ORIENTĂRI

BANCA CENTRALĂ EUROPEANĂ

ORIENTAREA BĂNCII CENTRALE EUROPENE

din 19 decembrie 2008

de modificare a Orientării BCE/2007/9 privind statistica monetară și statistica privind instituțiile și piețele financiare (reformare)

(BCE/2008/31)

(2009/160/CE)

CONSILIUL GUVERNATORILOR BĂNCII CENTRALE EUROPENE,

având în vedere Statutul Sistemului European al Băncilor Centrale și al Băncii Centrale Europene, în special articolele 5.1, 12.1 și 14.3,

având în vedere Regulamentul (CE) nr. 25/2009 al Băncii Centrale Europene din 19 decembrie 2008 privind bilanțul sectorului instituții financiare monetare (reformare) (BCE/2008/32) ([1]),

având în vedere Regulamentul (CE) nr. 2533/98 al Consiliului din 23 noiembrie 1998 privind colectarea informațiilor statistice de către Banca Centrală Europeană ([2]),

având în vedere Directiva 86/635/CEE a Consiliului din 8 decembrie 1986 privind conturile anuale și conturile consolidate ale băncilor și ale altor instituții financiare ([3]),

având în vedere Orientarea BCE/2006/16 din 10 noiembrie 2006 privind cadrul juridic al procedurilor contabile și al raportării financiare din Sistemul European al Băncilor Centrale ([4]),

având în vedere anexa A la Regulamentul (CE) nr. 2223/96 al Consiliului din 25 iunie 1996 privind Sistemul European de conturi naționale și regionale din Comunitate ([5]),

având în vedere Regulamentul (CE) nr. 24/2009 al Băncii Centrale Europene din 19 decembrie 2008 privind statisticile referitoare la activele și pasivele societăților vehicul investițional angajate în operațiuni de securitizare (BCE/2008/30) ([6]),

întrucât:

(1) Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30) privind statisticile referitoare la activele și pasivele societăților vehicul investițional angajate în operațiuni de securitizare (denumite în continuare „SVI") prevede că, în anumite condiții, SVI pot fi exonerate de la îndeplinirea unora sau tuturor obligațiilor de raportare statistică stabilite de Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30) și că, în schimb, băncile centrale naționale (BCN) pot să extragă datele solicitate din alte surse de date statistice, publice sau de supraveghere.

(2) Datele privind titlurile de valoare emise de SVI și/sau titlurile de valoare deținute de SVI pot fi extrase dintr-o bază de date centralizată a titlurilor de valoare (*Centralised Securities Database*, CSDB); prin urmare, o CSDB funcțională este esențială pentru a permite extragerea datelor privind titlurile de valoare emise de SVI și/sau titlurile de valoare deținute de SVI,

ADOPTĂ PREZENTA ORIENTARE:

Articolul 1

Orientarea BCE/2007/9 ([7]) se modifică după cum urmează:

1. Se introduce următorul articol 18a:

„*Articolul 18a*

Statistici privind activele și pasivele SVI

([1]) JO L 15, 20.1.2009, p. 14.
([2]) JO L 318, 27.11.1998, p. 8.
([3]) JO L 372, 31.12.1986, p. 1.
([4]) JO L 348, 11.12.2006, p. 1.
([5]) JO L 310, 30.11.1996, p. 1.
([6]) JO L 15, 20.1.2009, p. 1.
([7]) JO L 341, 27.12.2007, p. 1.

1. ***Domeniul de aplicare al raportării***

BCN compilează și raportează informații statistice agregate separate privind activele și pasivele SVI în conformitate cu partea 15 din anexa III la prezenta orientare. Datele se transmit pentru următoarele trei subcategorii: (i) SVI angajate în operațiuni de securitizare tradițională; (ii) SVI angajate în operațiuni de securitizare sintetică; și (iii) alte SVI.

În sensul statisticilor SVI, securitizarea tradițională se referă la securitizările în cadrul cărora transferul riscului se realizează prin transferul economic către SVI al activelor care sunt securitizate. Acesta se realizează prin transferul proprietății activelor securitizate de la inițiator sau prin subparticipare.

Securitizarea sintetică se referă la securitizările în cadrul cărora transferul riscului se realizează prin utilizarea instrumentelor financiare derivate de acoperire a riscului de credit, a garanțiilor sau a altui mecanism similar.

Aceste cerințe se referă la datele privind soldurile existente la sfârșit de trimestru, tranzacțiile financiare și anulările/reducerile furnizate trimestrial.

BCN pot transmite BCE datele solicitate privind anulările/reducerile cu maxima diligență posibilă.

2. ***Frecvența raportării și termenul limită***

BCN raportează trimestrial către BCE datele privind soldurile SVI, tranzacțiile financiare și anulările/reducerile, până la încheierea activității în cea de-a douăzeci și opta zi lucrătoare următoare sfârșitului de trimestru la care se referă datele.

