RETNINGSLINJER

DEN EUROPÆISKE CENTRALBANKS RETNINGSLINJE

af 26. september 2012

om rammerne for datakvalitetssikring i den centraliserede værdipapirdatabase

(ECB/2012/21)

(2012/689/EU)

STYRELSESRÅDET FOR DEN EUROPÆISKE CENTRALBANK HAR —

under henvisning til statutten for Det Europæiske System af Centralbanker og Den Europæiske Centralbank, særlig artikel 5.1, 12.1, og 14.3,

under henvisning til Rådets forordning (EF) nr. 2533/98 af 23. november 1998 om Den Europæiske Centralbanks indsamling af statistisk information [1], og

ud fra følgende betragtninger:

(1) Den centraliserede værdipapirdatabase (Centralised Securities Database, CSDB) er en fælles it-infrastruktur, som drives i fællesskab af medlemmerne af Det Europæiske System af Centralbanker (ESCB), herunder de nationale centralbanker i de medlemsstater uden for euroområdet, som frivilligt deltager i driften af CSDB'en. CSDB'en opbevarer data for de enkelte poster, herunder navnlig data om værdipapirer, udstedere og kurser.

(2) Data indsamles fra forskellige kilder, herunder fra medlemmerne af ESCB, visse kommercielle dataleverandører, offentligt tilgængelige kilder og administrative kilder, og indberettes til CSDB'en. Der er imidlertid en risiko for, at sådanne inputdata er unøjagtige eller ufuldstændige. CSDB-systemet kan afstemme delvist inkonsistente inputdata fra forskellige kilder og finde ufuldstændige eller manglende data. Systemet sammensætter automatisk, så vidt det er muligt, inputdata fra forskellige overlappende kilder i én fuldstændig observation af høj kvalitet.

(3) Den overordnede datakvalitet i CSDB'en kan kun vurderes på grundlag af outputdata, ikke på grundlag af de individuelle sæt af inputdata. For at sikre, at outputdataene så vidt muligt er fuldstændige, nøjagtige og ensartede, er det nødvendigt at definere de rammer for datakvalitetssikring (data quality management, DQM), der skal finde anvendelse på output feed data, som udgør en delmængde af outputdata, og som kan anvendes til støtte for produktionen af statistik eller til andre formål. Output feed data indberettes til de nationale centralbanker senest syv arbejdsdage efter udgangen af hver kalendermåned.

(4) Visse output feed data omfatter også attributter som f.eks. kurser eller afkastrelaterede informationer, som forventes at svinge over tid. Disse attributter verificeres automatisk af CSDB-systemet ved hjælp af statistiske algoritmer. Kun de attributter, der er specificeret for hvert DQM-mål i bilag I, skal verificeres af de kompetente myndigheder i overensstemmelse med denne retningslinje. En fuldstændig liste over de attributter, der udgør støttefeeds, findes i bilag II.

(5) CSDB'ens rammer for DQM bør finde anvendelse på output feed data, uanset hvilken kilde dataene er modtaget fra. Rammerne bør fastsætte de nationale centralbanker i euroområdets ansvar for kvaliteten af outputdataene i CSDB'en og, hvor det er relevant, Den Europæiske Centralbanks (ECB) ansvar.

(6) CSDB'ens rammer for DQM bør for det første baseres på DQM-målene, på grundlag af hvilke kvaliteten af output feed dataene kan vurderes, og for det andet på DQM-indikatorerne, der for det respektive DQM-mål identificerer og prioriterer de output feed data, som skal verificeres. Endvidere bør de også baseres på DQM-tærsklerne, som definerer den mindste grad af verificering, der skal foretages i forhold til et DQM-mål.

(7) Da der ikke foreligger benchmarkdata, kan DQM-målene ikke altid identificere fejl i output feed dataene, men kun påvise de tilfælde, hvor det er nødvendigt at foretage en manuel verificering af output feed dataene.

