

**EUROOPA KESKPANGA MÄÄRUS (EL) 2015/1599,****10. september 2015,****millega muudetakse määrust (EL) nr 1333/2014 rahaturgude statistika kohta (EKP/2015/30)**

EUROOPA KESKPANGA NÕUKOGU,

võttes arvesse Euroopa Keskpankade Süsteemi ja Euroopa Keskpanga põhikirja, eelkõige selle artiklit 5,

võttes arvesse nõukogu 23. novembri 1998. aasta määrust (EÜ) nr 2533/98 statistilise teabe kogumise kohta Euroopa Keskpanga poolt, <sup>(1)</sup> eelkõige selle artikli 5 lõiget 1 ja artikli 6 lõiget 4,

ning arvestades järgmist:

- (1) Euroopa Keskpanga määrus (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) <sup>(2)</sup> nõuab andmeesitajatelt statistiliste andmete esitamist selleks, et Euroopa Keskpankade Süsteem saaks oma ülesannete täitmiseks koostada rahaturutehingute statistikat.
- (2) Riikide keskpankade jaoks koostatakse aruandlusjuhised, milles sätestatakse täpsed parameetrid statistilise teabe esitamiseks määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) alusel. Kuna aruandlusjuhistes täpsustatakse mitmeid nimetatud määruses määratletud olulisi mõisteid, peaks määrus kajastama ka asjaomaseid muudatusi.
- (3) Seetõttu tuleb määrust (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) vastavalt muuta,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA MÄÄRUSE:

*Artikkel 1***Muudatused**

1. Määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) I lisa asendatakse käesoleva määruse I lisaga.
2. Määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) II ja III lisa muudetakse kooskõlas käesoleva määruse II lisaga.

*Artikkel 2***Lõppsätted**Käesolev määrus jõustub kahekümnendal päeval pärast selle avaldamist *Euroopa Liidu Teatajas*.

Käesolev määrus on tervikuna siduv ja liikmesriikides vahetult kohaldatav kooskõlas aluslepingutega.

Frankfurt Maini ääres, 10. september 2015

*EKP nõukogu nimel**EKP president*

Mario DRAGHI

<sup>(1)</sup> EÜTL 318, 27.11.1998, lk 8.<sup>(2)</sup> Euroopa Keskpanga 26. novembri 2014. aasta määrus (EL) nr 1333/2014 rahaturgude statistika kohta (EKP/2014/48) (ELT L 359, 16.12.2014, lk 97).

I LISA

„I LISA

**Tagatud tehingutega seotud rahaturgude statistika aruandlusvorm**

1. OSA

**INSTRUMENDILIIK**

Andmeesitajad teatavad Euroopa Kesk pangale (EKP) või asjaomasele riigi keskpangale (RKP) kõik tagasiostulepingud ning nende alusel sõlmitud ja eurodes vääringustatud üheaastase või lühema tähtajaga (määratluse kohaselt arvelduskuupäevast arvates kuni 397-päevase tähtajaga) repotehingud, sealhulgas kolmepoolsed repotehingud, mis andmeesitaja on sõlminud teiste rahaloomeasutustega, muude finantsvahendustevõtete (OFId), kindlustusseltsidega, pensionifondidega, valitsemissektoriga või keskpankadega investeerimise eesmärgil või mittefinantsetevõtete, mis on liigitatud Basel III LCR raamistiku kohaselt „hulgiettevõteteks”.

