НАСОКИ

НАСОКИ НА ЕВРОПЕЙСКАТА ЦЕНТРАЛНА БАНКА

от 26 септември 2012 година

относно рамката за управление на качеството на данни за Централизираната база данни за ценни книжа

(ЕЦБ/2012/21)

(2012/689/ЕС)

УПРАВИТЕЛНИЯТ СЪВЕТ НА ЕВРОПЕЙСКАТА ЦЕНТРАЛНА БАНКА,

като взе предвид Устава на Европейската система на централните банки и на Европейската централна банка, и по-специално членове 5.1, 12.1 и 14.3 от него,

като взе предвид Регламент (ЕО) № 2533/98 на Съвета от 23 ноември 1998 г. относно събирането на статистическа информация от Европейската централна банка ([1]),

като има предвид, че:

(1) Централизираната база данни за ценни книжа (ЦБДЦК) е единна инфраструктура за информационни технологии, която се управлява съвместно от членовете на Европейската система на централните банки (ЕСЦБ), включително национални централни банки (НЦБ) на държави-членки извън еврозоната, когато такива НЦБ доброволно участват в управлението на ЦБДЦК. ЦБДЦК съхранява данни по отделни позиции, по-специално данни за ценни книжа, техните емитенти и цени.

(2) Данни се събират от различни източници, включително от членове на ЕСЦБ, от някои комерсиални доставчици на данни, от информация, която е обществено достояние, и от административни източници, и се предоставят на ЦБДЦК. Въпреки това съществува риск, че такива входни данни могат да бъдат неточни или непълни. Системата на ЦБДЦК е в състояние да съпоставя частично непоследователни входни данни от различни източници и може да открива непълни или липсващи данни. Тя автоматично комбинира входни данни от различни съвпадащи източници, доколкото е възможно, в завършен и висококачествен единен запис.

(3) Общото качество на данните в ЦБДЦК може да бъде оценено само на ниво изходни данни, а не толкова на ниво отделни групи входни данни. С цел гарантиране на пълнотата, точността и последователността на изходните данни, доколкото е възможно, е необходимо да се определи рамка за управление на качеството на данни (УКД), която да се прилага спрямо изходни фийд данни — подгрупа от изходни данни, които могат да бъдат използвани за подпомагане изготвянето на статистика или други видове употреба. Изходните фийд данни се предоставят на НЦБ не по-късно от 7 работни дни след края на всеки календарен месец.

(4) Някои изходни фийд данни също включват атрибути, като например цени или свързана с дохода информация, които се очаква да варират с времето. Тези атрибути се проверяват автоматично от системата на ЦБДЦК чрез прилагането на статистически алгоритми. Само атрибутите, посочени в приложение I за всяка цел на УКД, подлежат на проверка от компетентни органи в съответствие с настоящите насоки. Пълният списък от атрибути, представляващи поддържаните пакети фийд данни, е посочен в приложение II.

(5) Рамката за УКД за ЦБДЦК следва да се прилага по отношение на изходни фийд данни, независимо от източника на входни данни. Тя следва да определя отговорностите на НЦБ от еврозоната относно качеството на изходни данни в ЦБДЦК и когато е относимо — тези на Европейската централна банка (ЕЦБ).

(6) Рамката за УКД за ЦБДЦК следва да се основава на първо място на цели на УКД, които представляват показатели за оценка на качеството на изходни фийд данни, и на второ място — на параметри на УКД, които идентифицират и подреждат по приоритет, за всяка съответна цел на УКД, изходните фийд данни, които е необходимо да бъдат проверени. Тя следва също така да се основава на прагове на УКД, които определят минималното ниво на проверка, която е необходимо да бъде извършена във връзка с цел на УКД.

(7) Предвид липсата на референтни данни целите на УКД невинаги откриват грешки в изходни фийд данни, а могат само да откриват случаи, за които е необходима ръчна проверка на изходни фийд данни.

(8) Тъй като ЦБДЦК се управлява съвместно от всички членове на ЕСЦБ, всички те следва да се стремят да прилагат едни и същи стандарти за УКД. Освен това НЦБ извън еврозоната най-добре могат да извършват УКД на данните, свързани с емитенти, които са резиденти в тяхната съответна държава членка. Въпреки

([1]) ОВ L 318, 27.11.1998 г., стр. 8.

че се признава, че приетите от ЕЦБ насоки не могат да възлагат никакви задължения на НЦБ извън еврозоната, член 5 от Устава на Европейската система на централните банки и на Европейската централна банка се прилага както спрямо НЦБ от еврозоната, така и спрямо НЦБ извън еврозоната. Поради това НЦБ извън еврозоната следва да подготвят и изпълнят всички мерки, които считат за подходящи за извършването на УКД в съответствие с настоящите насоки.