(8) Da CSDB'en drives i fællesskab af alle medlemmerne af ESCB, bør de alle have som mål at følge de samme standarder for datakvalitetssikring. Nationale centralbanker uden for euroområdet er endvidere bedst egnede til at udføre datakvalitetssikring af de data,

[1] EFT L 318 af 27.11.1998, s. 8.

som vedrører udstedere, der er residente i deres respektive medlemsstater. Retningslinjer, der er vedtaget af ECB, må ganske vist ikke medføre forpligtelser for de nationale centralbanker uden for euroområdet, men artikel 5 i statutten for Det Europæiske System af Centralbanker og Den Europæiske Centralbank finder anvendelse på nationale centralbanker både i og uden for euroområdet. De nationale centralbanker uden for euroområdet bør derfor træffe og gennemføre alle de foranstaltninger, som de finder passende, for at udføre datakvalitetssikringen i overensstemmelse med denne retningslinje.

(9) For at forbedre kvaliteten af outputdata bør der gennemføres en forvaltning af datakilder (data source management, DSM) med henblik på at identificere og korrigere gentagne og strukturelle fejl i inputdata direkte hos dataleverandøren —

VEDTAGET FØLGENDE RETNINGSLINJE:

Artikel 1

Definitioner

I denne retningslinje forstås ved:

1) »CSDB« (Centralised Securities Database): den centraliserede værdipapirdatabase, der er oprettet af ESCB, og som er beliggende i ESCB's lokaler

2) »inputdata« (input data): alle data, som indberettes til CSDB'en fra en eller flere datakilder

3) »outputdata« (output data): data, der automatisk udledes i CSDB'en ved at sammensætte inputdata i én fuldstændig observation af høj kvalitet

4) »output feed data«: den delmængde af outputdata og egenskaber, som fremgår af bilag II, og som kan anvendes som datainput til støtte for produktionen af statistik eller til andre formål

5) »datakvalitetssikring« eller »DQM« (Data Quality Management): sikring, verificering og vedligeholdelse af kvaliteten af output feed data ved hjælp af DQM-mål, DQM-indikatorer og DQM-tærskler samt ved anvendelse af DQM-processen

6) »datakildeforvaltning« eller »DSM« (Data Source Management): identificering og korrektion af gentagne og/eller strukturelle fejl i inputdata direkte hos en dataleverandør

7) »indledende DQM« (initial DQM): datakvalitetssikringen af output feed data, herunder data, der dækker den seneste tidsperiode, udført månedligt af de kompetente DQM-myndigheder, idet der tages højde for output feed data, der er indberettet som foreløbige output feed data ultimo måneden

8) »regelmæssig DQM« (regular DQM): DQM af output feed data, der udføres månedligt af de kompetente DQM-myndigheder, idet der tages højde for ikke-CSDB benchmarkdata, der indberettes fra forskellige datakilder med henblik på at sikre, at kvaliteten af CSDB'ens outputdata opfylder kravene til CSDB'ens feed data

9) »DQM-mål« (DQM target): et benchmark, der danner grundlag for vurderingen af kvaliteten af output feed data, som specificeret i bilag I

10) »DQM-indikator« (DQM metric): en statistisk indikator, der angiver, i hvilken udstrækning et bestemt DQM-mål er nået, som specificeret i bilag I

11) »datakvalitetssikringstærskel« eller »DQM-tærskel« (DQM threshold): den mindste grad af verificering, der skal foretages, for at et DQM-mål opfylder kravene i rammerne for DQM

12) »datakvalitetssikringsproces eller »DQM-proces« (DQM work flow): en teknisk proces, der anvendes ved korrektion af inputdata for at opfylde en DQM-tærskel

13) »foreløbige data ultimo måneden« (end-month preview): en regelmæssig månedlig opdatering af outputdata og en DQM-indikator, som angiver de foreløbige outputdata ultimo den kommende måned

14) »arbejdsdag« (working day): en fuld dag, hvor TARGET2 er åben i henhold til oplysningerne på ECB's websted

15) »verificering« (verification): den proces, hvorved de kompetente DQM-myndigheder kontrollerer CSDB'ens output feed data og, om nødvendigt, korrigerer CSDB'ens inputdata under anvendelse af DQM-processen

16) »resident«: en resident som defineret i artikel 1 i forordning (EF) nr. 2533/98.

