

**VERORDENING (EU) Nr. 1333/2014 VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK****26 november 2014****houdende geldmarktstatistieken****(ECB/2014/48)**

DE RAAD VAN BESTUUR VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK,

Gezien de statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank, inzonderheid artikel 5,

Gezien Verordening (EG) nr. 2533/98 van de Raad van 23 november 1998 met betrekking tot het verzamelen van statistische gegevens door de Europese Centrale Bank <sup>(1)</sup>, inzonderheid artikel 5, lid 1, en artikel 6, lid 4,

Gezien het advies van de Europese Commissie <sup>(2)</sup>,

Overwegende hetgeen volgt:

- (1) Het Europees Stelsel van centrale banken (ESCB) vereist voor de vervulling van zijn taken de productie van statistieken betreffende geldmarkttransacties, namelijk gedekte, ongedekte en bepaalde derivatengeldmarkttransacties, zoals bedoeld in deze verordening, welke worden afgesloten door monetaire-financiële instellingen (MFI's), met uitzondering van centrale banken en geldmarktfondsen, met andere MFI's, en tussen MFI's en overige financiële instellingen, overheid of niet-financiële vennootschappen, met uitzondering van intra-groeptransacties.
- (2) Het verzamelen van die statistieken beoogt voornamelijk te ECB te voorzien van alomvattende, gedetailleerde en geharmoniseerde statistische informatie betreffende geldmarkten in het eurogebied. De verzamelde uit de transacties afgeleide gegevens met betrekking tot de bovengenoemde marktsegmenten omvatten informatie betreffende de doorwerking van monetairebeleidsbeslissingen. Zij zijn derhalve een noodzakelijke reeks statistieken voor monetairebeleidsdoeleinden in het eurogebied.
- (3) Het verzamelen van statistische gegevens is tevens noodzakelijk opdat de ECB analytische en statistische ondersteuning kan verlenen aan het Gemeenschappelijke Toezichtmechanisme (GTM), zulks overeenkomstig Verordening (EU) nr. 1024/2013 van de Raad <sup>(3)</sup>. Binnen dit kader is het verzamelen van statistische gegevens tevens noodzakelijk ter ondersteuning van de ECB-taken op het gebied van financiële stabiliteit.
- (4) Een nationale centrale bank (NCB) moet de ECB ervan in kennis stellen dat zij besluit de uit hoofde van deze verordening te verzamelen gegevens niet zal verzamelen, in welk geval de ECB de gegevensverzameling direct bij de informatieplichtigen zal overnemen.
- (5) Overeenkomstig de Verdragen en onder de in de Statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank (hierna de „ESCB-statuten” neergelegde voorwaarden, stelt de ECB verordeningen op, voor zover deze nodig zijn voor de uitvoering van de ESCB-taken overeenkomstig de ESCB-statuten en in sommige gevallen zoals vastgelegd in de door de Raad aangenomen bepalingen op grond van artikel 129, lid 4, van het Verdrag betreffende de werking van de Europese Unie.
- (6) Om de rapportagelast voor MFI's zo gering mogelijk te houden, en tegelijkertijd de beschikbaarheid van tijdige en hogekwaliteitsstatistieken te waarborgen, zal de ECB aanvankelijk van de grootste eurogebied-MFI's gegevensrapportage verlangen, zulks gebaseerd op de omvang van het totaal aan activa op de hoofdbalans vergeleken met het totaal aan activa op de hoofdbalans voor alle eurogebied-MFI's. Met ingang van 1 januari 2017 kan de Raad van bestuur van de ECB het aantal rapporterende MFI's uitbreiden door ook andere criteria in aanmerking te nemen, zoals de significantie van de werkzaamheden van de MFI in de geldmarkten en haar betekenis voor de stabiliteit en werking van het financiële stelsel. De ECB wil verzekeren dat minstens drie MFI's per lidstaat die de euro als munt heeft (hierna: „eurogebiedlidstaat”) rapporteren, zulks om een minimumniveau van geografische representatie te waarborgen. NCB's kunnen ook gegevens verzamelen van MFI's die geen deel uitmaken van de feitelijke populatie van informatieplichtigen, uitgaande van hun nationale statistische rapportagevoorschriften, in welk geval die gegevens overeenkomstig deze verordening gerapporteerd en geverifieerd zullen worden.

<sup>(1)</sup> PB L 318 van 27.11.1998, blz. 8.

<sup>(2)</sup> Advies van 14 november 2014 (PB C 407 van 15.11.2014, blz. 1).

<sup>(3)</sup> Verordening (EU) nr. 1024/2013 van de Raad van 15 oktober 2013 waarbij aan de Europese Centrale Bank specifieke taken worden opgedragen betreffende het beleid inzake het prudentieel toezicht op kredietinstellingen (PB L 287 van 29.10.2013, blz. 63).

- (7) Om de rapportagelast voor MFI's verder zo gering mogelijk te houden door te vermijden dat zij onderworpen worden aan overlappende rapportagevoorschriften, terwijl tegelijkertijd de beschikbaarheid van tijdige en hoge-kwaliteitsstatistieken gewaarborgd wordt, kan de ECB MFI's vrijstellen van gegevensrapportage inzake effectenfinancieringstransacties of derivatencontracten, indien die gegevens reeds aan een handelsplatform gerapporteerd werden, op voorwaarde dat de ECB daadwerkelijk toegang heeft tot tijdige en gestandaardiseerde gegevens, zulks overeenkomstig de vereisten van deze verordening.
- (8) Artikel 5, lid 1, van Verordening (EG) nr. 2533/98 bepaalt dat de ECB verordeningen kan aannemen voor de vaststelling en het opleggen van haar statistische rapportagevereisten aan de feitelijke populatie van informatieplichtigen van de eurogebiedlidstaten. Artikel 6, lid 4, bepaalt dat de ECB verordeningen mag vaststellen tot nadere bepaling van de voorwaarden volgens welke het recht tot verificatie of de gedwongen verzameling van statistische gegevens mag worden uitgeoefend.
- (9) Artikel 4 van Verordening (EG) nr. 2533/98 bepaalt dat de lidstaten op het gebied van statistische informatie hun eigen organisatie dienen in te richten en volledig met het ESCB dienen samen te werken ter verzekering van de vervulling van de uit artikel 5 van de ESCB-statuten voortvloeiende verplichtingen.
- (10) Voor zover uit hoofde van deze verordening verzamelde gegevens vertrouwelijke statistische informatie bevatten, zijn artikel 8 en artikel 8 ter van Verordening (EG) nr. 2533/98 de toepasselijke normen voor de bescherming en het gebruik van die gegevens.
- (11) Artikel 7, lid 1, van Verordening (EG) nr. 2533/98 bepaalt dat de ECB bevoegd is sancties op te leggen aan informatieplichtigen die niet voldoen aan de in ECB-verordeningen of -besluiten vastgelegde statistische rapportageverplichtingen.
- (12) Door de ECB uit hoofde van artikel 34.1 van de ESCB-statuten vastgestelde verordeningen kennen weliswaar rechten toe noch leggen zij verplichtingen op aan lidstaten die de euro niet als munt hebben (hierna: „niet-eurogebiedlidstaten”), maar artikel 5 van de ESCB-statuten is op eurogebiedlidstaten en niet-eurogebiedlidstaten van toepassing. Verordening (EG) nr. 2533/98 herinnert eraan dat artikel 5 van de ESCB-statuten, samen met artikel 4, lid 3, van het Verdrag voor de niet-eurogebiedlidstaten de verplichting inhoudt om op nationaal niveau alle maatregelen te ontwerpen en toe te passen die zij dienstig achten voor de verzameling van de statistische gegevens die nodig zijn om te voldoen aan de door de ECB opgelegde statistische rapportagevereisten, evenals voor het tijdig treffen van voorbereidingen op het gebied van statistieken, zodat zij eurogebiedlidstaten kunnen worden.
- (13) De rapportagevereisten uit hoofde van deze verordening laten de rapportagevereisten in andere ECB-rechtshandelingen en -instrumenten onverlet die, ten minste gedeeltelijk, tevens transactiegewijze of geaggregeerde rapportage van statistische informatie betreffende geldmarkten kunnen afdekken,

HEEFT DEZE VERORDENING VASTGESTELD:

#### Artikel 1

#### Definities

In deze verordening wordt bedoeld met:

1. „informatieplichtigen”, ingezetene en „ingezeten” hebben dezelfde betekenis als in artikel 1 van Verordening (EG) nr. 2533/98;
2. „monetaire-financiële instelling” (MFI): heeft dezelfde betekenis als in artikel 1 van Verordening (EU) nr. 1071/2013 van de Europese Centrale Bank (ECB/2013/33) <sup>(1)</sup> en omvat alle in de Unie en de EVA gevestigde MFI-bijkantoren, tenzij enige bepaling in deze verordening anders bepaalt;
3. „OFI”: overige financiële intermediairs met uitzondering van verzekeringsinstellingen en pensioenfondsen, zoals bepaald in het herziene Europese systeem van rekeningen (hierna: „ESR-2010”) zoals neergelegd in Verordening (EU) nr. 549/2013 van het Europees Parlement en de Raad <sup>(2)</sup>;

<sup>(1)</sup> Verordening (EU) nr. 1071/2013 van de Europese Centrale Bank van 24 september 2013 met betrekking tot de balans van de sector monetaire financiële instellingen (ECB/2013/33) (PB L 297 van 7.11.2013, blz. 1).

