

REGULAMENTUL (UE) 2015/1599 AL BĂNCII CENTRALE EUROPENE**din 10 septembrie 2015****de modificare a Regulamentului (UE) nr. 1333/2014 privind statisticile referitoare la piețele monetare (BCE/2015/30)**

CONSILIUL GUVERNATORILOR BĂNCII CENTRALE EUROPENE,

având în vedere Statutul Sistemului European al Băncilor Centrale și al Băncii Centrale Europene, în special articolul 5,

având în vedere Regulamentul (CE) nr. 2533/98 al Consiliului din 23 noiembrie 1998 privind colectarea informațiilor statistice de către Banca Centrală Europeană ⁽¹⁾, în special articolul 5 alineatul (1) și articolul 6 alineatul (4),

întrucât:

- (1) Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 al Băncii Centrale Europene (BCE/2014/48) ⁽²⁾ prevede raportarea datelor statistice de către agenții raportori pentru ca Sistemul European al Băncilor Centrale, în îndeplinirea atribuțiilor ce îi revin, să poată produce statistici privind tranzacțiile de pe piețele monetare.
- (2) Băncile centrale naționale vor emite un set de instrucțiuni privind raportarea prin care să se stabilească parametrii detaliați pentru raportarea informațiilor statistice în temeiul Regulamentului (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48). Întrucât instrucțiunile privind raportarea definesc un număr de termeni semnificativi care apar în acel regulament, din motive de consecvență este necesar ca acesta să reflecte și acele schimbări.
- (3) Prin urmare, Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) ar trebui să fie modificat în mod corespunzător,

ADOPTĂ PREZENTUL REGULAMENT:

*Articolul 1***Modificări**

- (1) Anexa I la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se înlocuiește cu anexa I la prezentul regulament.
- (2) Anexele II și III la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se modifică în conformitate cu anexa II la prezentul regulament.

*Articolul 2***Dispoziții finale**Prezentul regulament intră în vigoare în a douăzecea zi de la publicarea în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Prezentul regulament este obligatoriu în toate elementele sale și se aplică direct în statele membre în conformitate cu tratatele.

Adoptat la Frankfurt pe Main, 10 septembrie 2015.

*Pentru Consiliul guvernatorilor BCE**Președintele BCE*

Mario DRAGHI

⁽¹⁾ JO L 318, 27.11.1998, p. 8.⁽²⁾ Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 al Băncii Centrale Europene din 26 noiembrie 2014 privind statisticile referitoare la piețele monetare (BCE/2014/48) (JO L 359, 16.12.2014, p. 97).

ANEXA I

„ANEXA I

Sistem de raportare pentru statisticile referitoare la piețele monetare în ceea ce privește tranzacțiile garantate

PARTEA 1

TIP DE INSTRUMENTE

Agenții raportori raportează către Banca Centrală Europeană (BCE) sau banca centrală națională (BCN) relevantă toate acordurile de răscumpărare și tranzacțiile inițiate în cadrul acestora, inclusiv operațiunile repo tripartite, care sunt exprimate în euro cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 zile după data decontării) între agentul raportor și alte instituții financiare monetare (IFM), alți intermediari financiari (AIF), societăți de asigurare, fonduri de pensii, administrații publice sau bănci centrale în scopuri de investiții, precum și cu societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» (*wholesale*) în conformitate cu cadrul Basel III LCR.

PARTEA 2

TIP DE DATE**1. Tipul de date bazate pe tranzacții ⁽¹⁾ care trebuie raportate pentru fiecare tranzacție**

Câmp	Descrierea datelor	Opțiuni de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Identificatorul tranzacției	Identificatorul unic intern al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru fiecare tranzacție.	Identificatorul tranzacției este unic pentru orice tranzacție raportată la o anumită dată de raportare pentru orice segment al pieței monetare.
Data raportării	Data la care datele sunt transmise BCE sau BCN.	
Marcă temporală electronică	Momentul în care o tranzacție este încheiată sau înregistrată.	
Codul contrapărții	Un cod de identificare utilizat pentru a recunoaște contrapartea agentului raportor pentru tranzacția raportată.	Atunci când tranzacțiile sunt efectuate prin intermediul unei contrapărți centrale de compensare (CPC), trebuie furnizat identificatorul persoanei juridice (legal entity identifier – LEI) al CPC. Atunci când tranzacțiile sunt efectuate cu societăți nefinanciare, AIF, societăți de asigurare, fonduri de pensii, administrații publice și bănci centrale și pentru orice altă tranzacție raportată pentru care nu este furnizat indicatorul LEI al contrapărții, trebuie furnizată clasa contrapărții.
Identificatorul codului contrapărții	Un atribut care specifică tipul de cod individual al contrapărții transmis.	A se utiliza în toate împrejurările. Va fi furnizat un cod individual al contrapărții.