Artikel 2

Formål og anvendelsesområde

1. Denne retningslinje fastlægger rammerne for datakvalitetssikring i CSDB'en, som skal sikre, at outputdataene i CSDB'en er fuldstændige, nøjagtige og konsistente som følge af en konsekvent anvendelse af reglerne om kvalitetsstandarder for sådanne data.

2. CSDB'ens rammer for DQM er baseret på datakvalitetssikring (DQM) og datakildeforvaltning (DSM).

Artikel 3

Kompetente myndigheder for DQM

1. Den nationale centralbank i den medlemsstat i euroområdet, hvor en værdipapirudsteder er resident, er den kompetente myndighed for kvalitetssikringen af data, som vedrører denne udsteder.

2. ECB er den kompetente myndighed for kvalitetssikringen af data, som vedrører udstedere, der er residente uden for euroområdet, medmindre en national centralbank uden for euroområdet har påtaget sig ansvaret for at udføre kvalitetssikringen af data, som vedrører udstedere, der er residente i dens medlemsstat.

Artikel 4

DQM, DQM-indikatorer og DQM-tærskler

1. De kompetente DQM-myndigheder skal udføre en indledende DQM og en regelmæssig DQM. De skal således verificere output feed data uanset kilde.

2. De kompetente DQM-myndigheder skal anvende DQM-indikatorerne i overensstemmelse med bilag I.

3. Hvad angår de attributter, der er omfattet af bilag I, skal de kompetente DQM-myndigheder anvende DQM-tærskler på et niveau, der sikrer, at kvaliteten af output feed data er i overensstemmelse med kravet om at støtte anvendelsen af de respektive attributter, som fremgår af bilag II.

Artikel 5

Indledende DQM

1. Den indledende DQM foretages for DQM-målene 1, 2, 3a, 3b og 6, som specificeret i bilag I.

2. ECB skal gøre de foreløbige data ultimo måneden tilgængelige syv arbejdsdage før udgangen af hver kalendermåned.

3. Ved udførelsen af en indledende DQM skal de kompetente DQM-myndigheder verificere væsentlige statistiske afvigelser for at sikre, at output feed dataene, efter at en indledende DQM er gennemført, så vidt muligt afspejler den seneste udvikling.

4. De kompetente DQM-myndigheder skal verificere de foreløbige data ultimo måneden inden udgangen af den anden arbejdsdag i den følgende kalendermåned, i det omfang DQM-tærsklerne, målt på basis af DQM-indikatorerne, ikke er blevet opfyldt.

5. Hvis ingen benchmarkdata er tilgængelige uden for CSDB'en, skal den indledende DQM udelukkende foretages på grundlag af informationer, som er let tilgængelige for den kompetente DQM-myndighed, eller som let kan fremskaffes, uden at det er nødvendigt at oprette en ny indberetningsstruktur.

6. De kompetente DQM-myndigheder skal korrigere inputdataene i overensstemmelse med DQM-processen ved at anvende CSDB-systemet eller ved at fremsende filer med inputdata til ECB, hvor det er hensigtsmæssigt.

Artikel 6

Regelmæssig DQM

1. Den regelmæssige DQM foretages for DQM-målene 3a, 3b, 4, 5 og 6, som specificeret i bilag I.

2. De kompetente DQM-myndigheder skal udføre den regelmæssige DQM senest en måned efter udgangen af hver kalendermåned. De skal verificere output feed data under hensyntagen til alle de oplysninger, som er tilgængelige på det pågældende tidspunkt senest den anden arbejdsdag i den kalendermåned efter måneden, hvori en regelmæssig DQM er udført.

3. De kompetente DQM-myndigheder skal korrigere inputdata i overensstemmelse med den aftalte DQM-proces ved at anvende CSDB-systemet eller ved at fremsende filer med inputdata til ECB, hvor det er hensigtsmæssigt.

Artikel 7

Opgaver i forbindelse med datakildeforvaltning

1. De kompetente DQM-myndigheder skal notere alle problemer, der måtte være i forbindelse med forvaltningen af datakilder, og indberette disse til ECB.

