποίησης και το σύστημα δεκαδικών ψηφίων που καθορίζουν η ΕΚΤ και η οικεία ΕθνΚΤ για την τεχνική διαβίβαση των στοιχείων.

## 3. Ελάχιστα πρότυπα εννοιολογικής συμβατότητας:

- i) τα στατιστικά στοιχεία πρέπει να συνάδουν με τους ορισμούς και τις ταξινομήσεις του παρόντος κανονισμού.
- ii) σε περίπτωση αποκλίσεων από τους εν λόγω ορισμούς και ταξινομήσεις οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να παρακολουθούν και να εκφράζουν ποσοτικά τη διαφορά μεταξύ του χρησιμοποιηθέντος μέτρου και του μέτρου που προβλέπεται στον παρόντα κανονισμό σε τακτική βάση.
- iii) οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να είναι σε θέση να αιτιολογούν τυχόν αναντιστοιχίες μεταξύ των διαβιβαζόμενων στοιχείων και των στοιχείων προηγούμενων περιόδων.

## 4. Ελάχιστα πρότυπα αναθεωρήσεων:

Πρέπει να τηρούνται η πολιτική και οι διαδικασίες αναθεωρήσεων που καθορίζουν η ΕΚΤ και η οικεία ΕθνΚΤ. Αναθεωρήσεις που αποκλίνουν από τις συνήθειες πρέπει να συνοδεύονται από επεξηγηματικά σημειώματα.

## 5. Ελάχιστα πρότυπα ακεραιότητας των στοιχείων:

- i) οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να καταρτίζουν και να διαβιβάζουν τα στατιστικά στοιχεία κατά τρόπο αμερόληπτο και αντικειμενικό.
- ii) οι μονάδες παροχής στοιχείων πρέπει να διορθώνουν και να γνωστοποιούν στην ΕΚΤ και στην οικεία ΕθνΚΤ το συντομότερο δυνατό τυχόν λάθη σε ήδη διαβιβασθέντα στοιχεία.».