3. ***Politica de revizuire a datelor***

Următoarele reguli generale se aplică revizuirii datelor trimestriale:

(a) pe parcursul perioadelor regulate de compilare, adică din cea de-a douăzeci și opta zi lucrătoare care urmează sfârșitului trimestrului de referință până în ziua precedentă zilei în care datele sunt retransmise către BCN, BCN pot revizui datele referitoare la trimestrul de referință precedent;

(b) în afara perioadelor regulate de compilare, BCN pot, de asemenea, să revizuiască datele referitoare la perioadele de referință anterioare trimestrului de referință precedent, între altele, în caz de greșeli, reclasificări sau proceduri de raportare îmbunătățite;

(c) atunci când prezintă relevanță, se includ în statisticile SVI, în conformitate cu literele (a) și (b), revizuirile datelor raportate în temeiul Regulamentului (CE) nr. 25/2009 al Băncii Centrale Europene (BCE/2008/32) (*) în ceea ce privește creditele inițiate și administrate de IFM din zona euro.

4. ***Metode de raportare***

Pentru a îndeplini cerințele de raportare statistică de la care SVI sunt scutite în temeiul articolului 5 alineatul (1) litera (c) din Regulamentul (CE) nr. 24/2009 al Băncii Centrale Europene (BCE/2008/30) (**), BCN, după ce consultă BCE, hotărăsc asupra abordării corespunzătoare în privința compilării activelor și pasivelor SVI, în funcție de organizarea piețelor aferente și de disponibilitatea în statul membru a altor informații statistice, publice sau de supraveghere relevante.

5. ***Sursele datelor și standardele privind calitatea datelor***

În cazul în care BCN extrag datele privind titlurile de valoare emise de SVI și/sau privind titlurile de valoare deținute de SVI dintr-o CSDB ori dintr-o altă bază de date a titlurilor de valoare și/sau datele privind activele și pasivele SVI din alte surse de date statistice, din surse publice, cum sunt rapoartele anterioare vânzării sau rapoartele investitorilor, ori surse de date de supraveghere, se aplică standardele de calitate a datelor descrise mai jos.

Astfel după cum se menționează în partea 15 din anexa III la prezenta orientare, se face o distincție între seriile ancoră (*anchor series*), care sunt supuse unor standarde de calitate înalte, în comparație cu datele raportate în mod direct de către SVI în conformitate cu anexa III la Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30) și care sunt verificabile ulterior (ex-post) așa după cum se subliniază la alineatul (9) și *serii non-ancoră* (*non-anchor series*) care pot fi apreciate potrivit unor standarde de calitate mai puțin riguroase (***).

În cazul în care BCN extrag datele privind activele și pasivele SVI din surse de date de supraveghere, BCN se asigură că aceste surse sunt armonizate de o manieră suficientă, conform cerințelor de raportare ale SVI, cu conceptele și definițiile statistice. Aceeași regulă se aplică datelor care sunt extrase din alte surse de date statistice.

În cazul în care datele nu sunt raportate direct de către SVI în conformitate cu articolul 5 alineatul (1) litera (c) din Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30), calitatea datelor se monitorizează de către BCN pe baza informațiilor disponibile din declarațiile financiare anuale, astfel cum se subliniază la alineatul (9). În cazul în care verificările încrucișate între datele extrase trimestrial și declarațiile financiare anuale demonstrează că standardele înalte de calitate nu sunt îndeplinite, BCN iau măsurile necesare pentru a se asigura că datele îndeplinesc standardele de calitate impuse, inclusiv posibila colectare directă a datelor în temeiul Regulamentului (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30).

În cazul în care datele privind soldurile și noile emisiuni de titluri de creanță ale SVI și/sau titlurile de valoare deținute de SVI sunt compilate din CSDB sau dintr-o altă bază de date a titlurilor de valoare, BCN asigură o sferă de acoperire largă a titlurilor de valoare emise de SVI și/sau a titlurilor de valoare deținute de SVI și monitorizează astfel de date periodic astfel cum se prevede la alineatul (10). În cazul în care sfera de acoperire și indicatorii de calitate pentru setul relevant de titluri de valoare din CSDB sau altă bază de date a titlurilor de valoare indică neîndeplinirea standardelor de calitate, BCN iau măsurile necesare pentru îndeplinirea standardelor de calitate impuse, inclusiv posibila colectare directă a datelor în temeiul Regulamentului (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30).

6. ***Creditele inițiate și administrate de IFM din zona euro și schimbul transfrontalier de informații***

În conformitate cu articolul 5 din Regulamentul (CE) nr. 25/2009 (BCE/2008/32), BCN colectează datele cu privire la creditele achiziționate de SVI care sunt inițiate și administrate de IFM din zona euro și sunt defalcate în funcție de scadență, sector și rezidența debitorilor, astfel după cum se menționează în partea 15 din anexa III la prezenta orientare.