2. ECB skal i samarbejde med den pågældende kompetente DQM-myndighed træffe foranstaltninger til imødegåelse af gentagne fejl af høj prioritet, der vedrører datakildeforvaltningen, senest en måned efter den dag, hvor et problem i forbindelse med datakildeforvaltningen er indberettet til ECB.

Artikel 8

Korrektion af inputdata

En DQM-myndighed, som har forbedret inputdata, skal anvende CSDB-systemet til at korrigere de fejl eller mangler i dens inputdata, som ikke blev korrigeret i forbindelse med den verificering, der er specificeret i artikel 5, stk. 4.

Artikel 9

Årlig kvalitetsrapport

Under hensyntagen til ESCB's Statistiske Komités synspunkter skal ECB's Direktion en gang om året aflægge rapport til Styrelsesrådet om kvaliteten af output feed data.

Artikel 10

Forenklet ændringsprocedure

Under hensyntagen til ESCB's Statistiske Komités synspunkter kan ECB's Direktion foretage tekniske ændringer af bilagene til denne retningslinje, forudsat at de pågældende ændringer hverken ændrer ved retningslinjens underliggende begrebsmæssige ramme, herunder ansvarsfordelingen mellem ECB og de nationale centralbanker, eller væsentligt påvirker de kompetente DQM-myndigheders indberetningsbyrde. Direktionen underretter uden ophold Styrelsesrådet om alle sådanne ændringer.

Artikel 11

Ikrafttrædelse

1. Denne retningslinje træder i kraft den 1. november 2012.

2. Denne retningslinje finder anvendelse fra den 1. juli 2013.

Artikel 12

Adressater

Denne retningslinje er rettet til alle centralbanker i Eurosystemet.

Udfærdiget i Frankfurt am Main, den 26. september 2012.

For ECB's Styrelsesråd
Mario DRAGHI
Formand for ECB

BILAG I

DQM-MÅL, GENNEMFØRELSE, ATTRIBUTTER OG GRUNDLAGET FOR DQM-TÆRSKLER

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
Mål 1: **Datastabilitet — beholdningsdata**	Begreb: Indikatoren defineres for hver kombination af residensland/sektor som et volumenvægtet »ændringsindeks«, vægtet med monetære beløb. En indeksværdi på 1 angiver, at den pågældende attribut ikke har ændret sig for nogen af de underliggende værdipapirer, mens en indeksværdi på 0 angiver, at den pågældende attribut har ændret sig for alle værdipapirer. Hvis et indeks falder til under 1, identificeres de enkelte værdipapirer med den ændrede attribut, der har forårsaget indeksfaldet, så ændringen kan verificeres, indtil tærsklen er nået. Begivenheder, der udløser en indeksændring: For diskrete attributter vil enhver difference i attributten måned-til-måned udløse en indeksændring. For kontinuerte attributter vil enhver difference måned-til-måned på mere end 25 % udløse en indeksændring. Dækning: Denne DQM-indikator dækker alle investeringsforeningsandele, aktier og gældsinstrumenter, herunder pengemarkedsinstrumenter med en udløbsdato på under tre måneder.	Mål 1 måler stabiliteten af beholdningsdata. Ikke-verificerede ændringer af CSDB-attributterne må ikke bevirke, at andelen af stabile data falder til under DQM-tærsklen for hver enkelt af de følgende udstedersektorer i det Europæiske Regnskabssystem (ENS) [1]: — S.11 »ikke-finansielle selskaber« (S.11 i henhold til ENS 95) — S.121 »centralbanker« (S.121 i henhold til ENS 95) — S.122 »pengeinstitutter, undtagen centralbanken« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.123 »pengemarkedsforeninger (MMF)« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.124 »investeringsforeninger, undtagen pengemarkedsforeninger « (S.123 i henhold til ENS 95) — S.125 »andre finansielle formidlere, undtagen forsikringsselskaber og pensionskasser« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.126 »finansielle hjælpeenheder« (S.124 i henhold til ENS 95) — S.127 »koncerntilknyttede finansielle institutioner og pengeudlånere« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.128 »forsikringsselskaber« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.129 »pensionskasser« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.13 »offentlig forvaltning og service« (S.13 i henhold til ENS 95).	Eksplicitte attributter: Udstedelsesdato for gældsinstrumenter, forfaldsdato for gældsinstrumenter, nominel valuta, grundlag for prisangivelse, instrumentklassificering i ENS, udstederes residensland, udstedersektor i ENS, udstederbranche ifølge European Classification of Economic Activities (NACE), udestående beløb, antal udestående aktier af børsnoterede aktier.	Udestående beløb eller markedskapitalisering i euro, udtrykt som andel af beholdningsdata.