<sup>(2)</sup> Verordening (EU) nr. 549/2013 van het Europees Parlement en de Raad van 21 mei 2013 betreffende het Europees systeem van nationale en regionale rekeningen in de Europese Unie (PB L 174 van 26.6.2013, blz. 1).

4. „verzekeringsinstellingen”: alle financiële instellingen en quasivennootschappen met als hoofdfunctie financiële intermediatie door middel van risicopooling, hoofdzakelijk in de vorm van directe verzekering of herverzekering, zoals bepaald in ESR-2010;
5. „pensioenfondsen”: alle financiële instellingen en quasivennootschappen met als hoofdfunctie financiële intermediatie door middel van het poolen van sociale risico's en behoeften van de verzekerden (sociale verzekering), zoals bepaald in ESR-2010;
6. „niet-financiële vennootschappen”: de sector van niet-financiële vennootschappen, zoals bepaald in ESR-2010;
7. „overheid”: institutionele eenheden die niet-marktproducenten zijn waarvan de output voor individueel of collectief verbruik is bestemd, en die worden gefinancierd uit verplichte betalingen door eenheden die tot andere sectoren behoren, en institutionele eenheden die zich in hoofdzaak bezighouden met de herverdeling van het nationale inkomen en vermogen, zoals bepaald in ESR-2010;
8. „totaal aan activa op de hoofdbalans”: totaal aan activa minus overige activa aangezien deze termen zijn vastgelegd in Verordening (EU) nr. 1071/2013 (ECB/2013/33);
9. „geldmarktstatistieken”: statistieken in verband met statistieken gedekte, ongedekte en derivatentransacties in geldmarktinstrumenten welke worden afgesloten tussen MFI's, en tussen MFI's en OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, centrale banken, overheid en niet-financiële vennootschappen, met uitzondering van intra-groeptransacties in de betrokken rapportageperiode;
10. „geldmarktinstrument”: enige van de in bijlage I, II en III opgesomde instrumenten;
11. „geldmarktfonds”: onderneming voor collectieve belegging die een vergunning benodigt als onderneming voor collectieve belegging in verhandelbare effecten, zulks uit hoofde van Richtlijn 2009/65/EG van het Europees Parlement en Raad <sup>(1)</sup> of is een alternatieve beleggingsinstelling uit hoofde van Richtlijn 2011/61/EU van het Europees Parlement en de Raad <sup>(2)</sup>, belegt in kortetermijnactiva en heeft uiteenlopende of cumulatieve doelstellingen die rendementen genereren in lijn met geldmarkttarieven of houdt de waarde van een belegging in stand;
12. „centrale bank”: een centrale bank ongeacht haar plaats van vestiging;
13. „nationale centrale bank(en)” of NCB(s): de nationale centrale banken van de lidstaten van de Unie;
14. „referentiepopulatie van informatieplichtigen”: in het eurogebied ingezetende MFI's, met uitzondering van centrale banken en geldmarktfondsen die in euro luidende deposito's aanvaarden, en/of enig ander schuldinstrument uitgeven en/of in euro luidende leningen verstrekken zoals bedoeld in bijlage I, II of III, van/aan overige MFI's en/of van/aan OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, de overheid, centrale banken voor beleggingsdoeleinden of niet-financiële vennootschappen;
15. „groep”: een groep van ondernemingen, waaronder een bankgroep maar niet daartoe beperkt, welke groep van ondernemingen bestaat uit een moederonderneming en haar dochterondernemingen waarvan de financiële rekeningen geconsolideerd worden zoals bedoeld in Richtlijn 2013/34/EU van het Europees Parlement en de Raad <sup>(3)</sup>;
16. „bijkantoor”: een bedrijfszetel die een onderdeel zonder juridische zelfstandigheid is van een instelling en die rechtstreeks, geheel of gedeeltelijk de handelingen verricht die eigen zijn aan de werkzaamheden van de instelling;
17. „Unie- en EVA-bijkantoor”: een in een lidstaat van de Unie of in een EVA-land gevestigd en geregistreerd bijkantoor;

<sup>(1)</sup> Richtlijn 2009/65/EG van het Europees Parlement en de Raad van 13 juli 2009 tot coördinatie van de wettelijke en bestuursrechtelijke bepalingen betreffende bepaalde instellingen voor collectieve belegging in effecten (icbe's) (PB L 302 van 17.11.2009, blz. 32).

<sup>(2)</sup> Richtlijn 2011/61/EU van het Europees Parlement en de Raad van 8 juni 2011 inzake beheerders van alternatieve beleggingsinstellingen en tot wijziging van de Richtlijnen 2003/41/EG en 2009/65/EG en van de Verordeningen (EG) nr. 1060/2009 en (EU) nr. 1095/2010 (PB L 174 van 1.7.2011, blz. 1).

<sup>(3)</sup> Richtlijn 2013/34/EU van het Europees Parlement en van de Raad van 26 juni 2013 betreffende de jaarlijkse financiële overzichten, geconsolideerde financiële overzichten en aanverwante verslagen van bepaalde ondernemingsvormen, tot wijziging van Richtlijn 2006/43/EG van het Europees Parlement en de Raad en tot intrekking van Richtlijnen 78/660/EEG en 83/349/EEG van de Raad (PB L 182 van 29.6.2013, blz. 19).