Dacă inițiatorii creditelor securitizate sunt IFM rezidente în aceeași țară ca și SVI, iar aceste IFM naționale continuă să administreze activele securitizate, BCN poate compila această parte a datelor privind portofoliul de credite al SVI, în ceea ce privește soldurile și tranzacțiile financiare, pornind de la datele colectate de la IFM naționale, astfel cum se precizează în articolul 5 din Regulamentul (CE) nr. 25/2009 (BCE/2008/32), în loc să colecteze aceste date direct de la SVI.

Dacă inițiatorii creditelor securitizate sunt IFM rezidente într-un alt stat membru din zona euro, iar aceste IFM continuă să administreze active securitizate, BCN schimbă informațiile colectate de la aceste IFM în conformitate cu articolul 5 din Regulamentul (CE) nr. 25/2009 (BCE/2008/32). Fiecare BCN colectează informațiile în conformitate cu articolul 5 din Regulamentul (CE) nr. 25/2009 (BCE/2008/32) cu privire la creditele inițiate și administrate de IFM naționale și care au fost securitizate la o SVI rezidentă în alt stat membru din zona euro.

În scopul schimbului transfrontalier de informații, fiecare BCN transmite informații către BCE cu privire la creditele inițiate și administrate de IFM naționale în temeiul articolului 5 din Regulamentul (CE) nr. 25/2009 (BCE/2008/32) în conformitate cu partea 15 din anexa III la prezenta orientare.

BCN raportează aceste date către BCE până la sfârșitul celei de-a douăzeci și treia zi lucrătoare următoare sfârșitului trimestrului la care se referă datele.

BCE asigură, în conformitate cu actele juridice aplicabile privind protecția datelor confidențiale, modalitățile tehnice pentru realizarea schimbului transfrontalier de informații. BCE redistribuie datele respectivelor BCN în cea de-a douăzeci și patra zi lucrătoare următoare sfârșitului trimestrului la care se referă datele.

BCN implicate în schimbul de date pentru securitizările existente clarifică orice întrebări existente și chestiuni de coordonare pe o bază bilaterală și, dacă este cazul, schimbă informații relevante. În cazul în care există securitizări noi, BCN relevante pot solicita BCE să acționeze în calitate de coordonator.

7. ***Derogări și extrapolări***

În cazul în care BCN compilează date privind activele și pasivele SVI direct de la SVI și dacă este relevant, pe baza datelor raportate de IFM în temeiul Regulamentului (CE) nr. 25/2009 (BCE/2008/32) și dacă BCN acordă derogări SVI în conformitate cu articolul 5 alineatul (1) litera (b) din Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30), BCN extind sfera de acoperire până la 100 % pentru toate SVI atunci când compilează date privind activele și pasivele trimestriale ale SVI raportate către BCE pentru solduri, tranzacții financiare și anulări/reduceri.

În cazul în care BCN compilează date privind activele și pasivele SVI din alte surse statistice, publice și/sau de supraveghere, acestea pot efectua compilarea pe baza unui eșantion de SVI, atât timp cât aceste SVI reprezintă cel puțin 95 % din totalul soldurilor activelor SVI în calitate de unitate de observare statistică de referință cu obligații de raportare dintr-un stat membru relevant, astfel cum este reprezentat în lista SVI. BCN extind sfera de acoperire până la 100 % atunci când compilează datele trimestriale privind activele și pasivele SVI raportate trimestrial BCE pentru solduri, tranzacții financiare și anulări/reduceri.

8. ***Note explicative***

BCN transmit BCE note explicative prin care prezintă motivele revizuirilor semnificative, precum și ale oricăror alte revizuiri făcute conform articolului 18a alineatul (3) litera (b) din prezenta orientare.

9. ***Monitorizarea calității datelor care nu sunt raportate direct de SVI sau IFM***

BCN verifică calitatea datelor trimestriale care nu sunt raportate direct de SVI sau IFM în conformitate cu articolul 5 alineatul (3) din Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30), pe baza informațiilor disponibile din declarațiile financiare anuale.

Rezultatul verificărilor calității se transmite BCE până la sfârșitul lunii septembrie a fiecărui an sau la cea mai apropiată dată imediat următoare în conformitate cu practicile juridice naționale aplicabile în statul membru de rezidență a SVI.

10. ***Monitorizarea calității CSDB sau a altei baze de date a titlurilor de valoare în contextul titlurilor de valoare emise de SVI***

În cazul în care CSDB sau o altă bază de date a titlurilor de valoare este folosită ca sursă de date pentru statisticile SVI în conformitate cu alineatul (5), BCN transmit anual BCE indicatori privind sfera de acoperire și calitatea setului relevant de titluri de valoare din CSDB sau cealaltă bază de date a titlurilor de valoare în conformitate cu metodologia care urmează să fie comunicată separat BCN.

