

**EUROPEISKA CENTRALBANKENS FÖRORDNING (EU) 2019/113**  
**av den 7 december 2018**  
**om ändring av förordning (EU) nr 1333/2014 om penningmarknadsstatistik (ECB/2018/33)**

ECB-RÅDET HAR ANTAGIT DENNA RIKTLINJE

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av stadgan för Europeiska centralbankssystemet och Europeiska centralbanken, särskilt artikel 5,

med beaktande av rådets förordning (EG) nr 2533/98 av den 23 november 1998 om Europeiska centralbankens insamling av statistiska uppgifter <sup>(1)</sup>, särskilt artiklarna 5.1 och 6.4,

efter samråd med Europeiska kommissionen, och

av följande skäl:

- (1) Enligt Europeiska centralbankens förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) <sup>(2)</sup> ska uppgiftslämnare rapportera statistik så att Europeiska centralbankssystemet, för utförandet av sina uppgifter, kan ta fram statistik om penningmarknaden för euro.
- (2) För att säkerställa tillgången till högkvalitativ statistik om penningmarknaden för euro måste vissa bestämmelser i förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ändras. Det är särskilt viktigt att säkerställa att varje uppgiftslämnare till Europeiska centralbanken (ECB) eller den berörda nationella centralbanken rapporterar samtliga transaktioner som har ingåtts mellan uppgiftslämnaren och finansiella bolag (utom centralbanker där transaktionen inte görs i investeringssyfte) samt offentlig förvaltning och vissa icke-finansiella bolag. Därutöver är det nödvändigt att säkerställa att uppgiftsinsamlingen drar fördel av en omfattande obligatorisk användning av LEI-koden (Legal Entity Identifier) vid rapportering inom unionen.
- (3) Mot bakgrund av hur viktigt det är att säkerställa tillgången till aktuell statistik om euroområdet penningmarknad, är det också nödvändigt att harmonisera och öka uppgiftslämnarnas skyldigheter att i rätt tid överföra information till de nationella centralbankerna eller ECB.
- (4) Åtgärder bör vidtas för att säkerställa att integriteten på den statistisk information som samlas in, sammanställs och överförs av uppgiftslämnare upprätthålls. Det är särskilt viktigt att understryka att den statistik som ECB eller de nationella centralbankerna erhåller ska vara en neutral rapportering av verkliga transaktioner som uppgiftslämnaren varit part i, objektiva och tillförlitliga, för att beakta de allmänna principer på vilka ECBS offentliga åtagande för den europeiska statistiken vilar <sup>(3)</sup>. Uppgiftslämnarna bör säkerställa att eventuella fel i de inrapporterade uppgifterna rättas och att detta meddelas ECB och den berörda nationella centralbanken snarast möjligt.
- (5) Genomförandet av dessa bestämmelser kommer att säkerställa att ECBS har mer tidsnära, omfattande, detaljerad, harmoniserad och tillförlitlig statistik om euroområdet penningmarknad vilket kommer att möjliggöra en mer ingående analys av den penningpolitiska transmissionsmekanismen. De insamlade uppgifterna kan därutöver även komma att användas för att ta fram och förvalta en dagslåneränta för euro utan säkerhet.
- (6) Förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) bör därför ändras i enlighet med detta.

<sup>(1)</sup> EGT L 318, 27.11.1998, s. 8.

<sup>(2)</sup> Europeiska centralbankens förordning (EU) nr 1333/2014 av den 26 november 2014 om penningmarknadsstatistik (ECB/2014/48) (EUT L 359, 16.12.2014, s. 97).

<sup>(3)</sup> Finns på ECB:s webbplats [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

#### Artikel 1

#### Ändringar

Förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ändras på följande sätt:

1. Artikel 1 ska ändras på följande sätt:

a) Följande punkt ska läggas till som punkt 5a:

”5a. *finansiella bolag*: institutionella enheter som är självständiga juridiska enheter och marknadsproducenter och vars primära verksamhet är att producera finansiella tjänster i enlighet med det reviderade Europeiska nationalräkenskapsystemet (ENS 2010) som fastställs i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 549/2013 (\*).

(\*) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 549/2013 av den 21 maj 2013 om det europeiska national- och regionalräkenskapsystemet i Europeiska unionen (EUT L 174, 26.6.2013, s. 1).”

b) Punkterna 3 och 5 ska utgå.

c) Punkt 9 ska ersättas med följande:

”9. *penningmarknadsstatistik*: statistik avseende transaktioner med och utan säkerhet samt derivattransaktioner i penningmarknadsinstrument som har genomförts under den relevanta rapporteringsperioden mellan uppgiftslämnare och finansiella bolag (utom centralbanker om transaktionen inte görs i investeringssyfte), offentlig förvaltning, eller icke-finansiella bolag som klassificeras som ’institutionell bankverksamhet’ enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.”

d) Punkt 14 ska ersättas med följande:

”14. *referenspopulation av uppgiftslämnare*: monetära finansinstitut med hemvist i euroområdet utom centralbanker och penningmarknadsfonder som mottar eurodenominerad inlåning och/eller utfärdar andra skuldinstrument och/eller beviljar eurodenominerad utlåning enligt bilagorna I, II eller III från/till andra finansiella bolag, offentlig förvaltning eller icke-finansiella bolag.”

e) Följande punkt ska läggas till som punkt 20a:

”20a. *kreditinstitut*: den betydelse som framgår av artikel 4.1.1 i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 (\*).