2. OSA

**ANDMETE LIIGID****1. Iga tehingu kohta esitatavate tehingupõhiste andmete <sup>(1)</sup> liigid**

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Transaction identifier (tehingutunnus)	Sisemine kordumatu tehingutunnus, mida andmeesitaja iga tehingu kohta kasutab.	Igal vastaval aruandepäeval mis tahes rahaturusegmendi kohta teatatud tehingul on kordumatu tehingutunnus.
Reporting date (aruandepäev)	Kuupäev, mil andmed EKP-le või RKP-le esitatakse.	
Electronic time stamp (ajastempel)	Tehingu sõlmimise või registreerimise kellaaeg.	
Counterparty code (vastaspoole kood)	Tunnuskood, mida kasutatakse selleks, et tuvastada andmeesitaja vastaspool teatavas tehingus.	Kui tehingud on sooritatud keskse vastaspoole (CCP) kaudu, tuleb esitada keskse vastaspoole juriidilise isiku tunnus (LEI).  Tehingute kohta, mis on sooritatud mittefinantsetevõtete, OFIdega, kindlustusseltsidega, pensionifondidega, valitsemissektoriga ja keskpankadega, ning kõikide muude teatatud tehingute kohta, mille suhtes vastaspoole juriidilise isiku tunnust ei esitata, tuleb näidata vastaspoole liik.
Counterparty code ID (vastaspoole koodi tunnus)	Tunnus, mis näitab teatatud vastaspoole koodi liiki.	Kasutada igal juhul. Esitatakse individuaalne vastaspoole kood.

<sup>(1)</sup> Elektroonilised aruandlusstandardid ja andmete tehnilised spetsifikaadid avaldatakse eraldi. Need on avaldatud EKP veebilehel [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Counterparty location (vastaspoole asukoht)	Rahvusvahelise Standardiorganisatsiooni (ISO) riigikood, mis tähistab vastaspoole asukohariiki.	Kohustuslik, kui individuaalset vastaspoole koodi ei esitata. Muudel juhtudel ei ole kohustuslik.
Transaction nominal amount (tehingu nominaalsumma)	Algselt laenuks võetud või antud summa.	
Collateral nominal amount (tagatise nimiväärtus)	Antud tagatise nimiväärtus.	Välja arvatud kolmepoolsete repotehingute jm tehingute puhul, kus antud tagatist ei näidata rahvusvahelise väärtpaperite identifitseerimisnumbri (ISIN-koodi) abil.
Trade date (tehingupäev)	Kuupäev, mil pooled finantstehingu sõlmivad.	
Settlement date (arvelduskuupäev)	Ostukuupäev, st kuupäev, mil laenuandja peab laenuvõtjale raha ja laenuvõtja laenuandjale tagatise üle andma.	Avatud tagasiostutehingute puhul on selleks kuupäev, mil selgub, et tehingut edasi ei asendata (isegi kui raha üle ei anta).
Maturity date (tähtpäev)	Tagasiostukuupäev, st kuupäev, mil laenuvõtja peab laenuandjale raha tagasi maksuma.	Avatud tagasiostutehingute puhul on selleks kuupäev, mil tuleb tagasi maksta võlgnetav põhisumma ja intress, kui tehingut edasi ei asendata.
Transaction sign (tehingu märk)	Repotehingu korral raha laenuks võtmine ja pöördrepotehingu korral raha laenuks andmine.	
ISIN of the collateral (tagatise ISIN-kood)	Finantsturgudel emiteeritud väärtpaperitele määratud ISIN-kood, mis koosneb 12 tärgist ja võimaldab väärtpaperi eksimatult tuvastada (vastavalt ISO 6166 standardile).	Näidata, välja arvatud teatud tagatise liikide puhul.
Collateral type (tagatise liik)	Selleks, et tuvastada tagatiseks antud vara liik, kui individuaalne ISIN-kood puudub.	Näidata kõikidel juhtudel, mil individuaalset ISIN-koodi ei esitata.
Collateral issuer sector (tagatise emitendi sektor)	Selleks, et tuvastada tagatise emitendi sektor, kui individuaalne ISIN-kood puudub.	Näidata, kui individuaalset ISIN-koodi ei esitata.
Special collateral flag (eritagatise tähis)	Selleks, et tuvastada kõik üldtagatise vastu sõlmitud repotehingud ja eritagatise vastu sõlmitud repotehingud. Vabatahtlik väli, mis täidetakse üksnes siis, kui andmeesitajal on võimalik seda teha.	Selle välja täitmine ei ole kohustuslik.

Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Deal rate (teingu intressimäär)	Rahaturu meetodil ACT/360 väljendatud intressimäär, millega repotehing sõlmiti ja millega laenuks antud rahasumma tagasi makstakse.	
Collateral haircut (tagatise väärtuskärbe)	Riskiohjemeede, mille kohaselt arvestatakse tagatise väärtus vastava vara turuväärtusest teatava protsentuaalse osa (ehk väärtuskärbe) võrra väiksemaks. Aruandluses arvutatakse väärtuskärbe nii, et laenuks antud/võetud raha ja antud tagatise turuväärtuse, sealhulgas kogunenud intressi omavaheline suhe lahutatakse 100st.	Selle välja täitmine on nõutav üksnes üheainsa tagatisega tehingute korral.
Counterparty code of the tri-party agent (kolmepoolse agendi vastaspoolekood)	Kolmepoolse agendi vastaspoolekood.	Näidata kolmepoolsete repotehingute korral.
Tri-party agent code ID (kolmepoolse agendi vastaspoolekoodi tunnus)	Tunnus, mis näitab esitatud kolmepoolse agendi koodi liiki.	Kasutada igal juhul, kui esitatakse eraldi kolmepoolse agendi kood.

## 2. Olulisuse künnis

Mittefinantsettevõtetega sõlmitud tehingute kohta tuleb aruanne esitada ainult siis, kui need mittefinantsettevõtted on liigitatud Basel III LCR raamistiku kohaselt hulgi-ettevõteteks <sup>(1)</sup>.

## 3. Erandid

Aruandeid ei pea esitama kontsernisestest tehingute kohta.”

<sup>(1)</sup> Vt dokument „Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools”, Baseli pangajärevalve komitee, jaanuar 2013, lk 23–27, avaldatud Rahvusvaheliste Arvelduste Panga veebilehel [www.bis.org](http://www.bis.org).

## II LISA

Määruse (EL) nr 1333/2014 (EKP/2014/48) II ja III lisa muudetakse järgmiselt.

1. II lisa 1. osa asendatakse järgmisega:

„1. OSA

## INSTRUMENTIDE LIIGID

1. Andmeesitajad teavad Euroopa Keskpangale (EKP) või asjaomasele riigi keskpangale (RKP)

- a) kõik järgmises tabelis loetletud instrumente kasutades sõlmitud ja eurodes väeringustatud üheaastase või lühema tähtajaga (määratluse kohaselt arvelduskuupäevast arvates kuni 397-päevase tähtajaga) laenuvõtetehingud, mis andmeesitaja on sõlminud teiste rahaloomeasutustega, muude finantsvahendustevõtete (OFId), kindlustusseltsidega, pensionifondidega, valitsemissektoriga või keskpankadega investeerimise eesmärgil või mittefinantsetevõtete, mis on liigitatud Basel III LCR raamistiku kohaselt „hulgiettevõteteks”;
- b) kõik teiste krediidasutustega sõlmitud üheaastase või lühema tähtajaga (määratluse kohaselt arvelduskuupäevast alates kuni 397-päevase tähtajaga) laenuandmistehingud, mis seisnevad tagamata hoiustes, nõudmiseni hoiustes või selles, et emiteerivatelt krediidasutustelt on ostetud kuni üheaastase tähtajaga kommertspabereid, hoiusertifikaate, ujuva intressimääraga võlakirju või muid võlaväärtpabereid.

2. Järgmises tabelis on standardselt kirjeldatud nende instrumentide liike, millega hõlmatud tehingute kohta on andmeesitajad kohustatud EKP-le aruande esitama. Kui andmeesitajad on kohustatud esitama tehingute kohta aruandeid oma RKP-le, peab see RKP need instrumentide liikide kirjeldused siseriiklikul tasandil vastavalt käesolevale määrusele üle võtma.