18. „Europese Vrijhandelsassociatie”: de intergouvernementele organisatie die is opgericht om vrijhandel en de economische integratie ten behoeve van haar lidstaten te bevorderen;
19. „intra-groeptransactie”: een transactie in geldmarktinstrumenten die een informatieplichtige heeft afgesloten met een andere onderneming die is opgenomen in dezelfde volledig geconsolideerde financiële rekening. De ondernemingen die partij zijn bij de transactie worden geacht te zijn opgenomen in dezelfde volledig geconsolideerde financiële rekening, indien zij beide:
  - a) zijn opgenomen in een consolidatie overeenkomstig Richtlijn 2013/34/EU of internationale standaarden voor financiële verslaggeving (IFRS), vastgesteld in overeenstemming met Verordening (EG) nr. 1606/2002 van het Europees Parlement en de Raad <sup>(1)</sup> of, in verband met een groep waarvan de moederonderneming haar hoofdkantoor in een derde land heeft, overeenkomstig algemeen aanvaarde boekhoudkundige beginselen van dat derde land die gelden als zijnde equivalent aan IFRS, zulks overeenkomstig Verordening (EG) nr. 1569/2007 van de Commissie <sup>(2)</sup> (dan wel boekhoudkundige standaarden van een derde land die overeenkomstig artikel 4 van die verordening toegepast mogen worden); of
  - b) gedekt worden door hetzelfde geconsolideerde toezicht overeenkomstig Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en de Raad <sup>(3)</sup> dan wel, in verband met een groep waarvan de moederonderneming haar hoofdkantoor in een derde land heeft, hetzelfde geconsolideerde toezicht door een bevoegde autoriteit van een derde land geverifieerd als zijnde equivalent aan het geconsolideerde toezicht dat is onderworpen aan de beginselen van artikel 127 van Richtlijn 2013/36/EU;
20. „werkdag”: ten aanzien van een in een overeenkomst of in een bevestiging vastgelegde datum voor een transactie in een geldmarktinstrument, de dag waarop commerciële banken en deviezenmarkten geopend zijn voor werkzaamheden (waaronder transacties in het betrokken geldmarktinstrument) en betalingen verevenen in dezelfde valuta als de betalingsverplichting die verschuldigd is op of berekend is onder verwijzing naar die datum. Indien het een transactie betreft in een geldmarktinstrument dat is onderworpen aan een standaardkaderovereenkomst opgesteld door de Europese Bankfederatie (EBF), de Loan Market Association (LMA), de International Swaps and Derivatives Association, Inc. (ISDA) of andere leidende Europese of internationale marktverenigingen, wordt daarin opgenomen of bij wijze referentie verwerkte definitie. In verband met de afwikkeling van transacties in een geldmarktinstrument dat wordt afgewikkeld via een aangewezen afwikkelingssysteem betekent werkdag een dag waarop dat afwikkelingssysteem geopend is voor de afwikkeling van een dergelijke transactie;
21. „Target2-afwikkelingsdag”: elke dag waarop Target2 (the trans-European Automated Real-time Gross settlement Express Transfer system) is geopend;
22. „repo-overeenkomst”: een overeenkomst krachtens welke de partijen overeenkomsten kunnen afsluiten waarbij een partij („verkoper”) verklaart de andere partij („koper”) specifieke „activa” („effecten”, „grondstoffen” of „overige financiële activa”) binnenkort te verkopen waarbij de koper aan de verkoper de aankoopprijs betaalt, en waarbij tegelijkertijd wordt overeengekomen dat de koper aan de verkoper op een vaste toekomstige datum de activa zal weder verkopen, dan wel op verzoek de verkoper de wederkoopprijs aan de koper betaalt. Dergelijke transacties kunnen een repotransactie zijn of een koop- en wederkooptransactie. „Repo-overeenkomst”: kan tevens een overeenkomst zijn voor het in onderpand geven van activa en het toekennen van een algemeen recht van hergebruik in ruil voor een binnenkort te verstrekken lening van contant geld en rente op langere termijn in ruil voor teruggave van de activa. Repotransacties kunnen uitgevoerd worden met een vooraf bepaalde vervaldatum („termijnrepotransacties”), dan wel zonder een vooraf bepaalde vervaldatum waarbij de partijen elke dag hetzij de overeenkomst kunnen continueren of beëindigen („openbasisrepotransacties”);
23. „driepartijenrepo”: een repotransactie waarbij een derde gedurende de looptijd van de transactie verantwoordelijk is voor de selectie en het beheer van het onderpand;
24. „deviezenswap”: een swaptransactie waarbij een partij aan de andere partij een bepaald bedrag van een specifieke valuta verkoopt tegen betaling van een overeengekomen bedrag van een andere valuta op basis van een overeengekomen wisselkoers (ook wel contantewisselkoers) met een overeenkomst om de verkochte valuta op een bepaalde datum (ook wel de vervaldatum) terug te kopen waar tegenover de verkoop staat van de aanvankelijk aangekochte valuta tegen een andere wisselkoers (ook wel de termijnwisselkoers);

<sup>(1)</sup> Verordening (EG) nr. 1606/2002 van het Europees Parlement en de Raad van 19 juli 2002 betreffende de toepassing van internationale standaarden voor jaarrekeningen (PB L 243 van 11.9.2002, blz. 1).

<sup>(2)</sup> Verordening (EG) nr. 1569/2007 van de Commissie van 21 december 2007 waarbij ter uitvoering van de Richtlijnen 2003/71/EG en 2004/109/EG van het Europees Parlement en de Raad een mechanisme wordt opgezet voor het nemen van een besluit over de gelijkwaardigheid van standaarden voor jaarrekeningen die door effectenuitgevende instellingen van derde landen worden toegepast (PB L 340 van 22.12.2007, blz. 66).

<sup>(3)</sup> Richtlijn 2013/36/EU van het Europees Parlement en van de Raad van 26 juni 2013 betreffende toegang tot het bedrijf van kredietinstellingen en het prudentieel toezicht op kredietinstellingen en beleggingsondernemingen, tot wijziging van Richtlijn 2002/87/EG en tot intrekking van de Richtlijnen 2006/48/EG en 2006/49/EG (PB L 176 van 27.6.2013, blz. 338).

25. „overnight index swap” (OIS): de renteswap waarvan de periodieke variabele rentevoet gedurende een specifieke periode gelijk is aan het geometrische gemiddelde van een daggeldrente (of een daggeldindexrente). De finale betaling wordt berekend als het verschil tussen de vaste rentevoet en de opgebouwde gedurende de looptijd van de OIS geregistreerde daggeldrente toegepast op het nominale transactiebedrag. Aangezien deze verordening slechts in euro luidende OIS betreft, is de daggeldrente gelijk aan de EONIA;
26. „Bazel III LCR-kader”(„Basel III LCR Framework”): liquiditeitsdekkingsratio (LCR), voorgesteld door het Bazels Comité en goedgekeurd op 7 januari 2013 door de Groep van gouverneurs en de Hoofden van toezicht, het oversightlichaam van het Bazelse Comité voor banktoezicht, als minimale wereldwijde reguleringsnorm voor kortetermijnliquiditeitsmaatregelen in de bancaire sector.

## Artikel 2

### Feitelijke populatie van informatieplichtigen

1. De feitelijke populatie van informatieplichtigen bestaat uit in het eurogebied ingezeten MFI's uit de referentiepopulatie van informatieplichtigen, die de Raad van bestuur heeft aangewezen als informatieplichtigen krachtens lid 2 of 3, al naargelang het geval, dan wel uit MFI's aangewezen als informatieplichtigen krachtens lid 4 op basis van de daarin opgenomen criteria, en die in kennis zijn gesteld van hun rapportageverplichtingen krachtens lid 5 (hierna „informatieplichtigen”).

2. Op de inwerkingtredingsdatum van deze verordening kan de Raad van bestuur besluiten dat een MFI een informatieplichtige is, indien de MFI een totaal aan activa op de hoofdbalans heeft dat groter is dan 0,35 % van het totaal aan activa op de hoofdbalans van alle eurogebied-MFI's op basis van de meest recente voor de ECB beschikbare gegevens, d. w.z.:

- a) gegevens die betrekking hebben op eind december van het aan de kennisgeving krachtens lid 5 voorafgaande kalenderjaar; of
- b) indien de gegevens onder a) niet beschikbaar zijn, gegevens die betrekking hebben op eind december van het jaar ervoor.

Binnen het kader van deze besluit omvat de berekening van het totaal van balansactiva van de betrokken MFI niet de bijkantoren buiten het gastland van de betrokken MFI.

3. Met ingang van 1 januari 2017 kan de Raad van bestuur besluiten enige andere MFI in te delen als informatieplichtige op basis van de omvang van haar totaal aan activa op de hoofdbalans in vergelijking met het totaal aan activa op de hoofdbalans van alle eurogebied-MFI's, de significantie van de MFI-transacties in het verhandelen van geldmarktinstrumenten en haar betekenis voor de stabiliteit en werking van het financiële stelsel in het eurogebied en/of individuele lidstaten.

4. Met ingang van 1 januari 2017 kan de Raad van bestuur tevens besluiten dat minstens drie MFI's per eurogebiedlidstaat worden aangewezen als informatieplichtige. Dienovereenkomstig, indien op basis van de door de Raad van bestuur uit hoofde van lid 2 of 3 genomen beslissingen in een bepaalde eurogebiedlidstaat minder dan drie MFI's geselecteerd, omvat de feitelijke populatie van informatieplichtigen tevens andere MFI's uit die eurogebiedlidstaat die de betrokken NCB representatief acht (hierna „representatieve informatieplichtigen”), zodat voor die eurogebiedlidstaat minstens drie informatieplichtigen als informatieplichtigen worden aangewezen.

De representatieve informatieplichtigen worden geselecteerd uit de grootste kredietinstellingen die in de betrokken eurogebiedlidstaat ingezeten zijn, zulks op basis van het totaal aan activa op de hoofdbalans van de instellingen, tenzij de NCB's alternatieve criteria voorstellen, die met de ECB schriftelijk overeengekomen zijn.

5. De ECB of de betrokken NCB stelt de betrokken MFI's in kennis van de door de Raad van bestuur uit hoofde van lid 2, 3 of 4 genomen besluiten en van hun verplichtingen uit hoofde van deze verordening. De in kennisstelling wordt minstens vier maanden voor het begin van de eerste rapportage schriftelijk verstuurd.

6. Niettegenstaande uit hoofde van lid 2, 3 of 4 door de Raad van bestuur genomen besluiten, kunnen NCB's ook bij in hun lidstaat ingezeten MFI's die geen informatieplichtigen zijn zoals bedoeld in lid 2, 3 of 4 tevens geldmarktstatistieken verzamelen, zulks gebaseerd op hun nationale statistische rapportagevoorschriften (hierna „aanvullende informatieplichtigen”). Indien een NCB aldus aanvullende informatieplichtigen vaststelt, stelt zij deze daarvan onverwijld in kennis.