(9) За подобряване качеството на изходни данни следва да се извърши управление на източника на данни (УИД) с цел откриване и поправяне на повтарящи се и структурни грешки във входни данни пряко от доставчика на данни,

ПРИЕ НАСТОЯЩИТЕ НАСОКИ:

Член 1

Определения

За целите на настоящите насоки:

1. „ЦБДЦК“ означава Централизираната база данни за ценни книжа, създадена от ЕСЦБ и разположена в помещенията на ЕЦБ;

2. „входни данни“ означава всякакви данни, предоставени на ЦБДЦК от един или няколко източника на данни;

3. „изходни данни“ означава данни, които са автоматично получени в ЦБДЦК посредством комбиниране на входни данни в завършен висококачествен единен запис;

4. „изходни фийд данни“ означава подгрупата от изходни данни и характеристики, изброени в приложение II, които служат като входни данни за подпомагане изготвянето на статистика или други видове употреба;

5. „управление на качеството на данни“ или „УКД“ означава осигуряване, проверка и поддържане на качеството на изходни фийд данни посредством използването и прилагането на цели на УКД, параметри на УКД, прагове на УКД и на работните процеси на УКД;

6. „управление на източника на данни“ или „УИД“ означава откриване и поправяне пряко от доставчик на данни на повтарящи се и/или структурни грешки във входни данни;

7. „първоначално УКД“ означава УКД на изходни фийд данни, включително данни, отнасящи се до най-скорошния период от време, извършвано от компетентни органи за УКД на месечна база, като се вземат предвид изходните фийд данни, предоставяни от предварителния преглед към края на месеца;

8. „регулярно УКД“ означава УКД на изходни фийд данни, извършвано от компетентни органи за УКД на месечна база, като се вземат предвид референтни данни извън ЦБДЦК, предоставяни от различни източници на данни, за да се гарантира, че качеството на изходни данни на ЦБДЦК отговаря на изискванията за фийд данни на ЦБДЦК;

9. „цел на УКД“ означава референтна база за оценка на качеството на изходни фийд данни, както е посочено в приложение I;

10. „параметър на УКД“ означава статистически показател, измерващ степента, в която определена цел на УКД е постигната, както е посочено в приложение I;

11. „праг на УКД“ означава минималното ниво на работа по проверка, която е необходимо да бъде извършена, за да бъдат изпълнени изискванията на рамката за УКД за цел на УКД;

12. „работен процес на УКД“ означава технически процес, който се прилага за поправянето на входни данни, за да бъде спазен праг на УКД;

13. „предварителен преглед към края на месеца“ означава регулярна месечна актуализация на изходни данни и на параметри на УКД, която представя в приблизителен вид изходни данни за предстоящото положение към края на месеца;

14. „работен ден“ е пълен ден, в който TARGET2 е отворена, както е публикувано на уебсайта на ЕЦБ;

15. „проверка“ означава процесът, при който компетентни органи за УКД проверяват изходни фийд данни на ЦБДЦК и ако е необходимо, поправят входни данни на ЦБДЦК, прилагайки по този начин работните процеси на УКД;

16. „резидент“ има смисъла съгласно определението в член 1 от Регламент (ЕО) № 2533/98.

Член 2

Предмет и приложно поле

1. Настоящите насоки установяват рамка за УКД в ЦБДЦК, целта на която е да гарантира пълнотата, точността и последователността на изходни данни в ЦБДЦК чрез последователното прилагане на правила относно стандарти за качество за такива данни.

2. Рамката за УКД за ЦБДЦК се основава на УКД и УИД.

Член 3

Компетентни органи за УКД

1. НЦБ на държавата-членка от еврозоната, в която емитент на ценни книжа е резидент, е компетентна за УКД на данните, свързани с този емитент.

2. ЕЦБ е компетентна за УКД на данни, свързани с емитенти, които са резиденти извън еврозоната, освен ако НЦБ извън еврозоната е поела отговорността да извършва УКД на данни, свързани с емитенти, които са резиденти в нейната държава-членка.

Член 4

УКД, параметри на УКД и прагове на УКД

1. Компетентните органи за УКД извършват първоначално УКД и регулярно УКД. За целта те проверяват изходни фийд данни, независимо от източника им.

2. Компетентните органи за УКД прилагат параметри на УКД в съответствие с приложение I.