Informațiile sus-menționate se transmit BCE până la sfârșitul lunii februarie a fiecărui an, luând ca perioadă de referință datele de la sfârșitul lunii decembrie a anului precedent.

(*) JO L 15, 20.1.2009, p. 14.
(**) JO L 15, 20.1.2009, p. 1.
(***) De exemplu, estimările, cum sunt interpolările și extrapolările, pot fi necesare atunci când datele se colectează din surse publice sau de supraveghere cu o frecvență mai redusă decât cea trimestrială și la un termen mai lung decât cea de-a douăzeci și opta zi lucrătoare următoare perioadei de referință.”

2. Se introduce următorul articol 20a:

„*Articolul 20a*

Lista SVI întocmită în scopuri statistice

1. ***Domeniul de aplicare al raportării***

Variabilele culese pentru stabilirea și menținerea listei SVI întocmită în scopuri statistice, prevăzută la articolul 3 din Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30), sunt specificate în anexa VIII la prezenta orientare.

BCN raportează actualizări ale variabilelor specificate în partea 1 din anexa VIII la prezenta orientare, fie când au loc schimbări în sectorul SVI, de exemplu o instituție intră în sectorul SVI sau o SVI iese din sectorul SVI, fie când se produc schimbări în atributele SVI.

BCN obțin actualizări prin compararea listei lor naționale a SVI de la sfârșitul a două trimestre succesive, adică acestea nu iau în considerare modificările care au loc în cursul trimestrului.

În cazul în care este raportată o nouă instituție sau o instituție care urmează a fi modificată, BCN completează toate variabilele obligatorii.

În cazul în care este raportată o instituție care iese din sectorul SVI, BCN raportează cel puțin următoarele informații: tipul cererii, adică de eliminare, și codul de identificare a SVI, adică variabila «fvc_id».

Atunci când este posibil, BCN nu realocă noilor SVI sau SVI modificate codurile de identificare SVI ale SVI eliminate.

În cazul raportării actualizărilor, BCN pot utiliza setul lor de caractere naționale, cu condiția să utilizeze alfabetul latin. BCN folosesc Unicode pentru a afișa corect toate seturile de caractere speciale atunci când primesc informații de la BCE prin intermediul Sistemului de schimb de date RIAD.

Înainte de transmiterea actualizărilor către BCE, BCN efectuează verificările de validare prevăzute în partea 2 din anexa VIII la prezenta orientare.

2. ***Frecvența raportării și termenul limită***

BCN transmit BCE actualizări ale variabilelor prevăzute în partea 1 din anexa VIII la prezenta orientare, cel puțin trimestrial, în termen de paisprezece zile lucrătoare de la data de referință.

3. ***Standarde de transmitere***

BCN transmit actualizări prin fișiere în format XML. BCE procesează apoi datele prin intermediul Sistemului de schimb de date RIAD. În cazul în care EXDI și/sau Sistemul de schimb de date RIAD nu funcționează, actualizările se transmit în format XML, prin intermediul contului Cebamail N13. În cazul în care sistemul Cebamail nu este funcțional pentru transferul fișierelor cu actualizări sau corecturi referitoare la SVI, BCN transferă aceste fișiere prin e-mail, în format XML, la următoarea adresă: birs@ecb.europa.eu.

BCN care folosesc proceduri de introducere manuală a datelor, instituie un set corespunzător de controale, pentru a minimiza erorile de operare și pentru a asigura acuratețea și consecvența actualizărilor SVI raportate prin intermediul Sistemului de schimb de date RIAD.

4. ***Confirmările de primire și de eroare***

La primirea actualizărilor, adică a celor mai noi informații disponibile, BCE efectuează imediat verificările de validare conform părții 2 din anexa VIII la prezenta orientare.

BCE transmite imediat BCN următoarele: (i) o confirmare de primire care conține informații concise privind actualizările SVI care au fost procesate și implementate cu succes în setul de date privind SVI al BCE; și/sau (ii) o confirmare de eroare care conține informații detaliate privind actualizările SVI și verificările de validare care au eșuat. În conformitate cu partea 1 din anexa VIII la prezenta orientare, BCE implementează, total sau parțial, o variabilă «object_request» incompletă, incorectă sau lipsă ori o respinge.

La primirea unei confirmări de eroare, BCN acționează imediat pentru a transmite informațiile corectate. În cazul în care nu este posibilă acțiunea imediată, BCN au la dispoziție maxim două zile lucrătoare, adică până la 17:59 ora Europei Centrale (CET) din a doua zi lucrătoare, pentru a raporta informațiile corectate, de la termenul pentru raportare prevăzut la alineatul (2).

5. ***Transmiterea listei SVI***

BCE face o copie a setului de date privind SVI, excluzând valorile marcate ca fiind confidențiale, la ora 18:00 CET din a doua zi lucrătoare următoare termenului pentru raportare prevăzut la alineatul (2). Informațiile actualizate se publică la ora 12:00 CET în ziua următoare.