## Artikel 3

### Statistische rapportageverplichtingen

1. Ten behoeve van de regelmatige productie van geldmarktstatistieken rapporteren informatieplichtigen aan de NCB van de lidstaat waarin zij ingezeten zijn op een geconsolideerde basis, waaronder voor al hun in de Unie en de EVA gevestigde bijkantoren, dagelijkse statistische gegevens in verband met geldmarktinstrumenten. De vereiste statistische informatie is gespecificeerd in bijlage I, II en III bij deze verordening. De NCB stuurt de van de informatieplichtigen ontvangen statistische gegevens naar de ECB, zulks overeenkomstig artikel 4, lid 2, van deze verordening.

2. De NCB's definiëren de in verband met geldmarktinstrumenten door de informatieplichtigen te volgen rapportage-regelingen, en voeren deze uit. Deze rapportageregelingen verzekeren dat de vereiste statistische gegevens verstrekt worden en maken een nauwkeurige controle mogelijk van de naleving van de minimumnormen voor transmissie, nauwkeurigheid, conceptuele naleving en herzieningen zoals vastgelegd in bijlage IV.
3. Niettegenstaande het in lid 1 vastgelegde rapportagevoorschrift kan een NCB besluiten dat de in de lidstaat van de NCB ingezet en uit hoofde van artikel 2, lid 2, 3 en 4, geselecteerde informatieplichtigen de in bijlage I, II, III bedoelde gegevens aan de ECB rapporteren. De NCB stelt de ECB en de informatieplichtigen dienovereenkomstig in kennis, waarna de ECB de door de informatieplichtigen te volgen rapportageregelingen definiëren, en deze toepassen en de gegevensverzameling direct bij de informatieplichtigen ter hand neemt.
4. Indien een NCB aanvullende informatieplichtigen heeft geselecteerd en hen zoals bedoeld in artikel 2, lid 6, in kennis heeft gesteld, rapporteren deze informatieplichtigen dagelijkse met geldmarktinstrumenten verband houdende gegevens aan de NCB. De NCB stuurt de van de aanvullende informatieplichtigen ontvangen statistische gegevens op verzoek van de ECB naar de ECB, zulks overeenkomstig artikel 4, lid 2, van deze verordening.
5. De NCB's definiëren overeenkomstig hun nationale statistische rapportagevoorschriften de door de aanvullende informatieplichtigen te volgen rapportageregelingen, en passen deze toe. De NCB's waarborgen dat de nationale rapportageregelingen vergen dat aanvullende informatieplichtigen voldoen aan voorschriften die equivalent zijn aan de artikelen 6 tot en met 8, artikel 10, lid 3, artikelen 11 en 12, van deze verordening. De NCB's verzekeren dat deze rapportageprocedures de vereiste statistische gegevens opleveren en een nauwkeurige controle mogelijk maken van de naleving van de minimumnormen voor transmissie, nauwkeurigheid, conceptuele naleving en herzieningen zoals vastgelegd in bijlage IV.

#### Artikel 4

#### Tijdigheid

1. Indien een NCB overeenkomstig artikel 3, lid 3, besluit dat informatieplichtigen de in bijlage I, II en III bedoelde gegevens direct aan de ECB rapporteren, sturen die informatieplichtigen die gegevens als volgt naar de ECB.
  - a) Overeenkomstig artikel 2, lid 2, worden bij informatieplichtigen verzamelde gegevens eenmaal per dag naar de ECB gestuurd tussen 6 p.m. op de transactiedatum en 7 a.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na de transactiedatum.
  - b) Overeenkomstig artikel 2, lid 3 en 4, worden bij informatieplichtigen verzamelde gegevens eenmaal per dag naar de ECB gestuurd tussen 6 p.m. op de transactiedatum en 1 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na de transactiedatum.
  - c) Gegevens waarvoor de NCB uit hoofde van artikel 5 een vrijstelling heeft, worden eenmaal per week aan de ECB gestuurd tussen 6 p.m. op de transactiedatum en 1 pm CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na afloop van de week waarop de gegevens betrekking hebben.
2. In andere gevallen dan in lid 1, sturen de NCB's de ECB als volgt de van de informatieplichtigen ontvangen in bijlage I, II en III bedoelde dagelijkse statistische geldmarktgegevens.
  - a) Voor 7 a.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na de transactiedatum worden overeenkomstig artikel 2, lid 2, bij informatieplichtigen verzamelde gegevens eenmaal per dag naar de ECB gestuurd.
  - b) Voor 1 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na de transactiedatum worden overeenkomstig artikel 2, lid 3 en 4, bij informatieplichtigen verzamelde gegevens eenmaal per dag naar de ECB gestuurd.
  - c) Gegevens die bij overeenkomstig artikel 2, lid 6, geselecteerde aanvullende informatieplichtigen zijn verzameld, worden eenmaal per dag naar de ECB gestuurd voor 1 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na de transactiedatum, eenmaal per week voor 1 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na afloop van de week waarop de gegevens betrekking hebben, of eenmaal per maand voor 1 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na afloop van de maand waarop de gegevens betrekking hebben. De NCB's stellen de rapportagefrequentie vast en stellen de ECB daar onverwijld van in kennis. De NCB's kunnen de rapportagefrequentie jaarlijks herzien.
  - d) Gegevens waarvoor de NCB uit hoofde van artikel 5 een vrijstelling heeft worden eenmaal per week aan de ECB gestuurd voor 1 pm CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na afloop van de week waarop de gegevens betrekking hebben.
3. De NCB's besluiten wanneer zij de gegevens van de informatieplichtigen moeten ontvangen om te kunnen voldoen aan de uiterste rapportagertermijnen van lid 2 en stellen de informatieplichtigen daarvan overeenkomstig in kennis.

4. Indien een in lid 2 bedoelde uiterste termijn op een dag valt dat Target2 gesloten is, wordt de uiterste termijn verlengd tot de volgende Target2-werkdag, zoals vermeld op de ECB-website.

#### Artikel 5

#### Vrijstelling

Indien informatieplichtigen overeenkomstig artikel 2, lid 3 of 4, geselecteerd zijn, kan een NCB besluiten dat de informatieplichtigen eenmaal per week de NCB dagelijkse geldmarktstatistieken kunnen sturen, zulks voor 1 p.m. CET op de eerste Target2-afwikkelingsdag na het einde van de week waarop de gegevens betrekking hebben, indien zij om operationele redenen niet kunnen voldoen aan het vereiste van dagelijkse rapportage. De ECB kan voorwaarden verbinden aan de toepassing van de vrijstelling door NCB's.