(\*) Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 av den 26 juni 2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och om ändring av förordning (EU) nr 648/2012 (EUT L 176, 27.6.2013, s. 1).”

f) Punkt 25 ska ersättas med följande:

”25. *OIS-swap*: en ränteswap där den rörliga räntan för perioden motsvarar det geometriska genomsnittet av en dagslåneränta (eller ett dagslåneindex) för en viss löptid. Slutbetalning beräknas som mellanskillnaden mellan den fasta ränta och den effektiva dagslåneränta som har registrerats under OIS-swappens löptid, tillämpat på transaktionens nominella belopp.”

2. Artikel 3 ska ändras på följande sätt:

a) Punkt 1 ska ersättas med följande:

”1. För att penningmarknadsstatistik ska kunna produceras regelbundet ska uppgiftslämnarna dagligen, på konsoliderad basis, rapportera statistik om penningmarknadsinstrument, som även inbegriper alla deras filialer i EU och Efta, till den nationella centralbank i den medlemsstat där de har sin hemvist. De statistiska uppgifter som ska lämnas specificeras i bilagorna I, II och III. Uppgiftslämnarna ska rapportera de begärda statistiska uppgifterna i enlighet med de minimistandarder för överföring, noggrannhet, begreppsmässig överensstämmelse, revidering och dataintegritet som framgår av bilaga IV. Den nationella centralbanken ska överföra de statistiska uppgifter som den erhåller från uppgiftslämnarna till ECB i enlighet med artikel 4.2 i denna förordning.”

b) Punkt 2 ska ersättas med följande:

”2. De nationella centralbankerna ska fastställa och genomföra de rapporteringsförfaranden som ska följas av uppgiftslämnarna i fråga om penningmarknadsinstrument. Dessa rapporteringsförfaranden ska säkerställa att de begärda statistiska uppgifterna rapporteras och att det är möjligt att kontrollera huruvida minimistandarderna enligt bilaga IV har följts.”

c) Punkt 5 ska ersättas med följande:

”5. De nationella centralbankerna ska fastställa och genomföra de rapporteringsförfaranden som ska följas av uppgiftslämnarna i enlighet med de nationella statistikrapporteringskraven. De nationella centralbankerna ska säkerställa att det i de nationella rapporteringsförfarandena fastställs att de ytterligare uppgiftslämnarna ska uppfylla krav som är likvärdiga med artiklarna 6–8, 10.3, 11 och 12 i denna förordning. De nationella centralbankerna ska säkerställa att dessa förfaranden medför att de begärda statistiska uppgifterna rapporteras och gör det möjligt att kontrollera huruvida minimistandarderna enligt bilaga IV har följts.”

3. Artikel 4 ska ändras på följande sätt:

a) Punkt 1 ska ersättas med följande:

”1. Om en nationell centralbank i enlighet med artikel 3.3 beslutar att uppgiftslämnare ska rapportera de statistiska uppgifter som framgår av bilagorna I, II och III direkt till ECB, ska uppgiftslämnarna överföra dessa uppgifter till ECB en gång per dag mellan 18.00 på affärsdagen och 07.00 centraleuropeisk tid (CET) (\*) på den första TARGET2-avvecklingsdagen efter affärsdagen.

(\*) CET beaktar omställningen till centraleuropeisk sommartid.”

b) Punkt 2 ska ersättas med följande:

”2. I samtliga andra fall än de som anges i punkt 1 ska de nationella centralbankerna till ECB överföra den dagliga penningmarknadsstatistik som specificeras i bilagorna I, II och III som de erhåller från uppgiftslämnarna som valts ut i enlighet med artikel 2.2, 2.3 och 2.4, eller från de ytterligare uppgiftslämnare som valts ut enligt artikel 2.6, till ECB en gång per dag före 07.00 centraleuropeisk tid (CET) på den första TARGET2-avvecklingsdagen efter affärsdagen.”

c) Följande punkt 5 ska läggas till:

”5. Vid bedömningen av huruvida en uppgiftslämnare har uppfyllt kraven enligt denna artikel, ska ett åsidosättande av de minimistandarder för överföring som framgår av punkt 1 i och 1 ii i bilaga IV bedömas som bristande efterlevnad av samma typ av rapporteringskrav för ändamålet att konstatera en bristande efterlevnad i ECB:s ramverk för bristande statistisk efterlevnad.”