3. За атрибутите, посочени в приложение I, компетентните органи за УКД прилагат прагове на УКД в степен, която гарантира качеството на изходни фийд данни в съответствие с изискванията да подпомагат видовете употреба за тези съответни атрибути съгласно установеното в приложение II.

Член 5

Първоначално УКД

1. Първоначално УКД се прилага за цели на УКД 1, 2, 3а, 3б и 6 съгласно посоченото в приложение I.

2. ЕЦБ предоставя на разположение предварителния преглед към края на месеца седем работни дни преди края на всеки календарен месец.

3. При извършването на първоначално УКД компетентните органи за УКД проверяват съществени статистически отклоняващи се стойности, за да осигурят, че след извършването на първоначално УКД изходните фийд данни отразяват последните развития, доколкото е възможно.

4. Компетентните органи за УКД проверяват данните от предварителния преглед към края на месеца до края на втория работен ден от следващия календарен месец, доколкото съгласно параметрите на УКД праговете на УКД не са били изпълнени.

5. Когато няма никакви налични референтни данни извън ЦБДЦК, първоначалното УКД се основава единствено на информация, която вече е на разположение на компетентните органи за УКД или която може да бъде получена лесно, без да се създава нова отчетна структура.

6. Компетентните органи за УКД поправят входни данни в съответствие с работните процеси на УКД, като използват системата на ЦБДЦК или като предоставят файлове с входни данни на ЕЦБ, когато това е целесъобразно.

Член 6

Регулярно УКД

1. Регулярно УКД се прилага за цели на УКД 3а, 3б, 4, 5 и 6 съгласно посоченото в приложение I.

2. Компетентните органи за УКД извършват регулярно УКД в срок до един месец след края на всеки календарен месец. Те проверяват изходни фийд данни, като вземат предвид цялата налична информация, не по-късно от втория работен ден на календарния месец, следващ месеца, през който е извършено регулярно УКД.

3. Компетентните органи за УКД поправят входни данни в съответствие с уговорените работни процеси на УКД, като използват системата на ЦБДЦК или като предоставят файлове с входни данни на ЕЦБ, когато това е целесъобразно.

Член 7

Задачи, свързани с УИД

1. Компетентните органи за УКД идентифицират всякакви проблеми на УИД и съобщават за тях на ЕЦБ.

2. ЕЦБ търси решение за повтарящи се грешки с висок приоритет, отнасящи се до УИД, в сътрудничество със съответните компетентни органи за УКД в срок до един месец от датата, на която за даден проблем на УИД е съобщено на ЕЦБ.

Член 8

Поправяне на входни данни

В случай че компетентен орган за УКД разполага с подобрени входни данни, той използва системата на ЦБДЦК, за да поправи всякакви грешки и пропуски в неговите входни данни, които не са били поправени в рамките на проверката съгласно посоченото в член 5, параграф 4.

Член 9

Годишен отчет за качество

Като взема предвид становищата на Комитета по статистика на ЕСЦБ, Изпълнителният съвет на ЕЦБ представя отчет на годишна база на Управителния съвет относно качеството на изходни фийд данни.

Член 10

Опростена процедура за изменения

Като взема предвид становищата на Комитета по статистика на ЕСЦБ, Изпълнителният съвет на ЕЦБ има правото да прави технически изменения в приложенията към настоящите насоки, при условие че такива изменения не променят заложената концептуална рамка на насоките, включително разделението на отговорностите между ЕЦБ и НЦБ, и не засягат съществено тежестта на отчетността за компетентните органи за УКД. Изпълнителният съвет уведомява Управителния съвет за всяко такова изменение без ненужно забавяне.

Член 11

Влизане в сила

1. Настоящите насоки влизат в сила на 1 ноември 2012 г.

2. Настоящите насоки се прилагат от 1 юли 2013 г.

Член 12

Адресати

Адресати на настоящите насоки са всички централни банки от Евросистемата.

Съставено във Франкфурт на Майн на 26 септември 2012 година.