BCE nu publică valorile care au fost marcate ca fiind confidențiale.

În același timp cu publicarea pe site-ul său a listei SVI, BCE transmite lista către BCN prin intermediul Sistemului de schimb de date RIAD."

3. Anexa III se modifică și anexa VIII se adaugă în conformitate cu anexa la prezenta orientare.

4. În glosar, definiția societăților vehicul investițional se înlocuiește cu următoarea:

„**Societățile vehicul investițional angajate în operațiuni de securitizare:** sunt definite la articolul 1 alineatul (1) din Regulamentul (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30)."

Articolul 2

Intrarea în vigoare

Prezenta orientare intră în vigoare în a douăzecea zi de la data publicării în *Jurnalul Oficial al Uniunii Europene*.

Articolul 3

Destinatari

Prezenta orientare se adresează tuturor băncilor centrale ale Eurosistemului.

Adoptată la Frankfurt pe Main, 19 decembrie 2008.

În numele Consiliului guvernatorilor BCE

Președintele BCE

Jean-Claude TRICHET

ANEXĂ

1. Următoarea parte 15 se adaugă la anexa III:

„PARTEA 15

Tabel de raportare SVI

Tabelul 1

Solduri și tranzacții financiare

Date care trebuie furnizate trimestrial

	A. Național										B. Alte state membre participante										C. RL	D. Total
	Total	IFM	Non-IFM – Total								Total	IFM	Non-IFM – Total									
						Alți rezidenți										Alți rezidenți						
				Administrația publică	Total	Alți intermediari financiari + auxiliari financiari (S.123+S.124)	din care SVI	Societăți de asigurare și fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației + instituții fără scop lucrativ în serviciul gospodăriilor populației (S.14+S.15)				Administrația publică	Total	Alți intermediari financiari + auxiliari financiari (S.123+S.124)	din care SVI	Societăți de asigurare și fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației + instituții fără scop lucrativ în serviciul gospodăriilor populației (S.14+S.15)		
ACTIVE																						
1. **Creanțe din depozite și credite**		ANC					ANC					ANC					ANC					ANC
2. **Credite securitizate**																						ANC
2a IFM din zona euro, în calitate de inițiator (scadența totală)				ANC/IFM		ANC/IFM		ANC/IFM		ANC/IFM				ANC/IFM		ANC/IFM		ANC/IFM		ANC/IFM		ANC/IFM
cu scadența până la 1 an									ANC/IFM										ANC/IFM			
cu scadența la peste 1 an și până la 5 ani									ANC/IFM										ANC/IFM			
cu scadența la peste 5 ani									ANC/IFM										ANC/IFM			
2b administrația publică din zona euro, în calitate de inițiator																						ANC
2c AIF și SAFP din zona euro, în calitate de inițiator																						ANC
2d societăți nefinanciare din zona euro, în calitate de inițiator																						ANC
2e inițiator din afara zonei euro																						ANC

	A. Național										B. Alte state membre participante										C. RL	D. Total
	Total	IFM	Non-IFM – Total		Alți rezidenți						Total	IFM	Non-IFM – Total		Alți rezidenți							
				Administrația publică	Total	Alți intermediari financiari + auxiliari financiari (S.123+S.124)	din care SVI	Societăți de asigurare și fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației + instituții fără scop lucrativ în serviciul gospodăriilor populației (S.14+S.15)						Alți intermediari financiari + auxiliari financiari (S.123+S.124)	din care SVI	Societăți de asigurare și fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației + instituții fără scop lucrativ în serviciul gospodăriilor populației (S.14+S.15)		
3. **Titluri de valoare, altele decât acțiunile**																						ANC
cu scadența până la 1 an		NON-ANC	NON-ANC				NON-ANC					NON-ANC	NON-ANC				NON-ANC				NON-ANC	
cu scadența la peste 1 an și până la 2 ani		NON-ANC	NON-ANC				NON-ANC					NON-ANC	NON-ANC				NON-ANC				NON-ANC	
cu scadența la peste 2 ani		NON-ANC	NON-ANC				NON-ANC					NON-ANC	NON-ANC				NON-ANC				NON-ANC	
4. **Alte active securitizate**																						ANC
4a din care administrația publică din zona euro, în calitate de inițiator																						ANC
4b din care societăți nefinanciare din zona euro, în calitate de inițiator																						ANC
5. **Acțiuni și alte titluri de participație**							NON-ANC										NON-ANC					NON-ANC
6. **Instrumente financiare derivate**																						ANC
7. **Active fixe**																						NON-ANC
8. **Alte active**																						NON-ANC