4. Artikel 5 ska utgå.

5. Bilaga I till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ersättas med bilaga I till den här förordningen.

6. Bilaga II till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ersättas med bilaga II till den här förordningen.

7. Bilaga III till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ersättas med bilaga III till den här förordningen.

8. Bilaga IV till förordning (EU) nr 1333/2014 (ECB/2014/48) ska ersättas med bilaga IV till den här förordningen.

## Artikel 2

### Slutbestämmelser

Denna förordning träder i kraft den tjugonde dagen efter det att den har offentliggjorts i *Europeiska unionens officiella tidning*.

Denna förordning ska tillämpas från och med den 15 mars 2019.

Denna förordning är till alla delar bindande och direkt tillämplig i alla medlemsstater i enlighet med fördragen.

Utfärdad i Frankfurt am Main den 7 december 2018.

*På ECB-rådets vägnar*

Mario DRAGHI

*ECB:s ordförande*

---

## BILAGA I

## "BILAGA I

**Rapporteringsordning för penningmarknadsstatistik som avser transaktioner med säkerhet**

## DEL 1

**TYP AV INSTRUMENT**

Uppgiftslämnare ska till Europeiska centralbanken (ECB) eller berörd nationell centralbank rapportera samtliga återköpsavtal och transaktioner som har ingåtts inom ramen för sådana avtal, däribland transaktioner avseende trepartsrepor som är denominerade i euro med en löptid på upp till och med ett år (definierade som transaktioner med en förfallodag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen) mellan uppgiftslämnaren och finansiella företag (utom centralbanker om transaktionen inte görs i investerings syfte), offentlig förvaltning, eller icke-finansiella bolag som klassificeras som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten. Koncerninterna transaktioner ska exkluderas.

## DEL 2

**TYP AV UPPGIFTER**

1. Typ av transaktionsbaserade uppgifter (\*) som ska rapporteras för varje transaktion:

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Reported transaction status (den rapporterade transaktionens status)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en ny transaktion, en ändring av en tidigare rapporterad transaktion, en annullering eller en rättelse av en tidigare rapporterad transaktion.	
Novation status (novationsstatus)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en novation.	
Unique transaction identifier (unik transaktionsidentifierare)	En unika kod som gör det möjligt att identifiera en transaktion i respektive marknadssegment.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.
Proprietary transaction identification (egen transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för varje transaktion. Den egna transaktionsidentifieringen är unik för varje transaktion per penningmarknadssegment och uppgiftslämnare.	
Related proprietary transaction identification (tillhörande transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för den ursprungliga transaktionen som senare blivit föremål för novation.	Detta fält ska rapporteras i tillämpliga fall.
Counterparty proprietary transaction identification (motpartens egna transaktionsidentifiering)	Den egna transaktionsidentifieringen som uppgiftslämnarens motpart använt för samma transaktion.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Identifiering av motparten	En identifieringskod som används för att känna igen uppgiftslämnarens motpart för den rapporterade transaktionen.	LEI-koden (Legal Entity Identifier code) ska anges i alla fall där motparten har en sådan kod. Motpartssektorn och motpartens geografiska belägenhet ska anges om LEI-kod saknas.
Motpartssektor	Motpartens institutionella sektor.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Counterparty location (motpartens geografiska belägenhet)	Internationella standardiseringsorganisationens (ISO) landskod för det land där motparten har sin hemvist.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Tri-party agent identification (identifiering av trepartsombudet)	Motpartens identifiering av trepartsombudet.	Detta fält måste rapporteras för trepartstransaktioner. LEI-koden ska anges i alla fall där ombudet har en sådan kod.
Reporting date (rapporteringsdag)	Startdag och starttid respektive slutdag och sluttid för den period som transaktionsuppgifterna i filen avser.	
Electronic time stamp (elektronisk tidsstämpel)	Den tidpunkt då en transaktion ingås eller bokförs.	
Trade date (affärsdag)	Den dag då parterna ingår den finansiella transaktionen.	
Settlement date (avvecklingsdag)	Den dag då kontantmedlen ursprungligen erhålls i utbyte mot tillgången i enlighet med avtalet.	Om öppna återköpstransaktioner rullas över är detta den dag då överföringen avvecklas, även om det inte utväxlas några kontanter.
Maturity date (förfallodag)	Återköpsdagen, dvs. den dag då kontantmedlen ska återbetalas eller erhållas i utbyte mot den tillgång som ställts eller tagits emot som säkerhet.	
Transaction type (transaktions-typ)	Detta attribut anger huruvida transaktionen utförs för att låna upp eller låna ut kontantmedel.	
Transaction nominal amount (transaktionens nominella belopp)	Det belopp i euro som ursprungligen lånats upp eller lånats ut.	
Typ av ränta	Används för att ange om instrumentet har fast eller rörlig ränta.	
Deal rate (transaktionsnivå)	Den räntenivå, uttryckt i enlighet med penningmarknadens konvention Act/360, till vilken repotransaktionen ingicks och de utlånade kontanterna ska förräntas.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med fast ränta.