За Управителния съвет на ЕЦБ
Председател на ЕЦБ
Mario DRAGHI

ПРИЛОЖЕНИЕ I

ЦЕЛИ НА УКД, ИЗПЪЛНЕНИЕ, АТРИБУТИ И БАЗА ЗА ПРАГОВЕ НА УКД

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
Цел 1: **Стабилност на данните — данни по салдата**	Понятие: Параметърът се дефинира за всяка държава по резидентност/секторна комбинация като обемно претеглен „индекс на промяна“, претеглен с парични суми. Стойност на индекса 1 показва, че съответният атрибут не се е променил за никои от основните ценни книжа, докато стойност на индекса 0 показва, че съответният атрибут се е променил за всички ценни книжа. Ако даден индекс падне под 1, отделните ценни книжа се идентифицират с променения атрибут, който е причинил спада в индекса, с цел проверка на промяната, докато бъде изпълнен прагът. Събития, предизвикващи промяна на индекса: За несвързани атрибути всяка разлика в атрибута от месец на месец се счита, че предизвиква промяна на индекса. За последователни атрибути всяка разлика, поголяма от 25 %, от месец на месец се счита, че предизвиква промяна на индекса. Обхват: Този параметър на УКД обхваща всички акции на инвестиционен фонд, капиталови участия и дългови ценни книжа, включително сертификати, чийто падеж е настъпил преди не повече от три месеца.	Цел 1 оценява стабилността на данни по салдата. Непроверените промени на атрибути на ЦБДЦК не намаляват дела на стабилни данни извън прага на УКД за всеки от следните сектори на емитенти на Европейска система от сметки (ESA) ([1]): — S.11 „нефинансови предприятия“ (S.11 съгласно ESA 95) — S.121 „централната банка“ (S.121 съгласно ESA 95) — S.122 „депозитни институции без централната банка“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.123 „фондове на паричния пазар (ФПП)“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.124 „инвестиционни фондове, различни от ФПП“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.125 „други финансови посредници, с изключение на застрахователни предприятия и пенсионни фондове“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.126 „финансови предприятия, ангажирани със спомагателни финансови дейности“ (S.124 съгласно ESA 95) — S.127 „каптивни финансови институции и заемодатели“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.128 „застрахователни корпорации (ЗК)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.129 „пенсионни фондове (ПФ)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.13 „държавно управление“ (S.13 съгласно ESA 95).	Изрични атрибути: дата на емисия на дълга, падеж на дълга, номинална валута, котировъчна база, клас инструмент по ESA, държава, в която емитентът е резидент, сектор на емитента по ESA, класификация на емитента по Европейската класификация на икономическите дейности — NACE, непогасена сума, брой акции в обращение за котирани акции.	Непогасени суми или пазарна капитализация в евро, изразени като дял от данни по салдата.

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
Цел 2: **Точност на данните — нови емисии и погасявания; нетни емисии**	Понятие: Параметърът се дефинира за всяка държава по резидентност/секторна комбинация и обхваща нови емисии, погасявания и непогасени дългови ценни книжа, котирани в процент. Параметърът свързва дейността по нетно емитиране през месеца с непогасената сума към края на предишния месец (процентна промяна) и наблюдава относителното развитие на неизплатения дълг. Осигурява се възможност за достъп до дезагрегирани данни — до отделните нови емисии и погасявания, които са предизвикали промяната в непогасените суми. Тези развития се проверяват, докато бъде достигнат прагът.	Цел 2 оценява нови емисии и погасявания в сравнение със съответните данни по салдата. Непроверени данни за непогасени суми по нови емисии и погасявания по дългови ценни книжа, котирани в процент, не надвишават в нетно изражение прага на УКД за всеки от следните сектори на емитенти по ESA: — S.11 „нефинансови предприятия“ (S.11 съгласно ESA 95) — S.121 „централната банка“ (S.121 съгласно ESA 95) — S.122 „депозитни институции без централната банка“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.123 „фондове на паричния пазар (ФПП)“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.124 „инвестиционни фондове, различни от ФПП“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.125 „други финансови посредници, с изключение на застрахователни предприятия и пенсионни фондове“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.126 „финансови предприятия, ангажирани със спомагателни финансови дейности“ (S.124 съгласно ESA 95) — S.127 „каптивни финансови институции и заемодатели“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.128 „застрахователни корпорации (ЗК)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.129 „пенсионни фондове (ПФ)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.13 „държавно управление“ (S.13 съгласно ESA 95).	Изрични атрибути: непогасена сума. Имплицитни атрибути: дата на емисия, падеж, номинална валута, котировъчна база, класификация на инструмент по ESA, държава, в която емитентът е резидент, сектор на емитента по ESA.	Непогасени суми в евро, изразени като относително развитие в сравнение със съответните данни по салдата.

