

Norges Banks rapportering av pengemarkedsdata (RPD)

**Ofte Stilte Spørsmål
Versjon 1.0**

Generelle krav

Rapporteringsomfang

Spørsmål: Vi er en filial av en utenlandsk bank. Handlene utføres av filialen basert i Norge, men bookes og føres på balansen til morbanken. Skal disse handlene rapporteres?

Svar: Ja, det som gjøres av filialen men bokføres i enheter innen EØS skal rapporteres. Dette gjelder ikke konserninterne transaksjoner.

Relevante motparter og definisjoner

Spørsmål: "Ola Nordmann Invest AS" er et foretak som er klassifisert under "andre finansielle foretak" med en omsetning på 500 000 og en ansatt, skal transaksjoner med denne motparten rapporteres?

Svar: Dersom foretaket oppfyller kravet til SMB i artikkel 153 (4) i Forordning (EU) 575/2013 skal transaksjonen ikke rapporteres. Dette er uavhengig av transaksjonsbeløpet. Unntaket gjelder for alle relevante transaksjoner og motparter.

Spørsmål: Er det noen andre beløpsgrenser med hensyn til størrelse på innskudd som skal rapporteres?

Svar: Transaksjoner med nominelt beløp mindre enn NOK 10 millioner skal ikke rapporteres. Dette gjelder for alle relevante transaksjoner og motparter.

Usikrede transaksjoner

Innskudd

Spørsmål: Kan dere bekrefte at vi har korrekt tolkning av «trade date» for innskudd med 31 dagers varslingsfrist? Trade date = settlement date = rollover date. Altså med et urørt innskudd, skal det rapporteres trade date = settlement date = dagens dato. (Med mindre beløpet er sagt opp, da er trade date = varslingsdato for oppsigelse og maturity date = avtalt oppsigelsesdato)

Svar: Det er riktig tolkning

FX-swap

Spørsmål: Vi har tolket det slik at FX-swapper skal rapporteres en gang, dvs. på handeldato (flere ganger hvis det er kansellering, tillegg eller korrigeringer), og at de ikke skal rapporteres løpende. Er dette riktig tolkning?

Svar: Det er riktig tolkning at de kun skal rapporteres en gang med mindre det er endringer.

Spørsmål: Vi har inngått en FX-swap med kjøp av NOK to dager frem i tid og salg av EUR to dager frem i tid, mot salg av NOK en måned frem i tid og kjøp av EUR på samme tidspunkt. Skal dette rapporteres på to linjer i samme rapportering?

Svar: Dette skal kun rapporteres én gang på tidspunkt T som kjøp av NOK (BUYI) med trade date T, value date T+2 og maturity date T+1mnd, foreign currency code EUR og gjeldende spot- og terminkurs, ref. eksempel 4 i veiledningen.

Spørsmål: Vi har skjönt det slik at det kun er handler som involverer NOK i en av beina som skal rapporteres, er dette riktig? Det vil si at f.eks. en EUR/CHF swap ikke skal rapporteres.

Svar: Det er riktig. Det er kun FX-swapper hvor NOK lånes inn/ut som skal rapporteres.

Tekniske spørsmål

Spørsmål: Rapporteringen skal utføres mellom 18:00 og 07:00. Dersom vi har et driftsavbrudd som gjør at rapporteringen ikke går som planlagt, hvordan ser Norges Bank på dette? Vil det være mulig å "backloade" transaksjoner?

Svar: Rapporteringsløsningen har ingen tekniske sperrer som hindrer rapportering i ettertid som konsekvens av driftsavbrudd.