⁽¹⁾ Standardele de raportare electronică și specificațiile tehnice ale datelor sunt stabilite separat. Acestea sunt disponibile pe website-ul BCE la adresa www.ecb.europa.eu.

Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Localizarea contrapărții	Codul de țară al Organizației Internaționale de Standardizare (ISO) pentru țara în care este înregistrată contrapartea.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizat codul individual al contrapărții. Opțional în rest.
Valoarea nominală a tranzacției	Suma dată sau luată cu împrumut inițial.	
Valoarea nominală a colateralului	Valoarea nominală a garanției constituite drept colateral.	Cu excepția operațiunilor repo tripartite și a oricărei alte tranzacții în care garanția depusă nu este identificată printr-un număr internațional de identificare a valorilor mobiliare (International Securities Identification Number – ISIN) unic.
Data tranzacției	Data la care părțile încheie tranzacția financiară.	
Data decontării	Data cumpărării, respectiv data la care numerarul trebuie plătit de creditor debitorului, iar garanția trebuie transferată de la debitor la creditor.	În cazul unor tranzacții de răscumpărare pe bază deschisă, aceasta este data la care reînnoirea se decontează (chiar dacă nu are loc un schimb de numerar).
Data scadenței	Data răscumpărării, respectiv data la care numerarul trebuie rambursat de către debitor creditorului.	În cazul tranzacțiilor de răscumpărare pe bază deschisă, aceasta este data la care principalul și dobânda datorate trebuie rambursate în cazul în care tranzacția nu mai este reînnoită.
Semnul tranzacției	Luarea de numerar cu împrumut în cazul contractelor de report sau darea de numerar cu împrumut în cazul contractelor de deport.	
Numărul ISIN al colateralului	Numărul ISIN alocat valorilor mobiliare emise pe piețele financiare, compus din 12 caractere alfanumerice, care identifică în mod unic o valoare mobilă (astfel cum este definit de ISO 6166).	A se raporta cu anumite excepții pentru anumite tipuri de colateral.
Tip de colateral	Pentru a identifica clasa de active constituită drept colateral atunci când nu este furnizat un număr ISIN individual.	A se furniza în toate cazurile în care nu este furnizat un număr ISIN individual.
Sectorul emitentului de colateral	Pentru a identifica sectorul emitentului de colateral atunci când nu este furnizat un număr ISIN individual.	A se furniza atunci când nu este furnizat un număr ISIN individual.
Indicator colateral special	Pentru a identifica toate tranzacțiile de răscumpărare desfășurate cu colateral general și cele desfășurate cu colateral special. Câmp opțional care trebuie raportat numai dacă este fezabil pentru agentul raportor.	Raportarea acestui câmp este opțională.

Câmp	Descrierea datelor	Opțiuni de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Rata tranzacției	Rata dobânzii, exprimată în conformitate cu convenția ACT/360 a piețelor monetare, la care a fost încheiată operațiunea repo și la care este remunerat numerarul împrumutat.	
Marjă de ajustare a colateralului	O măsură de control al riscurilor aplicată colateralului suport, unde valoarea acestui colateral se calculează ca valoare de piață a activelor minus un anumit procent (marjă de ajustare). În scopuri de raportare, marja de ajustare a colateralului se calculează ca 100 minus raportul dintre numerarul dat/luat cu împrumut și valoarea de piață, inclusiv dobânda acumulată, a colateralului depus.	Raportarea acestui câmp este necesară numai pentru tranzacțiile cu colateral unic.
Codul contrapărții pentru agentul tripartit	Identificatorul codului contrapărții pentru agentul tripartit.	A se raporta pentru operațiuni repo tripartite.
Identificatorul codului agentului tripartit	Un atribut care specifică tipul de cod individual al agentului tripartit transmis.	A se utiliza în toate împrejurările în care va fi furnizat un cod individual al agentului tripartit.

2. Prag de semnificație

Tranzacțiile încheiate cu societățile nefinanciare ar trebui raportate numai atunci când sunt încheiate cu societăți nefinanciare clasificate drept interbancare pe baza cadrului Basel III LCR ⁽¹⁾.