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
Цел 3а: **Точност на данните — подпомага правилно съотнасяне по сектори и извличане на данни по емитенти**	Концептуална рамка: ЦБДЦК свързва информацията за емитент и инструмент на релативна база, която може да бъде описана като „един към много“, т.е. един емитент може да бъде свързан с много инструменти, докато всеки инструмент е свързан само с един емитент. Тази връзка инструмент — емитент се прави посредством идентификатори за отделните емитенти, предоставени от различните доставчици на входни данни. Тези идентификатори се различават при доставчиците на данни, тъй като до момента няма общ стандарт, но те следва да бъдат последователни. Ако доставчиците на входни данни предоставят непоследователни (конфликтни) идентификатори на емитенти за един и същи инструмент, т.е. ако те не са съгласни относно емитента, инструментът не може да бъде съотнесен към определен емитент и попада в „конфликтна група“. Конфликтните групи все пак могат да бъдат класифицирани правилно по държава и сектор, но няма последователна връзка със съответния емитент на инструмента. Инструментите в конфликтни групи възпрепятстват последователното и надеждно извличане на всички инструменти, емитирани от определен емитент. Инструментите в конфликтни групи повишават риска от погрешно класифициране по държава по резидентност или по сектор. Понятие: За всяка държава по резидентност параметърът идентифицира инструментите в конфликтни групи и ги съотнася като процентен дял в бройки или в парични суми към всички инструменти за тази държава. Обхват: Параметърът обхваща всички инструменти в ЦБДЦК.	Цел 3а оценява правилното идентифициране на съвкупността от емитенти. Когато съществува несъгласие относно емитента на даден инструмент, т.е. има инструменти в „конфликтни групи“, тези инструменти не надвишават прага на УКД.	Изрични атрибути: идентификатор за емитент, използван за групиране.	Непогасени суми в евро, отнасящи се до инструменти в конфликтни групи, изразени като процентен дял от всички инструменти.

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
Цел 3б: **Точност на данните — подпомага правилно съотнасяне по сектори и извличане на данни по емитенти**	Концептуална рамка: ЦБДЦК свързва информацията за емитент и инструмент на релативна база, която може да бъде описана като „един към много“, т.е. един емитент може да бъде свързан с много инструменти, докато всеки инструмент е свързан само с един емитент. Тази връзка инструмент — емитент се прави посредством идентификатори за отделните емитенти, които са предоставени от различните доставчици на входни данни. Тези идентификатори се различават при доставчиците на данни, тъй като до момента няма общ стандарт, но те следва да бъдат последователни. Ако нито един доставчик на данни не предостави идентификатор за емитент за даден инструмент, съществува риск този инструмент да не бъде съотнесен към определен емитент и да остане в „самостоятелна група“, състояща се само от този инструмент. Самостоятелните групи все пак могат да бъдат класифицирани правилно по държава и сектор, но няма последователна връзка със съответния емитент на инструмента. Инструментите в самостоятелни групи възпрепятстват последователното и надеждно извличане на всички инструменти, емитирани от определен емитент. Инструментите в самостоятелни групи повишават риска от погрешно класифициране по държава по резидентност или по сектор, като се има предвид, че те често са предоставяни с непълна информация. Понятие: За всяка държава по резидентност параметърът идентифицира инструментите в самостоятелни групи и ги съотнася като процентен дял в бройки или в парични суми към всички инструменти за тази държава.	Цел 3б оценява правилното идентифициране на съвкупността от емитенти. Когато липсва надеждна информация относно емитента на даден инструмент, т.е. има инструменти в „самостоятелни групи“, тези инструменти не надвишават прага на УКД.	Изрични атрибути: идентификатор за емитент, използван за групиране.	Непогасени суми в евро, отнасящи се до инструменти в самостоятелни групи, изразени като процентен дял от всички инструменти.

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
	Обхват: Параметърът обхваща всички инструменти в ЦБДЦК.			
Цел 4: **Точност на данните — непогасени дългови ценни книжа, включително сертификати**	Понятие: Параметърът агрегира непогасени дългови ценни книжа, включително сертификати, по държавата по резидентност на всеки емитент и по сектор на емитента съгласно понятието за статистика на емисиите ценни книжа (SEC). Този агрегат се сравнява със съответната стойност съгласно SEC и се изчислява процентното отклонение на данните на ЦБДЦК. Непроверените и необяснени разлики не надвишават прага на УКД.	Цел 4 сравнява изходни данни на ЦБДЦК с външни референтни данни. Непроверените и необяснени разлики между агрегирани данни на ЦБДЦК и съответната информация от SEC на ЕЦБ или от други надеждни референтни данни не надвишават — в зависимост от наличието на такива референтни данни, прага на УКД за същата референтна дата за всеки от следните сектори на емитенти по ESA: — S.11 „нефинансови предприятия“ (S.11 съгласно ESA 95) — S.121 „централната банка“ (S.121 съгласно ESA 95) — S.122 „депозитни институции без централната банка“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.123 „фондове на паричния пазар (ФПП)“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.124 „инвестиционни фондове, различни от ФПП“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.125 „други финансови посредници, с изключение на застрахователни предприятия и пенсионни фондове“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.126 „финансови предприятия, ангажирани със спомагателни финансови дейности“ (S.124 съгласно ESA 95) — S.127 „каптивни финансови институции и заемодатели“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.128 „застрахователни корпорации (ЗК)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.129 „пенсионни фондове (ПФ)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.13 „държавно управление“ (S.13 съгласно ESA 95).	Изрични атрибути: непогасени суми в евро, пазарна капитализация в евро. Имплицитни атрибути: дата на емисия, падеж, валута, сектор на емитента по ESA, държава по резидентност.	Непогасени суми или пазарна капитализация в евро, изразени като процентна разлика между ЦБДЦК и външни референтни данни.