	A. Național										B. Alte state membre participante										C. RL	D. Total
	Total	IFM	Non-IFM – Total								Total	IFM	Non-IFM – Total									
						Alți rezidenți										Alți rezidenți						
				Administrația publică	Total	Alți intermediari financiari + auxiliari financiari (S.123+S.124)	din care SVI	Societăți de asigurare și fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației + instituții fără scop lucrativ în serviciul gospodăriilor populației (S.14+S.15)				Administrația publică	Total	Alți intermediari financiari + auxiliari financiari (S.123+S.124)	din care SVI	Societăți de asigurare și fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației + instituții fără scop lucrativ în serviciul gospodăriilor populației (S.14+S.15)		
PASIVE																						
9. **Credite și depozite atrase**							ANC										ANC					ANC
10. **Titluri de creanță emise**																						
cu scadența până la 1 an																						ANC
cu scadența la peste 1 an și până la 2 ani																						ANC
cu scadența la peste 2 ani																						ANC
11. **Capital și rezerve**																						ANC
12. **Instrumente financiare derivate**																						ANC
13. **Alte pasive**																						NON-ANC

ANC: serii ancoră
NON-ANC: serii non-ancoră
ANC/IFM: serii ancoră care sunt extrase parțial din datele colectate direct de la IFM potrivit Regulamentului (CE) nr. 24/2009 (BCE/2008/30) atunci când IFM din zona euro sunt inițiatorii și prestatorii creditelor

Tabelul 2

Anulări/reduceri

Date care trebuie furnizate trimestrial

	D. Total
ACTIVE	
2 **Credite securitizate**	

Tabelul 3

Solduri care urmează să fie schimbate între BCN

Posturi din bilanț	Total (1)	A. Național						B. Alte state membre participante					
		Admin. publică (S. 13)	Alte sectoare rezidente					Admin. publică (S. 13)	Alte sectoare rezidente				
		Total	Total	AIF & auxiliari financiari (S.123 + S.124)	Soc. de asig. & fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației (S.14+S.15)	Total	Total	AIF & auxiliari financiari (S.123 + S.124)	Soc. de asig. & fonduri de pensii (S.125)	Societăți nefinanciare (S.11)	Gospodăriile populației (S.14+S.15)
ACTIVE													
Credite securitizate													
SVI situate într-o țară din zona euro A													
SVI situate într-o țară din zona euro B													
SVI situate într-o țară din zona euro C													
etc.													
cu scadența de până la 1 an													
SVI situate într-o țară din zona euro A													
SVI situate într-o țară din zona euro B													
SVI situate într-o țară din zona euro C													
etc.													
cu scadența la peste 1 an și până la 5 ani													
SVI situate într-o țară din zona euro A													
SVI situate într-o țară din zona euro B													
SVI situate într-o țară din zona euro C													
etc.													
cu scadența la peste 5 ani													
SVI situate într-o țară din zona euro A													
SVI situate într-o țară din zona euro B													
SVI situate într-o țară din zona euro C													
etc.													

(1) Include teritoriul național, alte state membre participante din zona euro și restul lumii.”

2. Se adaugă următoarea anexă VIII:

„*ANEXA VIII*

LISTA SVI STABILITĂ ÎN SCOPURI STATISTICE

PARTEA 1

Variabilele pentru raportarea listei societăților vehicul investițional (SVI) stabilite în scopuri statistice

Denumirea variabilei	Descrierea variabilei	Statut
object_request	Această variabilă arată tipul de actualizare cu privire la SVI și poate avea una dintre cele șase valori predefinite: «fvc_req_new» cerere de introducere a unei noi SVI «fvc_req_mod»: cerere privind modificările unei SVI existente «fvc_req_del»: cerere de eliminare a unei SVI «fvc_req_realloc»: cerere de realocare a codului de identificare a unei SVI eliminate unei noi SVI «fvc_req_mod_id_realloc»: cerere de realocare a codului de identificare a unei SVI eliminate unei noi SVI «fvc_req_mod_id»: cerere de schimbare a codului de identificare («fvc_id») a unei SVI, într-un cod de identificare diferit	Obligatorie
fvc_confidentiality_flag	Această variabilă indică statutul de confidențialitate al întregii înregistrări. Se selectează una dintre cele trei valori predefinite: «F» (liber, neconfidențial), «N» (confidențial; poate fi eliberat numai pentru uzul Sistemului European al Băncilor Centrale (SEBC); nu se eliberează pentru uz extern) sau «C» (confidențial; nu se eliberează pentru SEBC sau pentru public) În cazul în care se solicită confidențialitatea parțială a oricărei variabile speciale, se folosește valoarea «F»	Obligatorie
fvc_id	Cheia de bază pentru setul de date al SVI este codul unic de identificare (denumit în continuare «codul id») al fiecărei SVI Aceasta este alcătuită din două părți: «host» și «id» Valorile combinate ale celor două părți ar trebui să garanteze că «fvc_id» este unic pentru SVI respectivă	Obligatorie
host	Codul de țară ISO, format din două caractere pentru țara în care este înregistrată SVI, una dintre cele două părți ale variabilei «fvc_id» (a se vedea mai sus)	Obligatorie când face parte din codul id
id	Codul id al SVI, una dintre cele două părți ale variabilei «fvc_id» (a se vedea mai sus)	Obligatorie când face parte din codul id
name	Întreaga denumire înregistrată a SVI, inclusiv forma sa juridică, de exemplu Plc, Ltd, SpA etc.	Obligatorie
address	Detaliile privind localizarea SVI sau a societății sale de administrare, după caz, compusă din patru părți: «postal_address», «postal_box», «postal_code» și «city»	Obligatorie pentru cererile «new» și «mod»
postal_address	Denumirea străzii și numărul imobilului	Obligatorie pentru cererile «new» și «mod»