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Reference rate index (index för referensräntan)	ISIN-koden (International Securities Identification Number) för den underliggande referensräntan som används för att beräkna de regelbundna räntebetalningarna.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med rörlig ränta.
Basis point spread (spread i baspunkter)	Antal baspunkter som läggs till (om spreaden är positiv) eller dras ifrån (om den är negativ) den underliggande referensräntan för att beräkna den faktiska ränta som ska tillämpas för en viss period vid emissionen av ett instrument med rörlig ränta.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med rörlig ränta.
Collateral ISIN (säkerhetens ISIN-kod)	ISIN-koden för den tillgång som ställts som säkerhet.	Det är frivilligt att rapportera detta fält för återköpsavtal med tre parter som inte utförs mot en korg av värdepapper för vilken det finns en generisk ISIN-kod, eller typer av säkerhet för vilka en ISIN-kod saknas. Om ISIN-koden för den tillgång som ställts som säkerhet saknas, måste typ av säkerhet, säkerhetens emittentsektor och säkerhetspool anges.
Collateral pool (säkerhetspool)	Anger huruvida den tillgång som ställts som säkerhet är en säkerhetspool.	
Collateral type (typ av säkerhet)	Syftar till att identifiera vilken tillgångskategori som har ställts som säkerhet.	Obligatoriskt om säkerhetens ISIN-kod ej anges.
Collateral issuer sector (säkerhetens emittentsektor)	Den institutionella sektor som emittenten av säkerheten tillhör.	Obligatoriskt om säkerhetens ISIN-kod ej anges.
Special collateral indicator (identifierare för särskild säkerhet)	Syftar till att identifiera samtliga återköpsavtal som har genomförts mot en generell säkerhet samt sådana som har genomförts mot en särskild säkerhet.	Behöver endast fyllas i om det är möjligt för uppgiftslämnaren.
Collateral nominal amount (säkerhetens nominella belopp)	Det nominella beloppet i euro för värdepapper som har ställts som säkerhet.	Frivilligt för trepartsrepor och alla transaktioner där de värdepapper som ställts som säkerhet inte identifieras via en ISIN-kod.
Collateral haircut (säkerhetens värderingsavdrag)	En riskkontrollåtgärd för underliggande säkerheter, där värdet på den underliggande säkerheten beräknas som marknadsvärdet för tillgångarna minus en viss procentsats (värderingsavdrag).	I detta fält ska transaktioner som avser enskilda säkerheter rapporteras, annars är det frivilligt.

## 2. Väsentlighetsnivå

Transaktioner som genomförs med icke-finansiella bolag bör endast rapporteras om de genomförs med icke-finansiella bolag som har klassificerats som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten (\*\*).

(\*) Standarder för elektronisk rapportering samt tekniska specifikationer för uppgifterna fastställs separat. Dessa finns på ECB:s webbplats: [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

(\*\*) Se Basel III: The liquidity coverage ratio and liquidity risk monitoring tools, Committee on Banking Supervision, januari 2013, s. 23–27, finns på webbplatsen för Banken för internationell betalningsutjämnning på [www.bis.org](http://www.bis.org).

## BILAGA II

## "BILAGA II

**Rapporteringsordning för penningmarknadsstatistik som avser transaktioner utan säkerhet**

## DEL 1

**TYP AV INSTRUMENT**

1. Uppgiftslämnarna ska rapportera följande till Europeiska centralbanken (ECB) eller den berörda nationella centralbanken:
  - a) All uppgiftslämnarens upplåning där man använder sig av de instrument som anges i nedanstående tabell, som är denominerad i euro med en löptid på upp till och med ett år (definierad som transaktioner med en förfallodag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen) från finansiella företag (utom centralbanker om transaktionen inte görs i investeringssyfte), offentlig förvaltning, eller icke-finansiella bolag som klassificeras som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.
  - b) Alla utlåningstransaktioner denominerade i euro till andra kreditinstitut med en löptid på upp till och med ett år (definierad som transaktioner med en förfallodag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen) via inlåning utan säkerhet eller sparkonton, eller via köp från de emitterande kreditinstituten av företagscertifikat, bankcertifikat, skuldebrev med rörlig ränta och andra skuldebrev med en löptid på upp till ett år.

Vid tillämpningen av punkterna a och b ovan ska koncerninterna transaktioner exkluderas.
2. I nedanstående tabell finns en mer ingående standardbeskrivning av instrumentkategorierna samt de transaktioner för vilka uppgiftslämnarna ska rapportera uppgifter till ECB. Om uppgiftslämnarna ska rapportera transaktionerna till sin nationella centralbank, bör den berörda nationella centralbanken införliva dessa beskrivningar av instrumentkategorier på nationell nivå i enlighet med denna förordning.