Instrumentiliik	Kirjeldus
Deposits (hoiused)	Andmeesitaja poolt (laenuks) võetud või antud tagamata, intresse kandvad hoiused, mis on kas etteteatamisega lõpetatavad või mille tähtaeg ei ületa üht aastat (sealhulgas nõudmiseni kontod, kuid mitte arvelduskontod).
Call accounts (nõudmiseni kontod)	Igapäevaselt muutuva intressimäär, regulaarse intressimakse ja -arvestuse ning etteteatamistähtajaga lõpetavad sularahakontod.
Certificate of deposit (hoiuserertifikaat)	Rahaloomeasutuse emiteeritud tähtajaline võlainstrument, mis annab valdajale õiguse konkreetsele fikseeritud intressimäärale kuni üheaastase fikseeritud tähtajajooksul.
Commercial paper (kommertspaber)	Tagamata või emitendi tagatiseta kuni üheaastase tähtajaga võlainstrument, mis kannab intresse või on diskonteeritud.
Floating rate note (ujuva intressimääraga võlakiri)	Kuni üheaastase tähtajaga võlainstrument, mille puhul perioodilisi intressiväljamakseid arvutatakse väärtuse põhjal, st fikseerides baasmäärat, nagu nt Euribor, ette kindlaks määratud kuupäevadel (fikseerimispäevadel).

Instrumendiliik	Kirjeldus
Other short-term debt securities (muud lühiajalised võlaväärtpaberid)	<p>Andmeesitajate emiteeritud kuni üheaastase tähtajaga allutamata väärtpaberid, v.a omandiväärtpaberid, mis on harilikult vabalt kaubeldavad ja millega kaubeldakse järelturgudel või mis on turul tasaarvestatavad ega anna valdajale omandiõigust väärtpaberi emiteerinud ettevõttes. Siia kuuluvad</p> <p>a) väärtpaberid, mis annavad valdajale tingimusteta õiguse fikseeritud või lepinguliselt kindlaks määratavale tulule, mis seisneb kouponimaksetes ja/või ettenähtud fikseeritud summas, mis makstakse välja kindlal kuupäeval (või kindlatel kuupäevadel) või alates emiteerimise ajal kindlaks määratud kuupäevast;</p> <p>b) andmeesitajate emiteeritud mittekaubeldavad instrumendid, mis muutuvad hiljem vabalt kaubeldavaks ja liigitatakse ümber „võlaväärtpaberiteks”.</p>

2. III lisa 1. osa asendatakse järgmisega:

„1. OSA

#### INSTRUMENTIDE LIIGID

Andmeesitajad teavad Euroopa Keskpangale (EKP) või asjaomasele riigi keskpangale (RKP)

- a) kõik välisvaluuta vahetustehingud, milles eurot ostetakse/müüakse välisvaluuta eest hetkekursiga ning müüakse või ostetakse tulevasel kuupäeval välisvaluuta eest tagasi eelnevalt kokku lepitud üheaastase või lühema tähtajaga (määratluse kohaselt välisvaluuta vahetustehingu selle osa, milles rakendatakse hetkekursi, arvelduskuupäevast arvates kuni 397-päevase tähtajaga) tähtpävakursiga ja mis andmeesitaja on sõlminud teiste rahaloomeasutustega, muude finantsvahendusettevõtetega (OFId), kindlustusseltsidega, pensionifondidega, valitsemissektoriga või keskpankadega investeerimise eesmärgil või mittefinantsettevõtetega, mis on liigitatud Basel III LCR raamistiku kohaselt „hulgiettevõteteks”;
- b) eurodes väeringustatud indeksipõhised üleööintressi-vahetustehingud (OISd), mis andmeesitaja on sõlminud teiste rahaloomeasutustega, OFIdega, kindlustusseltsidega, pensionifondidega, valitsemissektoriga või keskpankadega investeerimise eesmärgil või mittefinantsettevõtetega, mis on liigitatud Basel III LCR raamistiku kohaselt „hulgiettevõteteks”.