Denumirea variabilei	Descrierea variabilei	Statut
postal_box	Numărul căsuței de la oficiul poștal, folosind convențiile naționale de numerotare	Obligatorie pentru cererile «new» și «mod»
postal_code	Codul poștal, folosind convențiile poștale naționale	Obligatorie pentru cererile «new» și «mod»
city	Localitatea unde este situată	Obligatorie pentru cererile «new» și «mod»
management company name	Întreaga denumire înregistrată a societății de administrare a SVI În cazul în care această informație lipsește, trebuie raportată valoarea «not available» (atunci când SVI are o societate de administrare) sau valoarea «not applicable» (atunci când SVI nu are o societate de administrare)	Obligatorie
management company name_confidentiality _flag	Această variabilă arată statutul de confidențialitate al informației cu privire la denumirea societății de administrare Se selectează una dintre cele trei valori predefinite: «F» (liber, neconfidențial), «N» (confidențial; poate fi eliberat numai pentru uzul SEBC; nu se eliberează pentru uz extern) sau «C» (confidențial; nu se eliberează pentru SEBC sau pentru public)	Obligatorie
nature of securitisation	Această variabilă arată tipul securitizării realizate de SVI Se selectează una dintre cele patru valori predefinite: «traditional», «synthetic», «other» sau «not available»	Obligatorie
nature of securitisation _confidentiality_flag	Această variabilă arată statutul de confidențialitate al informației cu privire la natura securitizării Se selectează una dintre cele trei valori predefinite: «F» (liber, neconfidențial), «N» (confidențial; poate fi eliberat numai pentru uzul SEBC; nu se eliberează pentru uz extern) sau «C» (confidențial; nu se eliberează pentru SEBC sau pentru public)	Obligatorie
ISIN codes	Această variabilă arată codurile ISIN [1] pentru fiecare clasă de titluri de valoare pentru o singură securitizare, emise de SVI Variabila este compusă din mai multe părți, inclusiv trimiterea la: «ISIN_1», «ISIN_2», «ISIN_3», «ISIN_4» și «ISIN_n» Ca o cerință minimă, cel puțin unul dintre codurile ISIN (ISIN_1) trebuie raportat În cazul raportării unei SVI pentru care codurile ISIN nu sunt aplicabile sau nu sunt disponibile, termenul de 12 caractere «XXXXXXXXXXXX» trebuie să fie raportat pentru «ISIN_1»	Obligatorie
free_text	Informații explicative cu privire la SVI	

[1] Numărul internațional de identificare a titlurilor de valoare: un cod care identifică în mod unic o emisiune de titluri, compus din 12 caractere alfanumerice.

PARTEA 2

Verificări de validare

1. *Verificări generale*

Se verifică dacă:

— toate variabilele obligatorii au fost completate;

— valoarea variabilei «object_request» este de unul dintre cele șase tipuri predefinite prevăzute în partea 1 din prezenta anexă («fvc_req_new», «fvc_req_mod», «fvc_req_del», «fvc_req_realloc», «fvc_req_mod_id_realloc», «fvc_req_mod_id»), în funcție de felul informației transmise; și

— BCN utilizează alfabetul latin atunci când raportează actualizări către Banca Centrală Europeană (BCE).

2. *Verificări ale codului id*

Se verifică dacă:

— variabila «fvc_id» este alcătuită din două părți separate, o variabilă «host» și o variabilă «id», și valorile combinate ale celor două părți garantează că «fvc_id» este unic pentru o SVI;

— valoarea variabilei «host» pentru o SVI este codul de țară ISO, format din două caractere;

— un cod de identificare utilizat anterior nu este alocat unei noi SVI. În cazul în care o asemenea acțiune nu poate fi evitată, BCN trebuie să trimită BCE o solicitare «fvc_req_realloc»;

— la raportarea unei schimbări a codului id pentru o SVI existentă, se folosește o cerere specifică de tip «fvc_req_mod_id»; și

— la raportarea unei schimbări a codului id cu un cod id șters anterior, se folosește o cerere specifică de tip «fvc_req_mod_id_realloc».