Typ av instrument	Beskrivning
Deposits (inlåning)	Räntebärande inlåning (inklusive sparkonton men exklusive transaktionskonton) utan säkerhet som antingen har en uppsägningstid eller också en löptid på högst ett år, dvs. upp till 397 dagar efter avvecklingsdagen, och som antingen tas emot (lånas) eller placeras (lånas ut) av uppgiftslämnaren.
Call account/Call money (sparkonton)	Likviditetskonto med daglig räntestjustering som ger rätt till räntebetalning eller -beräkning med regelbundna intervaller och där utbetalning först sker efter viss uppsägningstid. Sparkonto där utbetalning först sker efter viss uppsägningstid.
Certificate of deposit (bankcertifikat)	En skuldförbindelse med fast löptid som antingen är överlåtbar eller inte överlåtbar och som emitteras av ett monetärt finansinstitut som ger innehavaren rätt till en bestämd fast ränta för en bestämd period på upp till ett år dvs. upp till 397 dagar efter avvecklingsdagen, som antingen är räntebärande eller diskonterad.
Commercial paper (företagscertifikat)	Ett skuldinstrument utan säkerhet som emitterats av ett monetärt finansinstitut med en löptid på upp till ett år, dvs. upp till 397 dagar efter avvecklingsdagen, som antingen är räntebärande eller diskonterat.
Asset backed commercial paper (tillgångssäkrade företagscertifikat)	Ett skuldinstrument för vilken någon typ av säkerhet har ställts och som emitterats av ett monetärt finansinstitut med en löptid på upp till ett år, dvs. upp till 397 dagar efter avvecklingsdagen, som antingen är räntebärande eller diskonterat.
Floating rate note (skuldebrev med rörlig ränta)	En skuldförbindelse med en löptid på högst ett år, dvs. upp till 397 dagar efter avvecklingsdagen, där de regelbundna räntebetalningarna beräknas på grundval av värdet, dvs. genom att använda en underliggande referensränta som Euro Interbank Offered Rate (Euribor) på förutbestämda dagar, så kallade räntestjusteringsdagar.



Typ av instrument	Beskrivning
Other short-term debt securities (andra kortfristiga skuldebrev)	<p>Icke-efterställda värdepapper – utom ägarandelar – som har en löptid på upp till ett år, dvs. upp till 397 dagar efter avvecklingsdagen, som emitterats av uppgiftslämnare och som vanligen är överlåtbara och har en andrahandsmarknad, eller kan användas för avräkning på marknaden och som inte ger innehavaren någon form av äganderätt till det institut som har emitterat värdepapperet. Denna post omfattar följande:</p> <p>a) Värdepapper som ger innehavaren en ovillkorlig rätt till en fast eller avtalsenlig avkastning i form av kupongbetalningar och/eller en bestämd fast summa på en given dag (eller dagar) eller räknat från en vid emissionen bestämd dag.</p> <p>b) Icke-överlåtbara instrument som emitteras av uppgiftslämnare och som senare blir överlåtbara och bör omklassificeras som 'skuldebrev'.</p>