#### Artikel 6

#### Fusies, splitsingen, reorganisaties en faillissementen

1. In geval van een fusie, een splitsing, een verzelfstandiging of een andere reorganisatie die van invloed kan zijn op de naleving van statistische verplichtingen, stelt de betreffende informatieplichtige, zodra het voornemen tot het uitvoeren van een dergelijke operatie openbaar geworden is en tijdig voor de effectuering ervan, de betreffende NCB in kennis van de voorgenomen procedures ter nakoming van de in deze verordening neergelegde statistische rapportageverplichtingen. De informatieplichtige stelt de ECB en de betrokken NCB van een dergelijke operatie in kennis, en wel 14 dagen na de voltooiing ervan.
2. Indien een informatieplichtige door middel van overname fuseert met een andere entiteit, zoals bedoeld in de Richtlijn 2011/35/EU van het Europees Parlement en de Raad <sup>(1)</sup> en een van de fuserende entiteiten een informatieplichtige was, rapporteert de gefuseerde entiteit uit hoofde van deze verordening verder.
3. Indien een informatieplichtige fuseert met een andere entiteit door middel van oprichting van een nieuwe onderneming, zoals bedoeld in Richtlijn 2011/35/EU en een van de fuserende entiteiten een informatieplichtige was, rapporteert de resulterende entiteit uit hoofde van deze verordening verder, indien zij voldoet aan de definitie van informatieplichtige.
4. Indien een informatieplichtige wordt opgesplitst in twee of meer entiteiten, zulks door middel van overname of door oprichting van nieuwe ondernemingen zoals bedoeld in de Zesde Richtlijn 82/891/EEG van de Raad <sup>(2)</sup> en een van de nieuwe entiteiten een informatieplichtige is, rapporteert de nieuwe entiteit uit hoofde van deze verordening. Splitsing omvat tevens een verzelfstandigingsoperatie die inhoudt dat een informatieplichtige alle activa en passiva, of een deel daarvan, overdraagt aan een nieuwe onderneming in ruil voor aandelen in de nieuwe onderneming.
5. Indien een informatieplichtige in staat van insolventie raakt, haar bankvergunning verliest of anderszins haar bankactiviteiten staakt, zoals de bevoegde toezichthouder bevestigt, is zij niet langer gehouden uit hoofde van deze verordening te rapporteren.
6. Binnen het kader van lid 5 wordt een informatieplichtige insolvent geacht indien zich een of meer van de volgende situaties voordoen:
  - a) indien de informatieplichtige ten behoeve van schuldeisers een algemeen pandrecht vestigt, dan wel zulks doet met het oog op een sanering, regeling of een gerechtelijk akkoord met schuldeisers;
  - b) de informatieplichtige schriftelijk te kennen geeft dat zij op de vervalddag niet in staat is haar schulden te betalen;
  - c) de informatieplichtige een verzoek indient voor de aanstelling van een trustee bewindvoerder, curator, vereffenaar of een vergelijkbare functionaris, dan wel daarmee instemt of stilzwijgend goedkeurt, ten aanzien van zichzelf of al haar eigendommen of een aanzienlijk deel daarvan;
  - d) de aangifte tot faillietverklaring bij een rechtbank of de indiening van een verzoek tot faillietverklaring ten aanzien van de informatieplichtige (niet door een wederpartij ten aanzien van verplichtingen van de informatieplichtige aan die wederpartij) bij een ander bevoegd lichaam of een andere bevoegde instantie;
  - e) een informatieplichtige wordt geliquideerd of wordt insolvent (dan wel zijn andere analoge procedures op de informatieplichtige van toepassing), de informatieplichtige of enige overheidsinstantie, entiteit of persoon dient een verzoek in voor sanering, regeling, gerechtelijk akkoord, vrijwillig akkoord, bewindvoering, liquidatie, ontbinding of vergelijkbare maatregel uit hoofde van een vigerende of toekomstige wet, wettelijke of bestuursrechtelijke bepaling, welke aanvraag niet binnen 30 dagen na indiening ervan geschorst noch afgewezen werd (behalve in geval van een aanvraag tot liquidatie of een analoge procedure, waarvoor geen 30-dagen termijn geldt);

<sup>(1)</sup> Richtlijn 2011/35/EU van de Raad van 5 april 2011 betreffende fusies van naamloze vennootschappen (PB L 110 van 29.4.2011, blz. 1).

<sup>(2)</sup> Derde Richtlijn 82/891/EEG van de Raad van 17 december 1982 op de grondslag van artikel 54, lid 3, onder g), van het Verdrag betreffende splitsingen van naamloze vennootschappen (PB L 378 van 31.12.1982, blz. 47).

- f) de aanstelling van een trustee, bewindvoerder, curator, vereffenaar of een vergelijkbare functionaris ten aanzien van zichzelf of al haar eigendommen of een aanzienlijk deel daarvan; dan wel
- g) het bijeenroepen van een vergadering van schuldeisers van de informatieplichtige ter bespreking van een vrijwillig akkoord (of analoge procedure).

#### Artikel 7

### Vertrouwelijkheidsbepalingen

1. Op de ontvangst en verwerking van gegevens met vertrouwelijke informatie uit hoofde van deze verordening, waaronder het delen van die informatie met andere eurogebied-NCB's, passen de ECB en NCB's de normen toe voor de bescherming en het gebruik van vertrouwelijke statistische informatie, zoals bepaald in artikel 8 en 8 ter van Verordening (EG) nr. 2533/98.
2. Behoudens lid 1 wordt vertrouwelijke informatie in door de ECB of een NCB uit hoofde van deze verordening verzamelde statistische gegevens niet verstuurd naar of anderszins gedeeld met enige autoriteit of derde, met uitzondering van de ECB en de eurogebied-NCB's, tenzij de betrokken informatieplichtige de ECB of de betrokken NCB vooraf uitdrukkelijke toestemming heeft verleend en de ECB, of de betrokken NCB, indien toepasselijk, met die informatieplichtige een passende vertrouwelijkheidsovereenkomst heeft ondertekend.

#### Artikel 8

### Verificatie en gedwongen verzameling

De ECB en de NCB's, al naar gelang het geval, hebben het recht tot verificatie en, indien noodzakelijk, gedwongen verzameling van de gegevens die door informatieplichtigen verstrekken overeenkomstig de statistische rapportageverplichtingen van artikel 3 van en de bijlagen I, II en III bij deze verordening. Dit recht kan met name uitgeoefend worden wanneer een informatieplichtige niet voldoet aan de minimumnormen voor transmissie, nauwkeurigheid, conceptuele naleving en herzieningen, zoals omschreven in bijlage IV. Artikel 6 van Verordening (EG) nr. 2533/98 is eveneens van toepassing.

#### Artikel 9

### Vereenvoudigde wijzigingsprocedure

De directie van de ECB kan, met inachtneming van de standpunten van het Comité statistieken van het ESCB, technische wijzigingen in de bijlagen bij deze verordening doorvoeren, mits dergelijke wijzigingen het onderliggende conceptuele kader niet veranderen en geen effect hebben op de rapportagelast van de informatieplichtigen. De directie stelt de Raad van bestuur onverwijld in kennis van dergelijke wijzigingen.

#### Artikel 10

### Eerste rapportage

1. In geval van uit hoofde van artikel 2, lid 2, geselecteerde informatieplichtigen, begint de eerste rapportage uit hoofde van deze verordening met gegevens voor 1 april 2016, zulks behoudens de overgangsbepalingen van artikel 12.
2. In geval van uit hoofde van artikel 2, lid 3 en 4, geselecteerde informatieplichtigen, begint de eerste rapportage uit hoofde van deze verordening op de aan de informatieplichtige overeenkomstig artikel 2, lid 5, door de ECB of de betrokken NCB gecommuniceerde datum, en in geen geval vroeger dan twaalf maanden na de vaststelling van het besluit van de Raad van bestuur krachtens artikel 2, lid 3 of 4.
3. Voorts, indien representatieve informatieplichtigen overeenkomstig artikel 2, lid 4 geselecteerd worden, kan een representatieve informatieplichtige bij de ECB of de betrokken NCB een schriftelijk verzoek indienen voor een tijdelijk uitstel van de eerste rapportagedatum, met vermelding van de redenen voor dat uitstel. Het verzochte uitstel kan voor maximaal zes maanden verleend worden, verlengbaar met nog eens maximaal zes maanden. De ECB of de betrokken NCB kan instemmen met het verlenen van uitstel van de eerste rapportagedatum aan de verzoekende representatieve informatieplichtige, indien de ECB of de betrokken NCB dat uitstel gerechtvaardigd achten. Voorts, indien de representatieve informatieplichtige op de eerste rapportagedatum niet over te rapporteren gegevens beschikt of slechts over gegevens beschikt die de ECB en de NCB niet representatief achten, kan de NCB ermee instemmen de eerste rapportagedatum niet op die informatieplichtigen toe te passen. Die vrijstellingen kan de NCB alleen toekennen in overleg met de ECB, indien zowel de ECB alsook de NCB het verzoek gerechtvaardigd achten en het verzoek de representativiteit van de rapportagesteekproef niet schaadt.



4. In geval van overeenkomstig artikel 2, lid 6, als aanvullende informatieplichtige geselecteerde MFI's begint de eerste rapportage uit hoofde van deze verordening op de overeenkomstig artikel 2, lid 6, door de NCB aan de aanvullende informatieplichtige gecommuniceerde datum.

#### *Artikel 11*

### **Clausule periodieke toetsing**

De ECB toetst de werking van deze verordening twaalf maanden na de eerste rapportage en brengt daarover verslag uit. Overeenkomstig de aanbevelingen in het rapport kan de ECB het aantal informatieplichtigen en/of statistische rapportageverplichtingen verhogen of verlagen. Na deze initiële toetsing zullen regelmatige updates van de feitelijke populatie van informatieplichtigen om het jaar plaatsvinden.

#### *Artikel 12*

### **Overgangsbepalingen**

In de periode 1 april 2016 tot 1 juli 2016 mogen informatieplichtigen aan de ECB of de betrokken NCB geldmarktstatistieken rapporteren voor bepaalde, maar niet alle relevante dagen. De ECB of de betrokken NCB kan de voor rapportage vereiste dagen expliciteren.

