



Regeling van de Ministers van Financiën, Binnenlandse Zaken en Koninkrijksrelaties en Infrastructuur en Waterstaat tot wijziging van de Regeling schatkistbankieren decentrale overheden betreffende een wijziging van de methode voor berekening van de daggeldrente inzake het schatkistbankieren voor decentrale overheden (Regeling wijziging berekeningsmethode daggeldrente schatkistbankieren decentrale overheden 2019) (2019-160875), d.d. 16 oktober 2019

De Ministers van Financiën, Binnenlandse Zaken en Koninkrijksrelaties en Infrastructuur en Waterstaat,

Gelet op de artikel 2, vierde lid, en artikel 2b, tweede en derde lid, van de Wet financiering decentrale overheden;

Besluiten:

Enig artikel

In artikel 1 van de Regeling schatkistbankieren decentrale overheden wordt de definitie daggeldrente vervangen door 'daggeldrente: de dagelijkse vaststelling door de Europese Centrale Bank van de rente waartegen gemiddeld genomen overnight en zonder onderpand liquiditeiten zijn geleend in de eurogeldmarkt (EONIA, afgerond op 2 decimalen).'.

Deze regeling treedt in werking met ingang van de dag na de datum van uitgifte van de Staatscourant waarin zij wordt geplaatst en werkt terug tot en met 1 oktober 2019.

Deze regeling zal met de toelichting in de Staatscourant worden geplaatst.

*De Minister van Financiën,
W.B. Hoekstra*

*De Minister van Binnenlandse Zaken en Koninkrijksrelaties,
K.H. Ollongren*

*De Minister van Infrastructuur en Waterstaat,
C. van Nieuwenhuizen-Wijbenga*



TOELICHTING

Algemeen

Deze regeling wijzigt de Regeling schatkistbankieren decentrale overheden. De wijziging houdt verband met de mededeling van de beheerder van de Euro Overnight Index Average (hierna: EONIA) dat per 1 oktober 2019 er een aanpassing komt in de berekeningsmethode van EONIA. Als gevolg van de aanpassing in de berekeningsmethode is EONIA niet langer een gewogen gemiddelde gebaseerd op de ontvangen input van een panel van banken, maar gebaseerd op daadwerkelijke transacties in de geldmarkt.

De huidige vergoeding op de gelden op de rekening-courant die, onder andere, decentrale overheden aanhouden bij het Agentschap van de Generale Thesaurie is gebaseerd op EONIA. Tot 1 oktober 2019 wordt EONIA berekend op basis van input afkomstig uit een panel van banken in de Europese Unie en de Europese Vrijhandelsassociatie. Het resultaat is een gewogen gemiddelde van het tarief dat deze banken elkaar rekenen voor een ongedekte lening van een dag (*overnight*). Deze methode van vaststellen van EONIA voldoet niet meer aan de eisen in de EU Benchmark Verordening (EU 2016/1011). Daarom verdwijnt EONIA per eind 2021 als referentierente. Naar verwachting zullen marktpartijen 'Euro Short-Term Rate' (hierna: €STR), een nieuwe referentierente, gebruiken als de opvolger van EONIA. €STR wordt door de Europees Centrale Bank (hierna: ECB) vastgesteld op basis van daadwerkelijke transacties in de geldmarkt op basis van de data die alle banken dagelijks aan de ECB aanleveren.

In verband hiermee heeft de beheerder van EONIA aangekondigd per 1 oktober 2019 de methode voor de vaststelling van EONIA te wijzigen en te baseren op €STR met een opslag van 0,085%. Deze aangekondigde herziene methode volgt de aanbevelingen van de marktpartijen. De opslag is in lijn met de berekeningen van de ECB. Als onderdeel van de nieuwe methode worden meer transacties op de financiële markt betrokken bij de berekening van €STR waardoor het volume op basis waarvan de rente wordt vastgesteld veel groter is en de referentierente daardoor een beter beeld geeft van de rente die gerekend wordt voor transacties op de geldmarkt.

Artikelsgewijs

Enig artikel

Dit artikel wijzigt de definitie daggeldrente zoals momenteel opgenomen in artikel 1 van de Regeling schatkistbankieren decentrale overheden. Door deze wijziging wordt de definitie daggeldrente aangepast zodat deze niet langer verwijst naar 'door een panel van banken'.

*De Minister van Financiën,
W.B. Hoekstra*

*De Minister van Binnenlandse Zaken en Koninkrijksrelaties,
K.H. Ollongren*

*De Minister van Infrastructuur en Waterstaat,
C. van Nieuwenhuizen-Wijbenga*