În cazul în care codul de identificare a fost deja folosit (fie pentru o SVI existentă, fie pentru o SVI care a fost anterior eliminată) și cererea nu este de tip «fvc_req_mod_id_realloc» ori noul cod de identificare a SVI nu există în lista curentă, BCE respinge cererea.

Dacă variabila «fvc_id» este incompletă, incorectă sau lipsește, BCE respinge întreaga cerere.

3. *Denumire*

Se verifică dacă:

— această variabilă arată denumirea SVI;

— denumirea SVI, inclusiv forma juridică a acesteia, este raportată consecvent pentru toate denumirile, după caz;

— se respectă regula minusculelor, pentru a putea ține seama de accente; și

— sunt folosite minusculele atunci când este cazul.

Dacă variabila «name» lipsește, BCE respinge întreaga cerere.

4. *Adresă*

Se verifică dacă:

— este completată cel puțin una dintre variabilele «postal_address», «postal_box» sau «postal_code» privind adresa;

— variabila «postal_address» arată numele și numărul străzii unde se află SVI (sau societatea de administrare, după caz);

— variabila «postal_box» utilizează convențiile naționale de numerotare și nicio trimitere textuală la căsuța unui oficiu poștal nu este plasată în fața numerelor «postal_box»; și

— variabila «postal_code» folosește convențiile poștale naționale și specifică codul poștal relevant.

În cazul în care cel puțin una dintre variabilele privind «address» lipsește, BCE respinge întreaga cerere.

5. *Localitate*

Se verifică dacă:

variabila «city» arată localitatea unde este situată SVI.

Dacă variabila «city» lipsește, BCE respinge întreaga cerere.

6. *Denumirea societății de administrare și indicativul de confidențialitate asociat*

O societate de administrare este o instituție care furnizează SVI servicii de gestionare sau de administrare.

Se verifică dacă:

— variabila «management company name» este completată fie cu denumirea unei societăți comerciale, fie ca «not available» sau «not applicable»; și

— în cazul în care variabilei «management company name» i se atribuie «not available», aceasta este însoțită de o explicație inserată în câmpul «free_text»; în caz contrar, BCE va transmite un avertisment;

— variabila «management company name_confidentiality_flag» se completează cu «F», «N» sau «C».

În cazul în care variabila «management company name» lipsește, BCE respinge întreaga cerere.

7. *Natura securitizării și indicativul de confidențialitate asociat*

Se verifică dacă:

— variabila «nature of securitisation» este completată cu una dintre cele patru valori predefinite: «traditional», «synthetic», «other» sau «not available»;

— în cazul în care variabilei «nature of securitisation» i se atribuie «not available», aceasta este însoțită de o explicație inserată în câmpul «free_text»; în caz contrar, BCE va transmite un avertisment;

— variabila «nature of securitisation_confidentiality_flag» se completează cu «F», «N» sau «C».

În cazul în care variabila «nature of securitisation» lipsește, BCE respinge întreaga cerere.

8. *Codurile ISIN*

Se verifică dacă:

— în cadrul variabilei «ISIN codes», cel puțin variabila «ISIN_1» este completată pentru fiecare SVI, și că valoarea pentru «ISIN_1» este fie codul actual, fie termenul alcătuit din 12 caractere «XXXXXXXXXXXX»;

— codurile ISIN pentru fiecare SVI nu sunt dublate;

— codurile ISIN pentru toate SVI nu sunt dublate.

În cazul în care variabilele «ISIN codes» și «ISIN_1» lipsesc, de exemplu, nici codul actual, nici termenul «XXXXXXXXXXXX» nu este prevăzut, BCE respinge întreaga cerere.

9. *Verificări ale confidențialității*

BCN pot marca anumite valori sau întreaga înregistrare ca fiind confidențială cu indicativul de confidențialitate prevăzut atunci când raportează către BCE o actualizare referitoare la o SVI.

În asemenea cazuri, informațiile suplimentare cu privire la motivul confidențialității ar trebui furnizate în câmpul «free_text».

BCE nu publică asemenea valori pe site-ul său sau nu le transmite înapoi către BCN. Indicativele de confidențialitate sunt descrise, în detaliu, mai jos:

«F»	Liber: această valoare nu este confidențială și poate fi publicată
«N»	Informații statistice confidențiale: această valoare poate fi transmisă în cadrul SEBC, însă nu poate fi publicată
«C»	Informații statistice confidențiale: această valoare nu poate fi transmisă în cadrul SEBC și nici nu poate fi publicată; aceasta rămâne în spațiul de producție statistică al BCE

Se verifică dacă:

— «fvc_confidentiality_flag», «management company name_confidentiality_flag» și «nature of securitisation_confidentiality_flag» se completează cu una dintre următoarele valori predefinite: «F», «N» sau «C»;

— în cazul în care «management company name_confidentiality_flag» și/sau «nature of securitisation_confidentiality_flag» sunt «N» sau «C», atunci «fvc_confidentiality_flag» ar trebui să fie «F».”.