#### *Artikel 13*

### **Slotbepalingen**

Deze verordening treedt op 1 januari 2015 in werking.

Deze verordening is verbindend in al haar onderdelen en is rechtstreeks toepasselijk in de lidstaten overeenkomstig de Verdragen.

Gedaan te Frankfurt am Main, 26 november 2014.

*Voor de Raad van bestuur van de ECB*

*De president van de ECB*

Mario DRAGHI

---

## BIJLAGE I

**Rapportageschema voor met gedekte transacties verband houdende geldmarktstatistieken**

## DEEL 1

## TYPE INSTRUMENT

Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB) alle repo-overeenkomsten en transacties uit hoofde van repo-overeenkomsten, waaronder driepartijenrepo's die luiden in euro met een looptijd tot en met één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de transactiedatum) tussen de informatieplichtige en andere monetaire-financiële instellingen (MFI's), overige financiële intermediairs (OFI's), verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid of centrale banken voor beleggingsdoelstellingen, alsook met niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” overeenkomstig het Bazel III LCR-kader.

## DEEL 2

## SOORT GEGEVENS

1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens <sup>(1)</sup> die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactie-identificatiecode	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte interne unieke identificatiecode.	De transactie-identificatiecode is uniek voor iedere op een bepaalde rapportagedatum voor enig geldmarktsegment gerapporteerde transactie.
Rapportagedatum	De datum waarop de gegevens bij de ECB of de NCB ingediend moeten worden.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Wederpartijcode	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	Indien transacties via een clearinginstelling als centrale tegenpartij (CCP) wordt uitgevoerd, moet de identificatiecode van juridische entiteiten (legal entity identifier (LEI)) verstrekt worden.  Indien transacties worden uitgevoerd met niet-financiële vennootschappen, OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid of centrale banken en voor enige andere transactie waarvoor de wederpartij-LEI niet verstrekt wordt, moet de wederpartijklasse verstrekt worden.
ID wederpartijcode	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele wederpartijcode aangeeft.	Moet onder alle omstandigheden gebruikt worden. Een individuele wederpartijcode wordt verstrekt.
Vestigingsplaats wederpartij	International Organisation for Standardisation (ISO) landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de individuele wederpartijcode niet verstrekt wordt. Anders optioneel.
Nominaal transactiebedrag	Het initieel opgenomen of verstrekte bedrag.	

<sup>(1)</sup> De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op [www.ecb.int](http://www.ecb.int)

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Nominaal onderpand-bedrag	Het nominale als onderpand verstrekte zekerhedenbedrag.	Met uitzondering van driepartijenrepo's en enige andere transactie waarin de verstrekte zekerheid niet middels een internationaal identificatienummer voor waardepapieren (international securities identification number) (ISIN) wordt geïdentificeerd.
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de financiële transactie aangaan.	
Afwikkelingsdatum	De aankoopdatum, d.w.z. de datum waarop de geldgever het contante bedrag verschuldigd is aan de geldnemer en het waardepapier door de geldnemer aan de geldgever moet worden overgedragen.	In geval van openbasisrepotransacties is dat de datum waarop de rollover afgewikkeld wordt (zelfs als geen contant geld wordt uitgewisseld).
Vervaldatum	De repodatum, d.w.z. op datum waarop de geldnemer de geldgever het verschuldigde contante bedrag moet terugbetalen.	In geval van openbasisrepotransacties is dat de datum waarop de verschuldigde hoofdsom en interest terugbetaald moeten worden indien de transactie niet langer gecontinueerd wordt.
Transactiesymbool	Opnemen van contant geld in het geval van repo's of verstrekken van contant geld in het geval van repo's met wederverkoopverplichting.	
Onderpand-ISIN	Het ISIN dat is toegewezen aan in financiële markten uitgegeven effecten, dat bestaat uit twaalf alfanumerieke tekens die unieke identificatie vormen voor effecten (zoals bedoeld onder ISO 6166).	Rapportage is verplicht behalve voor driepartijenrepo's en alle overige repo's waarin de verstrekte zekerheid niet middels een uniek ISIN geïdentificeerd wordt.
Type zekerheid	Ter identificering van de als onderpand verstrekte activaklasse, indien geen individuele ISIN verstrekt wordt.	Moet steeds verstrekt worden indien geen individuele ISIN verstrekt wordt.
Markering specifiek onderpand	Ter identificering van alle repotransacties die uitgevoerd worden tegen verstrekking van algemeen onderpand en repo's die uitgevoerd worden tegen verstrekking van specifiek onderpand. Optioneel veld dat alleen ingevuld moet worden indien zulks voor de informatieplichtige haalbaar is.	Rapportage van dit veld is optioneel.
Rentepercentage van overeenkomst	Het rentetarief uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-geldmarktconventie waartegen de repo werd afgesloten en welk rentetarief wordt toegepast op het verstrekte contante geld.	
Onderpandsurpluspercentage	Een risicobeheersingsmaatregel die wordt toegepast op het onderliggende onderpand, waarvan de waarde wordt berekend als de marktwaarde van de activa verminderd met een bepaald percentage (surpluspercentage (haircut)). Voor rapportagedoeleinden wordt het onderpandsurpluspercentage berekend als 100 minus de ratio tussen opgenomen/verstrekkt contant geld en de marktwaarde met inbegrip van de opgebouwde rente van het als zekerheid aangeboden onderpand.	Rapportage in dit veld is slechts vereist voor individuele onderpandtransacties.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Wederpartijcode van de driepartijenagent	Wederpartij-identificatiecode van de driepartijenagent.	Moet voor driepartijenrepo's gerapporteerd worden.
Driepartijenagentidentificatiecode ID	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele driepartijen-agentidentificatiecode aangeeft.	Moet steeds toegepast worden waar een individuele driepartijenagentidentificatiecode verstrekt zal worden.
Begunstigde van via CCP's uitgevoerde transacties		

## 2. Materialiteitsdrempel

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moet alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geclassificeerde niet-financiële vennootschappen <sup>(1)</sup>.

## 3. Uitzonderingen

Intra-groeptransacties moeten niet gerapporteerd worden.

<sup>(1)</sup> Zie „Bazel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools”, blz. 23 tot en met 27, beschikbaar op de website van de Bank voor Internationale Betalingen: [www.bis.org](http://www.bis.org)

## BIJLAGE II

**Rapportageschema voor met ongedekte transacties verband houdende geldmarktstatistieken**

## DEEL 1

## TYPE INSTRUMENT

1. Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB):
  - a) alle leenactiviteiten die de in de volgende tabel opgesomde instrumenten gebruiken, die luiden in euro met een looptijd van hoogstens één jaar (zijnde transacties met een looptijd van hoogstens 397 dagen na de transactiedatum) tussen de informatieplichtige en overige monetaire-financiële instellingen (MFI's), overige financiële intermediairs (OFI's), verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid of centrale banken voor beleggingsdoelstellingen, alsook met niet-financiële vennootschappen die zijn ingedeeld als „wholesale” in het Bazel III LCR-kader;
  - b) alle leenactiviteiten aan andere kredietinstellingen met een looptijd van hoogstens één jaar (zijnde transacties met een looptijd van ten hoogste 397 dagen na de transactiedatum) middels ongedekte deposito's of middels de aankoop van de uitgevende instellingen van commercial papier, depositocertificaten, floating rate notes en overige schuldbewijzen met een looptijd van ten hoogste één jaar.
2. De hiernavolgende tabel bevat een gedetailleerde standaardbeschrijving van de instrumentcategorieën, voor transacties die informatieplichtigen aan de ECB moeten rapporteren. Indien de informatieplichtigen aan hun betrokken NCB de transacties moeten rapporteren, moet de betrokken NCB deze beschrijvingen van de instrumentcategorieën op nationaal niveau overeenkomstig deze verordening omzetten.