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
Цел 5: **Точност на данните — пазарна капитализация за капиталови участия**	Понятие: Параметърът агрегира пазарна капитализация за акции по държава по резидентност на всеки емитент и по сектор на емитента съгласно понятието за статистика на емисиите ценни книжа. Този агрегат се сравнява със съответната стойност съгласно SEC и се изчислява процентното отклонение на данните на ЦБДЦК. Непроверените и необяснени разлики не надвишават прага на УКД.	Цел 5 сравнява изходни данни на ЦБДЦК с външни референтни данни. Непроверените и необяснени разлики между агрегирана информация на ЦБДЦК и съответната информация от SEC на ЕЦБ или от други надеждни референтни данни не надвишават — в зависимост от наличието на референтни данни, прага на УКД за същата референтна дата за всеки от следните сектори на емитенти по ESA: — S.11 „нефинансови предприятия“ (S.11 съгласно ESA 95) — S.121 „централната банка“ (S.121 съгласно ESA 95) — S.122 „депозитни институции без централната банка“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.123 „фондове на паричния пазар (ФПП)“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.124 „инвестиционни фондове, различни от ФПП“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.125 „други финансови посредници, с изключение на застрахователни предприятия и пенсионни фондове“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.126 „финансови предприятия, ангажирани със спомагателни финансови дейности“ (S.124 съгласно ESA 95) — S.127 „каптивни финансови институции и заемодатели“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.128 „застрахователни корпорации (ЗК)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.129 „пенсионни фондове (ПФ)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.13 „държавно управление“ (S.13 съгласно ESA 95).	Изрични атрибути: непогасени суми в евро, брой акции в обращение за котирани акции. Имплицитни атрибути: номинална валута, сектор на емитента по ESA, държава по резидентност, цена за котирани акции (само проверка на отклоняващи се стойности).	Непогасени суми или пазарна капитализация в евро, изразени като процентна разлика между ЦБДЦК и външни референтни данни.

Цел на УКД	Параметри на УКД	Изпълнение	Атрибути на изходни фийд данни	База за прагове на УКД
Цел 6: **Точност на данните — класификация на емитента**	Понятие: Параметърът подрежда емитенти за всяка държава по резидентност/секторна комбинация в съответствие с общия размер на задълженията им, произтичащи от ценни книжа (общо капиталови участия и дългови ценни книжа). Параметърът също така показва абсолютните промени в подреждането между различните емитенти, за да се улесни идентифицирането на значителни отклоняващи се стойности при непогасени суми или пазарна капитализация. Държавата по резидентност и секторната класификация на емитента се проверяват до прага на УКД. Обхват: Параметърът обхваща всички акции на инвестиционен фонд, капиталови участия и дългови ценни книжа, чийто падеж е настъпил преди не повече от три месеца.	Цел 6 оценява статистическата класификация на емитенти. Статистическата класификация на емитентите до прага на УКД се проверява за всеки от следните сектори на емитенти по ESA: — S.11 „нефинансови предприятия“ (S.11 съгласно ESA 95) — S.121 „централната банка“ (S.121 съгласно ESA 95) — S.122 „депозитни институции без централната банка“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.123 „фондове на паричния пазар (ФПП)“ (S.122 съгласно ESA 95) — S.124 „инвестиционни фондове, различни от ФПП“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.125 „други финансови посредници, с изключение на застрахователни предприятия и пенсионни фондове“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.126 „финансови предприятия, ангажирани със спомагателни финансови дейности“ (S.124 съгласно ESA 95) — S.127 „каптивни финансови институции и заемодатели“ (S.123 съгласно ESA 95) — S.128 „застрахователни корпорации (ЗК)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.129 „пенсионни фондове (ПФ)“ (S.125 съгласно ESA 95) — S.13 „държавно управление“ (S.13 съгласно ESA 95).	Сектор на емитента по ESA, държава по резидентност.	Непогасени суми или пазарна капитализация в евро, изразени като „капитализация“, т.е. непогасени суми плюс пазарна капитализация за емитент.