3. Excepții

Tranzacțiile intragrup nu ar trebui raportate.”

⁽¹⁾ A se vedea «Basel III: Indicele de acoperire a lichidității și instrumentele de monitorizare a riscurilor legate de lichiditate» (*Basel III: The Liquidity Coverage Ratio and liquidity risk monitoring tools*), Comitetul de la Basel pentru supraveghere bancară, p. 23-27, disponibil pe website-ul Băncii Reglementelor Internaționale, la adresa: www.bis.org.

ANEXA II

Anexele II și III la Regulamentul (UE) nr. 1333/2014 (BCE/2014/48) se modifică după cum urmează:

1. în anexa II, partea I se înlocuiește cu următorul text:

„PARTEA I

TIP DE INSTRUMENTE

1. Agenții raportori raportează către Banca Centrală Europeană (BCE) sau banca centrală națională (BCN) relevantă:

- (a) toate împrumuturile luate utilizând instrumentele definite în tabelul de mai jos, care sunt exprimate în euro cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 zile după data decontării), de agentul raportor de la alte instituții financiare monetare (IFM), alți intermediari financiari (AIF), societăți de asigurare, fonduri de pensii, administrații publice sau bănci centrale în scopuri de investiții, precum și de la societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR.
- (b) toate creditele acordate altor instituții de credit cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacțiile cu o scadență de cel mult 397 zile după data decontării) prin depozite negarantate sau depozite la vedere, sau prin cumpărarea de la instituțiile de credit emitente de efecte de comerț, certificate de depozit, valori mobiliare cu rată variabilă și alte titluri de natura datoriei cu o scadență de până la un an.;

2. Tabelul de mai jos oferă o descriere standard detaliată a categoriilor de instrumente pentru tranzacții pentru care agenții raportori trebuie să transmită rapoartă BCE. În cazul în care agenții raportori trebuie să raporteze tranzacțiile către BCN a acestora, BCN relevantă ar trebui să transpună aceste descrieri ale categoriilor de instrumente la nivel național în conformitate cu prezentul regulament.

Tip de instrument	Descriere
Depozite	Depozite negarantate purtătoare de dobândă (inclusiv depozitele la vedere dar exclusiv conturile curente) care sunt fie rambursabile la cerere, fie au o scadență de cel mult un an și care sunt fie luate cu împrumut, fie plasate de agentul raportor.
Depozite la vedere	Conturi de numerar cu modificări zilnice ale ratei dobânzii aplicabile, care generează plăți ale dobânzii sau calcule la intervale regulate și o perioadă de notificare pentru retragerea banilor.
Certificat de depozit	Un instrument de natura datoriei cu rată fixă a dobânzii emis de o IFM care dă dreptul titularului la o rată specifică fixă a dobânzii pe o durată fixă definită, de până la un an.
Efecte de comerț	Un instrument de natura datoriei care este fie negarantat, fie garantat cu colateral furnizat de emitent, care are o scadență de cel mult un an și este fie purtător de dobânzi, fie cu discount.
Valoare mobilă cu rată variabilă	Un instrument de natura datoriei pentru care plățile periodice ale dobânzii se calculează pe baza valorii, respectiv prin fixarea unei rate de referință de bază, precum Euribor, la date predefinite cunoscute drept date de fixare, și care are o scadență de cel mult un an.

Tip de instrument	Descriere
Alte titluri de natura datoriei pe termen scurt	<p>Valori mobiliare nesubordonate, altele decât titlurile de participație, cu o scadență de până la un an, emise de agenții raportori, care sunt instrumente negociabile și tranzacționate în mod obișnuit pe piețele secundare sau care pot fi compensate pe piață și care nu conferă deținătorului vreun drept de proprietate asupra instituției emitente. Acest post include:</p> <p>(a) valori mobiliare care conferă deținătorului un drept necondiționat la un venit fix sau determinat prin contract sub forma plății de cupoane și/sau a unei sume fixe stabilite la o anumită dată (sau date) sau începând de la o dată definită la momentul emisiunii;</p> <p>(b) instrumente nenegociabile emise de agenții raportori care, ulterior, devin negociabile și sunt reclasificate ca «titluri de natura datoriei.»;</p>

2. în anexa III, partea 1 se înlocuiește cu următorul text:

„PARTEA 1

TIP DE INSTRUMENTE

Agenții raportori raportează către Banca Centrală Europeană (BCE) sau banca centrală națională (BCN) relevantă:

- (a) toate tranzacțiile de swap pe cursul de schimb, în care se cumpără/vinde euro la vedere în schimbul unei monede străine și se vinde/cumpără înapoi la o dată forward la un curs de schimb valutar forward convenit în prealabil cu o scadență de până la un an inclusiv (definite drept tranzacții cu o scadență de cel mult 397 zile de la data decontării componente la vedere a tranzacției de swap pe cursul de schimb), între agentul raportor și alte instituții financiare monetare (IFM), alți intermediari financiari (AIF), societăți de asigurare, fonduri de pensii, administrații publice sau bănci centrale în scopuri de investiții, precum și cu societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR;
- (b) tranzacții swap pe indicii ratei dobânzii overnight (*overnight index swaps*) (OIS) exprimate în euro între agentul raportor și alte IFM, AIF, societăți de asigurare, fonduri de pensii, administrații publice sau bănci centrale în scopuri de investiții, precum și cu societăți nefinanciare clasificate ca «interbancare» în conformitate cu cadrul Basel III LCR.”;

3. în anexa III, tabelul de la alineatul (1) din partea 2 se înlocuiește cu următorul text:

„Câmp	Descrierea datelor	Opțiuni de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Identificatorul tranzacției	Identificatorul unic intern al tranzacției utilizat de agentul raportor pentru fiecare tranzacție.	Identificatorul tranzacției este unic pentru orice tranzacție raportată la o anumită dată de raportare pentru orice segment al pieței monetare.
Data raportării	Data la care datele sunt transmise BCE sau BCN.	
Marcă temporală electronică	Momentul în care o tranzacție este încheiată sau înregistrată.	

„Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Codul contrapărții	Un cod de identificare care trebuie utilizat pentru a recunoaște contrapartea agentului raportor pentru tranzacția raportată.	Atunci când tranzacțiile sunt efectuate prin intermediul unei contrapărți centrale de compensare (CPC), trebuie furnizat identificatorul persoanei juridice (<i>legal entity identifier – LEI</i>) al CPC. Atunci când tranzacțiile sunt efectuate cu societăți nefinanciare, AIF, societăți de asigurare, fonduri de pensii, administrații publice și bănci centrale și pentru orice altă tranzacție raportată pentru care nu este furnizat indicatorul LEI al contrapărții, trebuie furnizată clasa contrapărții.
Identificatorul codului contrapărții	Un atribut care specifică tipul de cod individual al contrapărții transmis.	A se utiliza în toate împrejurările. Va fi furnizat un cod individual al contrapărții.
Localizarea contrapărții	Codul de țară al Organizației Internaționale de Standardizare (ISO) pentru țara în care este înregistrată contrapartea.	Obligatoriu în cazul în care nu este furnizat codul individual al contrapărții. Opțional în rest.
Data tranzacției	Data la care părțile încheie tranzacția financiară raportată.	
Data valorii la vedere	Data la care o parte vinde celeilalte părți o cantitate specificată dintr-o monedă specificată în schimbul plății unei sume convenite dintr-o monedă specificată diferită pe baza unui curs de schimb valutar cunoscut drept cursul de schimb valutar la vedere.	
Data scadenței	Data la care tranzacția de swap pe cursul de schimb expiră, iar moneda vândută la data valorii la vedere este răscumpărată.	
Semnul tranzacției	A se utiliza pentru a identifica dacă suma în euro raportată la valoarea nominală a tranzacției este cumpărată sau vândută la data valorii la vedere.	Acesta ar trebui să se refere la operațiunea cu euro la vedere, respectiv dacă euro este vândut sau cumpărat la data valorii la vedere.
Valoarea nominală a tranzacției	Cantitatea de euro cumpărată sau vândută la data valorii la vedere.	
Codul monedei străine	Codul internațional ISO de trei cifre al monedei cumpărate/vândute în schimbul euro.	

„Câmp	Descrierea datelor	Opțiune de raportare alternativă (dacă este cazul) și alte rezerve
Cursul de schimb valutar la vedere	Cursul de schimb valutar între euro și moneda străină aplicabil componentei la vedere a tranzacției de swap pe cursul de schimb.	
Puncte forward valutare	Diferența dintre cursul de schimb valutar la vedere și cursul de schimb valutar forward exprimată în puncte de bază, cotate în conformitate cu convențiile predominante ale pieței pentru perechea valutară.”	