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
Mål 2: **Datanøjagtighed — nye udstedelser og indfriede beløb, nettoudstedelser**	Begreb: Indikatoren defineres for hver kombination af residensland/sektor og dækker nye udstedelser, indfrielser og udestående beløb for gældsinstrumenter, angivet i procent. Indikatoren angiver nettoudstedelsen i løbet af en måned i forhold til udestående beløb ultimo den foregående måned (ændring i procent) og gør det muligt at overvåge den relative udvikling i udestående gæld. Det skal være muligt at vurdere disaggregerede data ned til de enkelte nye udstedelser og indfriede beløb, der har forårsaget ændringen i de udestående beløb. Udviklingen skal verificeres, indtil tærsklen er nået.	Mål 2 måler nye udstedelser og indfriede beløb i forhold til de pågældende beholdningsdata. Ikke-verificerede data over udestående beløb for nye udstedelser og indfrielser af gældsinstrumenter angivet i procent må netto ikke overskride DQM-tærsklen for hver enkelt af de følgende udstedersektorer i ENS: — S.11 »ikke-finansielle selskaber« (S.11 i henhold til ENS 95) — S.121 »centralbanker« (S.121 i henhold til ENS 95) — S.122 »pengeinstitutter, undtagen centralbanken« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.123 »pengemarkedsforeninger (MMF)« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.124 »investeringsforeninger, undtagen pengemarkedsforeninger « (S.123 i henhold til ENS 95) — S.125 »andre finansielle formidlere, undtagen forsikringsselskaber og pensionskasser« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.126 »finansielle hjælpeenheder« (S.124 i henhold til ENS 95) — S.127 »koncerntilknyttede finansielle institutioner og pengeudlånere« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.128 »forsikringsselskaber« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.129 »pensionskasser« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.13 »offentlig forvaltning og service« (S.13 i henhold til ENS 95).	Eksplicitte attributter: Udestående beløb. Implicitte attributter: Udstedelsesdato, forfaldsdato, nominel valuta, grundlag for prisangivelse, instrumentklassificering i ENS, udsteders residensland, udstedersektor i ENS.	Udestående beløb i euro, udtrykt som den relative udvikling i forhold til de pågældende beholdningsdata.

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
Mål 3a: **Datanøjagtighed — til støtte for korrekt sektorallokering og dataekstrahering efter udsteder**	Begrebsmæssig baggrund: CSDB'en knytter information om udsteder og instrument sammen på et forholdsmæssigt grundlag, der kan beskrives som »en i forhold til mange«, dvs. at én udsteder kan være knyttet til mange instrumenter, mens hvert instrument kun kan være knyttet til én udsteder. Denne sammenkobling af instrumenter og udstedere foretages ved hjælp af individuelle udstederidentifikatorer, der oplyses af de forskellige leverandører af inputdata. Da der indtil videre ikke findes en fælles standard, anvender de enkelte dataleverandører forskellige identifikatorer, men disse bør være konsistente. Hvis leverandørerne af inputdata leverer inkonsistente (sammenfaldende) udstederidentifikatorer for det samme instrument, dvs. hvis de er uenige om udstederen, kan instrumentet ikke allokeres til en bestemt udsteder og placeres i en »sammenfaldsgruppe«. Instrumenter i gruppen »sammenfald« kan klassificeres korrekt efter land og sektor, men det er ikke muligt at knytte dem konsistent til den relevante udsteder af instrumentet. Instrumenter i gruppen »sammenfald« forhindrer, at der kan foretages en konsistent og pålidelig ekstrahering af alle instrumenter, der er udstedt af en bestemt udsteder. Instrumenter i gruppen »sammenfald« øger risikoen for fejlklassificering efter residensland eller sektor. Begreb: For hvert residensland skal indikatoren identificere de instrumenter, som er placeret i gruppen »sammenfald«, og angive deres procentvise andel enten som antal eller som monetært beløb i forhold til alle instrumenterne for det pågældende land. Dækning: Indikatoren skal dække alle instrumenter i CSDB'en.	Mål 3a måler den korrekte identificering af udstederpopulationen. Hvis der er uoverensstemmelser med hensyn til udstederen af et instrument, dvs. instrumenter i gruppen »sammenfald«, må sådanne instrumenter ikke overskride DQM-tærsklen.	Eksplicitte attributter: Udstederidentifikator, der anvendes til gruppering.	Udestående beløb i euro, der henviser til instrumenter i gruppen »sammenfald«, udtrykt som en procentvis andel af alle instrumenterne.