(1) Номерирането на категории отразява номерирането, въведено в предложението за регламент на Европейския парламент и на Съвета относно Европейската система от национални и регионални сметки в Европейския съюз, COM(2010) 774 окончателен.

ПРИЛОЖЕНИЕ II

ПАКЕТИ ФИЙД ДАННИ И ИЗХОДНИ ФИЙД ДАННИ, ОБХВАНАТИ ОТ РАМКАТА ЗА УКД

Рамката за УКД обхваща следните пакети фийд данни, които подпомагат различни видове употреба:

— Пакет фийд данни, подпомагащ външна статистика (EXT 1.0)

— Пакет фийд данни за дружества със специална инвестиционна цел, подпомагащ статистика относно дружества със специална инвестиционна цел (FVC 1.0)

— Пакет фийд данни за инвестиционни фондове, подпомагащ статистика относно инвестиционни фондове (IF 1.0)

— Пакет фийд данни за държани ценни книжа, подпомагащ статистика за държани ценни книжа (SHS 1.0)

— Пакет фийд данни за финансиране на държавни ценни книжа, подпомагащ статистика за финансиране на държавни ценни книжа (GSF 1.0)

Атрибути на изходни фийд данни, представляващи поддържаните пакети фийд данни:

Наименование на атрибут на изходни фийд данни	Описание	Приложим пакет фийд данни				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (международен идентификационен номер за ценни книжа — ISIN код)	ISIN идентификатор на ценни книжа.	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (клас инструмент по Европейската система от сметки (ESA)	Класификация на ценните книжа съгласно ESA.	√	√	√	√	√
Вид дълг	Вид на дълговия инструмент.				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Атрибут, който може да бъде използван за идентифициране на ценни книжа, които следва да бъдат включени в „текущи непогасени суми“, в съответствие с определенията на SEC на ЕЦБ.					√
Instrument supplementary class (допълнителен клас инструменти)	Допълнителен атрибут, позволяващ идентифицирането на това дали даден инструмент следва да бъде включен в SEC или не. Този атрибут може да приема стойности като напр. 1 = „стрип на купон“, 2 = „стрип на главница“ и т.н.					√
Security status (статус на ценна книга)	Допълнителен атрибут, позволяващ идентифицирането на това дали даден инструмент следва да бъде включен в SEC или не. Този атрибут може да покаже дали падежът на даден инструмент е настъпил или не.					√
Asset securitisation type (вид активи, служещи за обезпечение)	Вид актив, служещ за обезпечение.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Атрибут, показващ дали даден инструмент може да бъде предоставян в залог като обезпечение за кредитни операции на Евросистемата.				√	
Nominal currency (номинална валута)	Номинална валута на инструмента (Международна организация по стандартизация (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Наименование на атрибут на изходни фийд данни	Описание	Приложим пакет фийд данни				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (дата на емисия)	Датата, на която ценните книжа са доставени на поемателя от емитента срещу заплащане. Това е датата, на която ценните книжа са на разположение за доставка до инвеститори за първи път. Бележка: за стрип тази колона показва датата, на която е извършен стрип на купона/главницата.	√	√	√	√	√
Maturity date (падеж)	Датата, на която дълговият инструмент е действително погасен.	√	√	√	√	√
Residual maturity (остатъчен срок до падежа)	Остатъчният срок до падежа на инструмент, пресметнат към датата на захранването на базата данни.					√
Issuer domicile country (държава по седалището на емитента)	Държавата по правното учредяване (седалището) на емитента на ценната книга (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (сектор на емитента по ESA)	Институционален сектор на емитента съгласно ESA.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (класификация на емитента по Европейската класификация на икономическите дейности — NACE)	Основна икономическа дейност съгласно NACE.	√				
Amount issued (емитирана сума)	Сумата за дълговия инструмент, която е била набрана при емитирането (номинална стойност). За стрип тази колона показва сумата, на която е извършен стрип на купона/главницата. За ценна книга, емитирана на траншове, с един ISIN код, тази колона показва общата сума, емитирана до момента. Емитираната сума е деноминирана в номинална валута.					√
Amount outstanding (непогасена сума)	Непогасена сума в номинална стойност. За ценна книга, емитирана на траншове, с един и същ ISIN код, тази колона показва общата сума, емитирана до момента, след приспадане на погасяванията. Стойностите са дадени в номинална валута. Непогасената сума е деноминирана в номинална валута. Ако липсва номинална валута, непогасената сума е деноминирана в евро.	√			√	√
Amount outstanding in euro (непогасена сума в евро)	Непогасена сума, конвертирана в евро, като се използва обменният курс на еврото спрямо номиналната валута към датата на захранването на базата данни.				√	√
Market capitalisation (пазарна капитализация)	Последната налична пазарна капитализация. Пазарната капитализация е деноминирана в номинална валута. Ако липсва номинална валута, пазарната капитализация е деноминирана в евро.				√	