Type instrument	Beschrijving
Deposito's	Ongedekte rentedragende deposito's met hetzij een opzegtermijn of die een looptijd van hoogstens één jaar hebben, die de informatieplichtige hetzij opneemt (opgenomen lening) of plaatst.
Depositocertificaten	Een door een MFI uitgegeven schuldbewijs met een vaste looptijd die de houder recht geeft op een bepaalde vaste rentevoet gedurende een vaste termijn van hoogstens één jaar.
Commercieel papier	Een schuldbewijs dat hetzij ongedekt is of gedekt wordt door de emittent verstrekt onderpand dat een looptijd heeft van hoogstens één jaar en hetzij rentedragend is of met disagio is uitgegeven.
Obligaties met een variabel tarief („Floating rate note”)	Een schuldbewijs waarvoor de periodieke interestbetalingen zijn berekend op basis van de waarde, d.w.z. door het vastleggen van een onderliggend rentetarief zoals Euribor op vooraf bepaalde data die ook wel vaststellingsdata genoemd worden, met een looptijd van ten hoogste één jaar.
Instrumenten met terugneemverplichting („puttable instruments”)	Een schuldbewijs waarin de houder een putoptie heeft, d.w.z. een optie om van de emittent vervroegde terugbetaling te verlangen, met een eerste uitoefendatum of opzegtermijn van niet meer dan een jaar te rekenen van de uitgiftedatum.
Opeisbare instrumenten	Een schuldbewijs waarin de houder een calloptie heeft, d.w.z. een optie om het instrument vervroegd af te lossen, met een uiterste terugbetalingsdatum van niet meer dan één jaar te rekenen van de uitgiftedatum.
Overige kortlopende schuldbewijzen	Door informatieplichtigen uitgegeven niet-achtergestelde effecten, niet zijnde aandelen met een looptijd van ten hoogste één jaar, welke instrumenten doorgaans verhandelbaar zijn en op secundaire markten worden verhandeld of op de markt kunnen worden verrekend en die de houder geen eigendomsrechten verlenen met betrekking tot de emitterende instelling. Hiertoe behoren: <ol style="list-style-type: none"> <li>a) effecten die de houder een onvoorwaardelijk recht geven op een vast of contractueel bepaald inkomen in de vorm van couponbetalingen en/of vast bedrag op een bepaalde datum (of op bepaalde data), dan wel vanaf een bij de emissie vastgestelde datum;</li> <li>b) niet-verhandelbare door informatieplichtigen uitgegeven instrumenten die nadien verhandelbaar worden en als „schuldbewijzen” geherclassificeerd worden.</li> </ol>

## DEEL 2

## SOORT GEGEVENS

1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens <sup>(1)</sup> die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Gegevensbeschrijving	Definitie	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactie-identificatiecode	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte interne unieke identificatiecode.	De transactie-identificatiecode is uniek voor iedere op een bepaalde rapportagedatum voor enig geldmarktsegment gerapporteerde transactie.
Rapportagedatum	De datum waarop de gegevens bij de ECB of de NCB ingediend moeten worden.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Wederpartijcode	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	Indien transacties via een clearinginstelling als centrale tegenpartij (CCP) wordt uitgevoerd, moet de identificatiecode van juridische entiteiten (legal entity identifier (LEI)) verstrekt worden.  Indien transacties worden uitgevoerd met niet-financiële vennootschappen, OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid of centrale banken en voor enige andere transactie waarvoor de wederpartij-LEI niet verstrekt wordt, moet de wederpartijklasse verstrekt worden.
ID wederpartijcode	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele wederpartijcode aangeeft.	Moet steeds toegepast worden. Een individuele wederpartijcode zal verstrekt worden.
Vestigingsplaats wederpartij	International Organisation for Standardisation (ISO) landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de individuele wederpartijcode niet verstrekt wordt. Anders optioneel.
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de gerapporteerde financiële transactie aangaan.	
Afwikkelingsdatum	De datum waarop de geldgever contant geld verstrekt aan de geldnemer dan wel waarop de aankoop van een schuldinstrument afgewikkeld wordt.	In geval van zichtrekeningen en ander ongedekte opgenomen en verstrekte leningen met opzegtermijn, de datum waarop het deposito wordt gecontinueerd (d.w.z. op de datum waarop het deposito terugbetaald zou zijn indien het opgeëist/gediscontinueerd zou zijn).

<sup>(1)</sup> De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op [www.ecb.int](http://www.ecb.int)

Gegevensbeschrijving	Definitie	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Vervaldatum	De datum waarop de geldnemer het verschuldigde contante bedrag aan de geldgever terug moet betalen of waarop een schuldinstrument vervalt en terugbetaald moet worden.	Voor opeisbare instrumenten moet de finale vervaldatum verstrekt worden. Voor instrumenten met terugneemverplichting moet de eerste datum waarop de putoptie uitgeoefend kan worden, verstrekt worden. Voor zichtrekeningen en overige ongedekte opgenomen en verstrekte leningen met een opzegtermijn, de eerste datum waarop het instrument afgelost kan worden.
Eerste call-/putdatum	De datum waarop de call-/putoptie uitgeoefend kan worden.	Moet slechts gerapporteerd worden voor opeisbare instrumenten of instrumenten met een terugneemverplichting met een eerste call-/put optiedatum.
Call-/putopzegtermijn	Voor opeisbare instrumenten of instrumenten met een terugneemverplichting, het aantal aan de houder/emittent van het instrument door de houder van de optie aan de houder/emittent te notificeren kalenderdagen, zulks voorafgaande aan de datum waarop de optie uitgeoefend kan worden. Voor opeisbare deposito's, het aantal door depositohouder aan de geldgever te notificeren kalenderdagen, zulks voorafgaande aan de datum waarop het deposito afgelost kan worden.	Moet alleen voor opeisbare instrumenten en instrumenten met terugneemverplichting met een opzegtermijn en voor deposito's met een vooraf overeengekomen opzegtermijn gerapporteerd worden.
Call/put	Aanduiding om aan te geven of het instrument een call- of putoptie heeft.	
Transactiesymbool	Het transactiesymbool indiceert of het uit hoofde van het nominale transactiebedrag gerapporteerde contante geld is opgenomen of verstrekt.	
Nominale transactiebedrag	Het op deposito's opgenomen of verstrekte contante geld. In geval van schuldbewijzen is dit het nominale bedrag van het uitgegeven/aangekochte schuldbewijs.	
Transactiekoers	De uitgiftekoers van het effect, d.w.z. de ratio uitgedrukt in percentage tussen de initiële cash-inkomsten en het nominale bedrag.	Moet voor ongedekte deposito's als 100 gerapporteerd worden.
Type instrument	Te gebruiken voor het instrument middels welke kredietopname/-verstrekking geschiedt, bijvoorbeeld middels ongedekte deposito's, overige ongedekte kortetermijnschuldinstrumenten met een vast rentepercentage, overige ongedekte kortetermijnschuldinstrumenten met een variabel rentepercentage, commercieel papier op onderpand van activa, enz.	
Soort tarief	Aanduiding om aan te geven of het instrument een vast of een variabel rentepercentage heeft.	

Gegevensbeschrijving	Definitie	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Rentepercentage van overeenkomst	Het rentetarief (uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-dagen geldmarktconventie) waartegen het deposito werd afgesloten en welk rentetarief wordt toegepast op het verstrekte contante geld. Voor schuldinstrumenten, het effectieve rentepercentage (uitgedrukt overeenkomstig de ACT/360-dagen geldmarktconventie) tegen welk percentage het instrument werd uitgegeven/aangekocht.	Moet alleen voor vastrentende instrumenten gerapporteerd worden.
Referentietarief	Het onderliggende referentietarief op basis waarvan de periodieke rentebetalingen berekend worden.	Moet alleen voor instrumenten met variabele tarieven gerapporteerd worden.
Marge	Het aantal aan het onderliggende tarief toegevoegde (indien positief) of daarvan afgetrokken basispunten (indien negatief) ter berekening van het voor een bepaalde periode werkelijke toepasselijke rentevoet.	Moet alleen voor instrumenten met variabele tarieven gerapporteerd worden.

## 2. Materialiteitsdrempel

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moet alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geclassificeerde niet-financiële vennootschappen.

## 3. Uitzonderingen

Intra-groeptransacties moeten niet gerapporteerd worden.



## BIJLAGE III

**Rapportageschema voor met derivaten verband houdende geldmarktstatistieken**

## DEEL 1

**TYPE INSTRUMENT**

Informatieplichtigen rapporteren aan de Europese Centrale Bank (ECB) of de betrokken nationale centrale bank (NCB):

- a) alle deviezenswaps waarbij euro contant worden aangekocht tegen betaling van een vreemde valuta en die euro op een toekomstige datum worden herverkocht of heraangekocht tussen de informatieplichtige en overige monetaire-financiële instellingen (MFI's), overige financiële instellingen (OFI's), verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid, of centrale banken voor beleggingsdoeleinden, alsook met overeenkomstig het Bazel III LCR-kader als „wholesale” ingedeelde niet-financiële vennootschappen;
- b) oversight index swaps (OIS) transacties, luidend in euro, tussen de informatieplichtige en andere monetaire-financiële instellingen (MFI's), OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid, of centrale banken voor beleggingsdoeleinden, alsook met overeenkomstig het Bazel III LCR-kader als „wholesale” ingedeelde niet-financiële vennootschappen.