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
Mål 3b: **Datanøjagtighed — til støtte for korrekt sektorallokering og dataekstrahering efter udsteder**	Begrebsmæssig baggrund: CSDB'en knytter information om udsteder og instrument sammen på et forholdsmæssigt grundlag, der kan beskrives som »en i forhold til mange«, dvs. at én udsteder kan være knyttet til mange instrumenter, mens hvert instrument kun kan være knyttet til én udsteder. Denne sammenkobling af instrumenter og udstedere foretages ved hjælp af individuelle udstederidentifikatorer, der oplyses af de forskellige leverandører af inputdata. Da der indtil videre ikke findes en fælles standard, anvender de enkelte dataleverandører forskellige identifikatorer, men disse bør være konsistente. Hvis ingen dataleverandør angiver en udstederidentifikator for et instrument, opstår der en risiko for, at dette instrument ikke kan allokeres til en bestemt udsteder og ender i en »alenestående gruppe«, der kun består af dette instrument. Instrumenter i gruppen »alenestående« kan stadig klassificeres korrekt efter land og sektor, men det er ikke muligt at knytte dem konsistent til den pågældende udsteder af instrumentet. Instrumenter i gruppen »alenestående« forhindrer, at der kan foretages en konsistent og pålidelig ekstrahering af alle instrumenter, der er udstedt af en bestemt udsteder. Instrumenter i gruppen »alenestående« øger risikoen for fejlklassificering efter residensland eller sektor, da de ofte indberettes med ufuldstændige informationer. Begreb: For hvert residensland skal indikatoren identificere instrumenterne i gruppen »alenestående« og angive deres procentvise andel enten som antal eller som monetært beløb i forhold til alle instrumenterne for det pågældende land.	Mål 3b måler den korrekte identificering af udstederpopulationen. Hvis der ikke findes pålidelig information om udstederen af et instrument, dvs. instrumenter i gruppen »alenestående«, må sådanne instrumenter ikke overskride DQM-tærsklen.	Eksplicitte attributter: Udstederidentifikator, der anvendes til gruppering.	Udestående beløb i euro, der henviser til instrumenter i gruppen »alenestående«, udtrykt som en procentvis andel af alle instrumenterne.