3. III lisa 2. osa punkt 1 asendatakse järgmisega:

„Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Transaction identifier (tehingutunnus)	Sisemine kordumatu tehingutunnus, mida andmeesitaja iga tehingu kohta kasutab.	Igal vastaval aruandepäeval mis tahes rahaturusegmendi kohta teatatud tehingul on kordumatu tehingutunnus.
Reporting date (aruandepäev)	Kuupäev, mil andmed EKP-le või RKP-le esitatakse.	
Electronic time stamp (ajastempel)	Tehingu sõlmimise või registreerimise kellaaeg.	

„Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Counterparty code (vastaspoole kood)	Tunnuskood, mida kasutatakse selleks, et tuvastada andmeesitaja vastaspool teatavas tehingus.	Kui tehingud on sooritatud keskse vastaspoole (CCP) kaudu, tuleb esitada keskse vastaspoole juriidilise isiku tunnus (LEI).  Tehingute kohta, mis on sooritatud mittefinantsettevõtetega, OFIdega, kindlustuseltsidega, pensionifondidega, valitsemis-sektoriga ja keskpankadega, ning kõikide muude teatatud tehingute kohta, mille suhtes vastaspoole juriidilise isiku tunnust ei esitata, tuleb näidata vastaspoole liik.
Counterparty code ID (vastaspoole koodi tunnus)	Tunnus, mis näitab teatatud vastaspoole koodi liiki.	Kasutada igal juhul. Esitatakse individuaalne vastaspoole kood.
Counterparty location (vastaspoole asukoht)	Rahvusvahelise Standardiorganisatsiooni (ISO) riigikood, mis tähistab vastaspoole asukohariiki.	Kohustuslik, kui individuaalset vastaspoole koodi ei esitata. Muudel juhtudel ei ole kohustuslik.
Trade date (tehingupäev)	Kuupäev, mil pooled finantstehingu sõlmivad.	
Spot value date (hetkekursi kuupäev)	Kuupäev, mil üks pool müüb teisele poolele teatava summa teatavat valuutat ja teine pool maksab selle eest kokkulepitud summa teatavas teises valuutas vastavalt kokkulepitud vahetuskursile, mida nimetatakse hetkekursiks.	
Maturity date (tähtpäev)	Kuupäev, mil välisvaluuta vahetustehingu tähtaeg lõpeb ja hetkekursi kuupäeval müüdüd valuuta ostetakse tagasi.	
Transaction sign (teingu märk)	Osutab sellele, kas tehingu nominaalsummas näidatud eurod on hetkekursi kuupäeval ostetud või müüdüd.	See peaks viitama hetketehingule euro seisukohast, st sellele, kas hetkekursi kuupäeval osteti või müüdi eurosid.
Transaction nominal amount (teingu nominaalsumma)	Hetkekursi kuupäeval ostetud või müüdüd eurode summa.	
Foreign currency code (välisvaluuta kood)	Eurode eest ostetud/müüdüd välisvaluuta rahvusvaheline kolmekohaline ISO kood.	

„Väli	Andmete kirjeldus	Alternatiivne esitusvõimalus (kui on) jm tingimused
Foreign exchange spot rate (vahetuse hetkekurs)	Vahetuskurs euro ja välisvaluuta vahel selles välisvaluuta vahetustehingu osas, milles rakendatakse hetkekurssi.	
Foreign exchange forward points (tähtpäevakursi erinevus hetkekursist)	Vahetustehingus rakendatava hetkekursi ja tähtpäevakursi vahe baaspunktides väljendatuna valuutapaari suhtes valdavalt kasutatavate turutavade kohaselt.”	