## DEEL 2

**SOORT GEGEVENS**

1. Soort van op transacties gebaseerde gegevens <sup>(1)</sup> voor deviezenswaps die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactie-identificatiecode	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte interne unieke identificatiecode.	De transactie-identificatiecode is uniek voor iedere op een bepaalde rapportagedatum voor enig geldmarktsegment gerapporteerde transactie.
Rapportagedatum	De datum waarop de gegevens bij de ECB of de NCB ingediend moeten worden.	
Elektronische tijdstempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	
Wederpartijcode	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	Indien transacties via een clearinginstelling als centrale tegenpartij (CCP) worden uitgevoerd, moet de identificatiecode van juridische entiteiten (legal entity identifier (LEI)) verstrekt worden.  Indien transacties worden uitgevoerd met niet-financiële vennootschappen, OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid of centrale banken en voor enige andere transactie waarvoor de wederpartij-LEI niet verstrekt wordt, moet de wederpartijklasse verstrekt worden.
ID wederpartijcode	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele wederpartijcode aangeeft.	Moet onder alle omstandigheden gebruikt worden. Een individuele wederpartijcode wordt verstrekt.
Vestigingsplaats wederpartij	International Organisation for Standardisation (ISO) landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de individuele wederpartijcode niet verstrekt wordt. Anders optioneel.

<sup>(1)</sup> De elektronische rapportagestandaards en de technische specificaties voor de gegevens worden afzonderlijk vermeld. Zij zijn beschikbaar op [www.ecb.int](http://www.ecb.int)

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de gerapporteerde financiële transactie aangaan.	
Contante valutadatum	De datum waarop een partij aan de andere partij een specifiek bedrag van een specifieke valuta verkoopt tegen betaling van een overeengekomen bedrag van een specifieke andere valuta gebaseerd op een overeengekomen wisselkoers, ook wel de contante koers van de vreemde valuta genoemd.	
Vervaldatum	De datum waarop de swaptransactie van de vreemde valuta afloopt en de verkochte valuta op de contante valutadatum weer wordt aangekocht.	
Transactiesymbool	Moet gebruikt worden om vast te stellen of het eurobedrag dat uit hoofde van het nominale transactiebedrag werd gerapporteerd op de contante valutadatum wordt aangekocht of verkocht.	Dit moet verwijzen naar de contante euro (euro spot), d.w.z. of euro wordt aangekocht of verkocht op de contante valutadatum.
Nominaal transactiebedrag	Het op de contante valutadatum aangekochte of verkochte bedrag in euro.	
Deviezencode	De internationale driecijfer ISO-code van in ruil voor euro aangekochte/verkochte valuta.	
Contante koers van de deviezen	De wisselkoers tussen de euro en de op het contante deel toepasselijke vreemde valuta van de deviezenswaptransactie.	
Deviezenstermijntransacties	Het verschil tussen de contante wisselkoers en de deviezenstermijnkoers, uitgedrukt in basispunten genoteerd volgens de heersende marktconventies voor het deviezenpaar.	
Begunstigde van via CCP's uitgevoerde transacties		

2. Soort van op transacties gebaseerde gegevens voor OIS-transacties die voor iedere transactie gerapporteerd moeten worden:

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Transactie-identificatiecode	De door de informatieplichtige voor iedere transactie gebruikte interne unieke identificatiecode.	De transactie-identificatiecode moet uniek zijn voor iedere op een bepaalde rapportagedatum voor enig geldmarktsegment gerapporteerde transactie.

Veld	Gegevensbeschrijving	Alternatieve rapportageoptie (indien toepasselijk) en overige kwalificaties
Rapportagedatum	De datum waarop de gegevens bij de ECB of de NCB ingediend moeten worden.	
Elektronische tijds- tempel	De tijd waarop een transactie wordt afgesloten of geboekt.	Facultatief
Wederpartijcode	Een identificatiecode om de wederpartij van de informatieplichtige voor de gerapporteerde transactie te identificeren.	Indien transacties via een clearinginstelling als centrale tegenpartij (CCP) wordt uitgevoerd, moet de CCP-LEI verstrekt worden.  Indien transacties worden uitgevoerd met niet-financiële vennootschappen, OFI's, verzekeringsinstellingen, pensioenfondsen, overheid of centrale banken en voor enige andere transactie waarvoor de wederpartij-LEI niet verstrekt wordt, moet de wederpartijklasse verstrekt worden.
ID wederpartijcode	Een attribuut dat de soort ingestuurde individuele wederpartijcode aangeeft.	Moet onder alle omstandigheden gebruikt worden. Een individuele wederpartijcode wordt verstrekt.
Vestigingsplaats wederpartij	ISO-landencode van het land krachtens wiens recht de wederpartij rechtspersoonlijkheid heeft.	Verplicht indien de individuele wederpartijcode niet verstrekt wordt. Anders optioneel.
Transactiedatum	De datum waarop de partijen de financiële transactie aangaan.	
Startdatum	De datum waarop het overnighttarief van de periodieke variabele rentevoet berekend wordt.	
Vervaldatum	De laatste datum van de periode waarover het samengestelde overnighttarief berekend wordt.	
Vaste rentevoet	De bij de berekening van de OIS-uitbetaling gehanteerde vaste rentevoet.	
Transactiesymbool	Een aanduiding die aangeeft of het vaste rentetarief door de informatieplichtige wordt betaald of ontvangen.	
Nominaal transactie- bedrag	Het nominale IOS-bedrag.	

### 3. Materialiteitsdrempel

Met niet-financiële vennootschappen uitgevoerde transacties moet alleen gerapporteerd worden indien uitgevoerd met op basis van het Bazel III LCR-kader als wholesale geclassificeerde niet-financiële vennootschappen.

### 4. Uitzonderingen

Intra-groeptransacties moeten niet gerapporteerd worden.

## BIJLAGE IV

**Door de werkelijke populatie van informatieplichtigen toe te passen minimumnormen**

Informatieplichtigen moeten de volgende minimumnormen in acht nemen, om aan de statistische rapportagevereisten van de Europese Centrale Bank (ECB) te voldoen.

**1. Minimumnormen voor transmissie:**

- i) de rapportage gebeurt tijdig en binnen de termijn die door de ECB en betreffende de nationale centrale bank (NCB) is vastgesteld;
- ii) vorm en formaat van de statistische rapporten moeten voldoen aan de technische rapportagevereisten die die door de ECB en betreffende NCB zijn vastgesteld;
- iii) de informatieplichtige moet de ECB en de betrokken NCB details verstrekken inzake één of meerdere contactpersonen;
- iv) de datatransmissie aan de ECB en desbetreffende NCB moet gebeuren met inachtneming van de daarvoor vastgestelde technische specificaties.

**2. Minimumnormen voor nauwkeurigheid:**

- i) statistische informatie moet juist zijn;
- ii) informatieplichtigen zijn in staat informatie te verschaffen over de ontwikkelingen waarop de verstrekte gegevens duiden;
- iii) statistische gegevens moeten volledig zijn en mogen geen voortdurende en structurele leemten bevatten; er moet gewezen worden op eventuele leemten, waarvoor aan de ECB en de betrokken NCB een verklaring moet worden gegeven en die, waar van toepassing, zo snel mogelijk moeten worden verholpen;
- iv) informatieplichtigen moeten voor de technische gegevenstransmissie de door de ECB en de betrokken NCB vastgestelde afmetingen, afrondingsbeleid en decimalen in acht nemen.

**3. Minimumnormen voor conceptuele naleving:**

- i) statistische gegevens voldoen aan de definities en classificaties zoals vervat in deze verordening;
- ii) in geval van afwijkingen van deze definities en classificaties moeten de informatieplichtigen op gezette tijden het verschil controleren en kwantificeren tussen de gebruikte maatstaf en de maatstaf in deze verordening;
- iii) informatieplichtigen moeten een verklaring kunnen geven voor een eventuele breuk in de verstrekte gegevens ten opzichte van de cijfers van voorgaande perioden.

**4. Minimumnormen voor herzieningen:**

De informatieplichtigen moeten het door de ECB en de betrokken NCB vastgestelde herzieningenbeleid en --procedures volgen. Herzieningen die afwijken van regelmatige herzieningen worden van een toelichting voorzien.

---