## DEL 2

## TYP AV UPPGIFTER

1. Typ av transaktionsbaserade uppgifter (\*) som ska rapporteras för varje transaktion:

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och ytterligare egenskaper
Reported transaction status (den rapporterade transaktionens status)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en ny transaktion, en ändring av en tidigare rapporterad transaktion, en annullering eller en rättelse av en tidigare rapporterad transaktion.	
Novation status (novationsstatus)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en novation.	
Unique transaction identifier (unik transaktionsidentifierare)	En unika kod som gör det möjligt att identifiera en transaktion i respektive marknadssegment.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.
Proprietary transaction identification (egen transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för varje transaktion. Den egna transaktionsidentifieringen är unik för varje transaktion per penningmarknadssegment och uppgiftslämnare.	
Related proprietary transaction identification (tillhörande transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för den ursprungliga transaktionen som senare blivit föremål för novation.	Detta fält ska rapporteras i tillämpliga fall.
Counterparty proprietary transaction identification (motpartens egna transaktionsidentifiering)	Den egna transaktionsidentifieringen som uppgiftslämnarens motpart använt för samma transaktion.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och ytterligare egenskaper
Identifiering av motparten	En identifieringskod som används för att känna igen uppgiftslämnarens motpart för den rapporterade transaktionen.	LEI-koden (Legal Entity Identifier code) ska anges i alla fall där motparten har en sådan kod. Motpartssektorn och motpartens geografiska belägenhet ska anges om LEI-kod saknas.
Motpartssektor	Motpartens institutionella sektor.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Counterparty location (motpartens geografiska belägenhet)	Internationella standardiseringsorganisationens (ISO) landskod för det land där motparten har sin hemvist.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Reporting date (rapporteringsdag)	Startdag och starttid respektive slutdag och sluttid för den period som transaktionsuppgifterna i filen avser.	
Electronic time stamp (elektronisk tidsstämpel)	Den tidpunkt då en transaktion ingås eller bokförs.	
Trade date (affärsdag)	Den dag då parterna ingår den rapporterade finansiella transaktionen.	
Settlement date (avvecklingsdag)	Den dag då motparterna överför betalningen eller då köpet eller försäljningen av ett skuldinstrument avvecklas.	För avistakonton och annan upplåning/utlåning utan säkerhet med uppsägningstid: den dag då inlåningen överförs (dvs. då den skulle ha återbetalats om den hade tagits ut och inte överförts).
Maturity date (förfalldodag)	Den dag då låntagaren ska återbetala det lånade beloppet till långivaren eller då ett skuldinstrument förfaller till betalning.	
Instrument type (typ av instrument)	Det instrument genom vilket inlåning/utlåningen sker.	
Transaction type (transaktionstyp)	Detta attribut anger huruvida transaktionen består i att låna upp eller låna ut kontantmedel.	
Transaction nominal amount (transaktionens nominella belopp)	Det belopp i euro som lånats ut eller lånats upp avseende inlåning. För skuldebrev utgör detta det nominella beloppet för det emitterade/köpta värdepapperet.	
Transaction deal price (transaktionspriset)	Det s.k. 'smutsiga priset' (priset inklusive upplupen ränta) till vilket ett värdepapper emitteras eller handlas i procentenheter.	Rapporteras som 100 för inlåning utan säkerhet.
Typ av ränta	Används för att ange om instrumentet har fast eller rörlig ränta.	

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och ytterligare egenskaper
Deal rate (transaktionsnivå)	Den räntenivå, uttryckt i enlighet med penningmarknadens konvention Act/360, till vilken inlåningen genomfördes och det utlånade kontantbeloppet förräntas. För skuldinstrument utgör detta den effektiva ränta, uttryckt i enlighet med penningmarknadens konvention Act/360, till vilket instrumentet har emitterats eller köpts.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med fast ränta.
Reference rate index (index för referensräntan)	ISIN-koden (International Securities Identification Number) för den underliggande referensräntan som används för att beräkna de regelbundna räntebetalningarna.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med rörlig ränta.
Basis point spread (spread i baspunkter)	Antal baspunkter som läggs till (om spreaden är positiv) eller dras av från (om den är negativ) indexet för referensräntan för att beräkna den faktiska ränta som ska tillämpas för en viss period vid emissionen av ett instrument med rörlig ränta.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med rörlig ränta.
Call or put (köp- eller säljoption)	Anger om instrumentet har en köp- eller säljoption.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med köp-/säljoption.
First call/put date (första dag för köp-/säljoption)	Den första dagen då köp- eller säljoptionen får utnyttjas.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument med en köp- eller säljoption som får utnyttjas på en eller flera förutbestämda dagar.
Call/put notice period (uppsägningstid för köp-/säljoption)	Antalet kalenderdagar som innehavaren av instrumentet/instrumentets emittent ger emittenten/innehavaren av instrumentet innan köp-/säljoption utnyttjas.	Detta fält behöver bara rapporteras för instrument/transaktioner med en uppsägningstid för köp-/säljoptioner och för inlåning med en i förväg överenskommen uppsägningstid.

## 2. Väsentlighetsnivå

Transaktioner som genomförs med icke-finansiella bolag bör endast rapporteras om de genomförs med icke-finansiella bolag som har klassificerats som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.

(\*) Standarder för elektronisk rapportering samt tekniska specifikationer för uppgifterna fastställs separat. Dessa finns på ECB:s webbplats: [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu)."

## BILAGA III

## ”BILAGA III

**Rapporteringsordning för penningmarknadsstatistik som avser derivattransaktioner**

## DEL 1

**TYP AV INSTRUMENT**

Uppgiftslämnarna ska rapportera följande till Europeiska centralbanken (ECB) eller den berörda nationella centralbanken:

- a) Alla valutaswaptransaktioner där euro vid en viss tidpunkt köps/säljs mot utländsk valuta och vid en senare tidpunkt återsäljs eller återköps till en på förhand avtalad terminkurs för denna valuta med en löptid på upp till och med ett år (definierad som transaktioner med en förfalldag som infaller högst 397 dagar efter avvecklingsdagen för spotdelen i valutaswaptransaktionen) ingångna mellan uppgiftslämnaren och finansiella bolag (utom centralbanker om transaktionen inte görs i investeringssyfte), offentlig förvaltning, eller icke-finansiella bolag som klassificeras som ’institutionell bankverksamhet’ enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.
- b) OIS-swaptransaktioner denominerade i euro mellan uppgiftslämnaren och finansiella bolag (utom centralbanker om transaktionen inte görs i investeringssyfte), offentlig förvaltning, eller icke-finansiella bolag som klassificeras som ’institutionell bankverksamhet’ enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.