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
	Dækning: Indikatoren skal dække alle instrumenter i CSDB'en.			
Mål 4: **Datanøjagtighed — data om udestående beløb for gældsinstrumenter, herunder pengemarkedsinstrumenter**	Begreb: Indikatoren skal aggregere udestående beløb for gældsinstrumenter, herunder pengemarkedsinstrumenter, efter den enkelte udsteders residensland og udstedersektor i henhold til begrebet statistik over værdipapirudstedelser (securities issues statistics, SEC). Dette aggregat skal sammenholdes med det respektive SEC-tal, og CSDB-dataenes procentvise afvigelse skal beregnes. Ikke-verificerede og uforklarede forskelle må ikke overskride DQM-tærsklen.	Mål 4 sammenholder CSDB'ens outputdata med eksterne benchmarkdata. Ikke-verificerede og uforklarede forskelle mellem aggregerede CSDB-data og de respektive informationer fra ECB SEC eller andre pålidelige benchmarks må, under forudsætning af tilgængeligheden af sådanne benchmarkdata, ikke overskride DQM-tærsklen for samme referencedato for hver enkelt af de følgende udstedersektorer i ENS: — S.11 »ikke-finansielle selskaber« (S.11 i henhold til ENS 95) — S.121 »centralbanker« (S.121 i henhold til ENS 95) — S.122 »pengeinstitutter, undtagen centralbanken« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.123 »pengemarkedsforeninger (MMF)« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.124 »investeringsforeninger, undtagen pengemarkedsforeninger « (S.123 i henhold til ENS 95) — S.125 »andre finansielle formidlere, undtagen forsikringsselskaber og pensionskasser« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.126 »finansielle hjælpeenheder« (S.124 i henhold til ENS 95) — S.127 »koncerntilknyttede finansielle institutioner og pengeudlånere« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.128 »forsikringsselskaber« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.129 »pensionskasser« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.13 »offentlig forvaltning og service« (S.13 i henhold til ENS 95).	Eksplicitte attributter: Udestående beløb i euro, markedskapitalisering i euro. Implicitte attributter: Udstedelsesdato, forfaldsdato, valuta, udstedersektor i ENS, residensland.	Udestående beløb eller markedskapitalisering i euro udtrykt som en procentvis forskel mellem CSDB og de eksterne benchmarks.

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
Mål 5: **Datanøjagtighed — markedskapitalisering af aktier**	Begreb: Indikatoren skal aggregere markedskapitaliseringen for aktier efter den enkelte udsteders residensland og udstedersektor i henhold til begrebet statistik over værdipapirudstedelser. Dette aggregat skal sammenholdes med det respektive SEC-tal, og CSDB-dataenes procentvise afvigelse skal beregnes. Ikke-verificerede og uforklarede forskelle må ikke overskride DQM-tærsklen.	Mål 5 sammenholder CSDB'ens outputdata med eksterne benchmarkdata. Ikke-verificerede og uforklarede forskelle mellem de aggregerede CSDB-informationer og de respektive informationer fra ECB SEC eller andre pålidelige benchmarks må, under forudsætning af tilgængeligheden af sådanne benchmarkdata, ikke overskride DQM-tærsklen for den samme referencedato for hver af de følgende udstedersektorer i ENS: — S.11 »ikke-finansielle selskaber« (S.11 i henhold til ENS 95) — S.121 »centralbanker« (S.121 i henhold til ENS 95) — S.122 »pengeinstitutter, undtagen centralbanken« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.123 »pengemarkedsforeninger (MMF)« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.124 »investeringsforeninger, undtagen pengemarkedsforeninger « (S.123 i henhold til ENS 95) — S.125 »andre finansielle formidlere, undtagen forsikringsselskaber og pensionskasser« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.126 »finansielle hjælpeenheder« (S.124 i henhold til ENS 95) — S.127 »koncerntilknyttede finansielle institutioner og pengeudlånere« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.128 »forsikringsselskaber« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.129 »pensionskasser« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.13 »offentlig forvaltning og service« (S.13 i henhold til ENS 95).	Eksplicitte attributter: Udestående beløb i euro, antal udestående aktier af børsnoterede aktier. Implicitte attributter: Nominel valuta, udstedersektor i ENS, residensland, kursværdi for noterede aktier (kun ekstreme værdier verificeres).	Udestående beløb eller markedskapitalisering i euro udtrykt som en procentvis forskel mellem CSDB og de eksterne benchmarks.