Наименование на атрибут на изходни фийд данни	Описание	Приложим пакет фийд данни				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (доходност до падежа)	Специфична за ценната книга доходност до падежа, изразена в проценти.				√	√
Short name (кратко наименование)	Кратко наименование, дадено от емитента, дефинирано на базата на характеристиките на емисията и друга налична информация.					√
Pool factor (коефициент на пула)	За обезпечени с ипотека ценни книжа, коефициент на пула или коефициент на оставащото салдо по главница е непогасеното салдо по главница на пула от ипотеки, обезпечаващи ценните книжа, разделено на първоначалното салдо по главницата.	√	√	√	√	√
Quotation basis (котировъчна база)	Котировъчна база на инструмента, напр. процент номинал (процент) или валута от акция/дял (дялове).	√	√	√	√	√
Price value (ценова стойност)	Последната налична представителна цена на инструмента към референтната дата по котировъчна база и номинална валута, ако е приложимо, на инструмента. За лихвоносни ценни книжа се предоставя чистата цена, т.е. без начислената лихва.	√	√	√	√	√
Price value type (вид ценова стойност)	Същност на ценова стойност, т.е. дали тя представлява пазарна оценка, пресметната стойност или стойност по подразбиране.	√	√	√	√	√
Monthly average price (месечна средноаритметична цена)	Средноаритметични или нормализирани цени на инструмента, налични през последните 30 календарни дни преди референтната дата, по котировъчна база и номинална валута, ако е приложимо, на инструмента.	√			√	
Redemption type (вид погасяване)	Вид погасяване, напр. еднократно, безсрочно, структурирано, на годишна база, на части, нередовно, недействително, стъпаловидно.					√
Redemption frequency (периодичност на погасяването)	Брой погасявания годишно за даден дългов инструмент.					√
Redemption price (цена на погасяването)	Окончателна цена на погасяването.					√
Accrued interest (начислена лихва)	Начислената лихва след последното плащане по купон или след началната дата на начисляването. За лихвоносни ценни книжа при прибавяне на тази стойност към ценовата стойност се получава т.нар. „мръсна цена“.	√	√	√		√
Accrued income factor (коефициент на начислен доход)	Дневен специфичен за ценната книга коефициент на доход в проценти, пресметнат при следване на метода на длъжника. Коефициентът е базиран на начисления, т.е. дава комбинирания ефект от начислената лихва и дохода, дължащ се на разликата между емисионната цена и цената на погасяването.	√	√	√	√	

Наименование на атрибут на изходни фийд данни	Описание	Приложим пакет фийд данни				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (вид купон)	Вида на купона, напр. фиксиран, плаващ, стъпаловиден и т.н.				√	√
Last coupon rate (последна стойност на купон)	Последна действително изплатена стойност на купон в процент на година (стойност на годишна база).	√	√	√	√	
Last coupon date (последна дата на купон)	Дата на последната действително изплатена стойност на купон. Атрибутът позволява идентифицирането на това дали последната действително изплатена стойност на купон попада в отчетния период или не.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (последна периодичност на купон)	Периодичност в годината, в която се изплаща последната стойност на купон: „годишен“ („annual“) се трансформира в „AN“, „полугодишен“ — в „SA“ и т.н.	√	√	√	√	
Dividend amount (сума на дивидент)	Сумата на последното плащане на дивидент за акция (във вид сума на дивидент) преди облагане с данък (брутен дивидент).	√		√	√	
Dividend amount type (вид сума на дивидент)	Сумата на дивидента за акция може да бъде деноминирана във валутата на дивидента или в брой акции.	√		√	√	
Dividend currency (валута на дивидент)	Код на валутата по ISO 4217 на последното плащане на дивидент.	√		√	√	
Dividend Settlement date (дата на сетълмент на дивидент)	Дата на сетълмент на последното плащане на дивидент. Атрибутът позволява идентифицирането на това дали изплатената сума на дивидента попада в отчетния период или не.	√		√	√	
Last split factor (последен коефициент на сплит)	Сплитове на акции и обратни сплитове на акции.	√		√	√	
Last split date (последна дата на сплит)	Дата, на която сплитът на акции влиза в сила.	√		√	√	