Vid tillämpningen av punkt 1 a och 1 b ovan ska koncerninterna transaktioner exkluderas.

## DEL 2

**TYP AV UPPGIFTER**

1. Typ av transaktionsbaserade uppgifter (\*) för valutaswappar som ska rapporteras för varje transaktion:

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Reported transaction status (den rapporterade transaktionens status)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en ny transaktion, en ändring av en tidigare rapporterad transaktion, en annullering eller en rättelse av en tidigare rapporterad transaktion.	
Novation status (novationsstatus)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en novation.	
Unique transaction identifier (unik transaktionsidentifierare)	En unika kod som gör det möjligt att identifiera en transaktion i respektive marknadssegment.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.
Proprietary transaction identification (egen transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för varje transaktion. Den egna transaktionsidentifieringen är unik för varje transaktion per penningmarknadssegment och uppgiftslämnare.	
Related proprietary transaction identification (tillhörande transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för den ursprungliga transaktionen som senare blivit föremål för novation.	Detta fält ska rapporteras i tillämpliga fall.
Counterparty proprietary transaction identification (motpartens egna transaktionsidentifiering)	Den egna transaktionsidentifieringen som uppgiftslämnarens motpart använt för samma transaktion.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Identifiering av motparten	En identifieringskod som används för att känna igen uppgiftslämnarens motpart för den rapporterade transaktionen.	LEI-koden (Legal Entity Identifier code) ska anges i alla fall där motparten har en sådan kod. Motpartssektorn och motpartens geografiska belägenhet ska anges om LEI-kod saknas.
Motpartssektor	Motpartens institutionella sektor.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Counterparty location (motpartens geografiska belägenhet)	Internationella standardiseringsorganisationens (ISO) landskod för det land där motparten har sin hemvist.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Reporting date (rapporteringsdag)	Startdag och starttid respektive slutdag och sluttid för den period som transaktionsuppgifterna i filen avser.	
Electronic time stamp (elektronisk tidsstämpel)	Den tidpunkt då en transaktion ingås eller bokförs.	
Trade date (affärsdag)	Den dag då parterna ingår den rapporterade finansiella transaktionen.	
Spot value date (spotdag)	Den dag då en part till en annan part säljer ett bestämt belopp av en bestämd valuta mot betalning av ett överenskommet belopp av en bestämd annan valuta på basis av en överenskommen valutakurs, den så kallade valutaspotkursen.	
Maturity date (förfalldag)	Den dag då valutaswaptransaktionen löper ut och den valuta som har sålts på spotdagen återköps.	
Foreign exchange transaction type (typ av valutatransaktion)	Detta attribut anger om det eurobelopp som rapporteras under transaktionens nominella belopp köps eller säljs på spotdagen. Detta bör avse spotvärdet i euro, dvs. om euro köps eller säljs på spotdagen.	
Transaction nominal amount (transaktionens nominella belopp)	Det nominella beloppet i euro för valutaswappar.	
Foreign currency code (valutakod)	Den internationella tresiffriga ISO-koden för den valuta som köps/säljs i utbyte mot euro.	
Foreign exchange spot rate (valutaspotkurs)	Den valutakurs mellan euron och den valuta som ska tillämpas på första delen i valutaswaptransaktionen.	

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Foreign exchange forward points (valutaterminspunkter)	Differensen mellan valutaterminkursen och valutaspotkursen uttryckt i baspunkter, angiven enligt rådande marknadskonventioner för respektive valutapar.	

2. Typ av transaktionsbaserade uppgifter för OIS-transaktioner som ska rapporteras för varje transaktion:

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Reported transaction status (den rapporterade transaktionens status)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en ny transaktion, en ändring av en tidigare rapporterad transaktion, en annullering eller en rättelse av en tidigare rapporterad transaktion.	
Novation status (novationsstatus)	Detta attribut anger huruvida transaktionen är en novation.	
Unique transaction identifier (unik transaktionsidentifierare)	En unika kod som gör det möjligt att identifiera en transaktion i respektive marknadssegment.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.
Proprietary transaction identification (egen transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för varje transaktion. Den egna transaktionsidentifieringen är unik för varje transaktion per penningmarknadssegment och uppgiftslämnare.	
Related proprietary transaction identification (tillhörande transaktionsidentifiering)	Den unika interna transaktionsidentifierare som uppgiftslämnaren använder för den ursprungliga transaktionen som senare blivit föremål för novation.	Detta fält ska rapporteras i tillämpliga fall.
Counterparty proprietary transaction identification (motpartens egna transaktionsidentifiering)	Den egna transaktionsidentifieringen som uppgiftslämnarens motpart använt för samma transaktion.	Detta fält ska rapporteras om tillgängligt.
Identifiering av motparten	En identifieringskod som används för att känna igen uppgiftslämnarens motpart för den rapporterade transaktionen.	LEI-koden ska anges i alla fall där motparten har en sådan kod. Motpartssektorn och motpartens geografiska belägenhet ska anges om LEI-kod saknas.
Motpartssektor	Motpartens institutionella sektor.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Counterparty location (motpartens geografiska belägenhet)	ISO-landskoden för det land där motparten har sin hemvist.	Obligatoriskt om motparten ej identifieras.
Reporting date (rapporteringsdag)	Startdag och starttid respektive slutdag och sluttid för den period som transaktionsuppgifterna i filen avser.	

Fält	Beskrivning av uppgifter	Alternativ rapporteringsmöjlighet (i förekommande fall) och andra egenskaper
Electronic time stamp (elektronisk tidsstämpel)	Den tidpunkt då en transaktion ingås eller bokförs.	Frivilligt.
Trade date (affärsdag)	Den dag då parterna ingår den finansiella transaktionen.	
Start date (startdag)	Den dag då dagslåneräntan för den rörliga delen beräknas.	
Maturity date (förfallodag)	Löptidens sista dag då den effektiva dagslåneräntan beräknas.	
Fixed interest rate (fast ränta)	Den fasta ränta som används för att beräkna OIS-swappens utbetalade belopp.	
Transaction type (transaktions-typ)	Detta attribut anger om den fasta räntan betalas eller erhålls av uppgiftslämnaren.	
Transaction nominal amount (transaktionens nominella belopp)	OIS-swappens teoretiska belopp.	

### 3. Väsentlighetsnivå

Transaktioner som genomförs med icke-finansiella bolag bör endast rapporteras om de genomförs med icke-finansiella bolag som har klassificerats som 'institutionell bankverksamhet' enligt Basel III-regelverket för likviditetstäckningskvoten.

(\*) Standarder för elektronisk rapportering samt tekniska specifikationer för uppgifterna fastställs separat. Dessa finns på ECB:s webbplats: [www.ecb.europa.eu](http://www.ecb.europa.eu).

## BILAGA IV

## ”BILAGA IV

**Minimistandarder som ska tillämpas av den faktiska rapporterande populationen**

Uppgiftslämnarna ska tillämpa följande minimistandarder för att uppfylla Europeiska centralbankens (ECB:s) statistikrapporteringskrav:

## 1. Minimistandarder för dataöverföring:

- i) Rapporteringen ska ske snabbt och inom de tidsramar som fastställts av ECB och den berörda nationella centralbanken.
- ii) Statistikrapporterna ska till form och uppställning följa de tekniska rapporteringskrav som fastställts av ECB och den berörda nationella centralbanken.
- iii) Uppgiftslämnarna ska informera ECB och den berörda nationella centralbanken om namnen på en eller flera kontaktpersoner.
- iv) De tekniska specifikationerna för dataöverföringen till ECB och den berörda nationella centralbanken ska följas.

## 2. Minimistandarder för noggrannhet:

- i) De statistiska uppgifterna ska vara exakta.
- ii) Uppgiftslämnarna ska kunna lämna information om den utveckling som inrapporterade data visar.
- iii) De statistiska uppgifterna måste vara fullständiga och får inte innehålla fortlöpande och strukturella luckor: existerande luckor i uppgifterna ska påpekas och förklaras för ECB och den berörda nationella centralbanken, och i förekommande fall snarast möjligt rättas till.
- iv) Uppgiftslämnarna ska tillämpa de enheter, avrundningsregler och decimaler som föreskrivits av ECB och den berörda nationella centralbanken för den tekniska överföringen av uppgifter.

## 3. Minimistandarder för begreppsmässig överensstämmelse:

- i) Statistiken ska överensstämma med definitioner och klassificeringar i den här förordningen.
- ii) Vid avvikande definitioner och klassificeringar ska uppgiftslämnarna regelbundet följa upp och kvantifiera skillnaderna mellan använda mått och måtten enligt den här förordningen.
- iii) Uppgiftslämnarna ska kunna förklara avbrott i inrapporterade data jämfört med uppgifterna för föregående period.

## 4. Minimistandarder för revidering:

De revideringsprinciper och -rutiner som fastställts av ECB och den berörda nationella centralbanken ska följas. Avvikelser från normala revideringsförfaranden ska förklaras i noter.

## 5. Minimistandarder för dataintegritet:

- i) Statistisk information ska sammanställas och överföras av uppgiftslämnare på ett opartiskt och objektiva sätt.
  - ii) Fel i de överförda uppgifterna ska rättas av uppgiftslämnarna och dessa ska meddela ECB och den berörda nationella centralbanken om detta snarast möjligt.”
-