DQM-mål	DQM-indikator	Gennemførelse	Attributter for output feed data	Grundlaget for DQM-tærskler
Mål 6: **Datanøjagtighed — klassificering af udsteder**	Begreb: Indikatoren skal rangordne udstedere for hver kombination af residensland/udstedersektor på grundlag af deres samlede værdipapirbaserede forpligtelser (aktier og gæld). Indikatoren skal også vise de absolutte ændringer i rangordenen mellem forskellige udstedere for at gøre det lettere at identificere signifikante ekstreme værdier i de udestående beløb eller i markedskapitaliseringen. Udstederens residensland og sektorklassificering skal verificeres op til DQM-tærsklen. Dækning: Denne indikator dækker alle investeringsforeningsandele, aktier og gældsinstrumenter med en udløbsdato på under tre måneder.	Mål 6 måler den statistiske klassificering af udstedere. Den statistiske klassificering af udstedere op til DQM-tærsklen skal verificeres for hver enkelt af de følgende udstedersektorer i ENS: — S.11 »ikke-finansielle selskaber« (S.11 i henhold til ENS 95) — S.121 »centralbanker« (S.121 i henhold til ENS 95) — S.122 »pengeinstitutter, undtagen centralbanken« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.123 »pengemarkedsforeninger (MMF)« (S.122 i henhold til ENS 95) — S.124 »investeringsforeninger, undtagen pengemarkedsforeninger « (S.123 i henhold til ENS 95) — S.125 »andre finansielle formidlere, undtagen forsikringsselskaber og pensionskasser« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.126 »finansielle hjælpeenheder« (S.124 i henhold til ENS 95) — S.127 »koncerntilknyttede finansielle institutioner og pengeudlånere« (S.123 i henhold til ENS 95) — S.128 »forsikringsselskaber« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.129 »pensionskasser« (S.125 i henhold til ENS 95) — S.13 »offentlig forvaltning og service« (S.13 i henhold til ENS 95).	Udstedersektor i ENS, residensland.	Udestående beløb eller markedskapitalisering i euro udtrykt som »kapitalisering«, dvs. udestående beløb plus markedskapitalisering pr. udsteder.

(1) Nummereringen af kategorier afspejler nummereringen, der blev indført i Europa-Parlamentets og Rådets forslag til forordning om det europæiske national- og regionalregnskabssystem i Den Europæiske Union KOM(2010) 774 endelig.

BILAG II

ATTRIBUTTER FOR FEEDS OG OUTPUT FEED DATA, SOM ER OMFATTET AF RAMMERNE FOR DATAKVALITETSSIKRING

Rammerne for datakvalitetssikring (DQM) omfatter følgende feeds, som støtter forskellige anvendelser:

— Feed, der støtter betalings- og kapitalbalancestatistik (external statistics EXT 1.0)

— Feed over FVC-selskaber (financial vehicle corporations), der støtter statistik over financial vehicle corporations (FVC 1.0)

— Feed over investeringsforeninger, der støtter statistik over investeringsforeninger (IF 1.0)

— Feed over værdipapirbeholdninger, der støtter statistik over værdipapirbeholdninger (SHS 1.0)

— Feed over værdipapirfinansiering af offentlig forvaltning og service, der støtter statistik over værdipapirfinansiering af offentlig forvaltning og service (GSF 1.0)

Attributter for output feed data, der udgør støttefeeds:

Output feed data-attributtens navn	Beskrivelse	Anvendelig feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number, ISIN (Internationalt identifikationsnummer for værdipapirer)	ISIN-værdipapiridentifikator.	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) Class (Instrumentklasse i Det Europæiske Nationalregnskabssystem, ENS)	Klassificering af værdipapirer i henhold til ENS.	√	√	√	√	√
Debt type (Gældstype)	Type af gældsinstrument				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	En attribut, som kan anvendes til at identificere de værdipapirer, der bør føres under »aktuelle udestående beløb« i overensstemmelse med definitionerne i ECB SEC.					√
Instrument supplementary class (Supplerende instrumentklasse)	Supplerende attribut, der gør det muligt at fastslå, om et instrument bør inkluderes i SEC eller ej. Denne attribut kan antage værdier som 1 = »strippet kupon«, 2 = »strippet hovedstol« osv.					√
Security status (Værdipapirstatus)	Supplerende attribut, der gør det muligt at fastslå, om et instrument bør inkluderes i SEC eller ej. Denne attribut kan vise, om et instrument lever eller ej.					√
Asset securitisation type (Type sikkerhed)	Typen af aktiv, der anvendes til sikkerhed.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Attribut, der angiver, om et instrument er godkendt til at blive anvendt som sikkerhed i Eurosystemets kreditoperationer.				√	
Nominal currency (Nominel valuta)	Instrumentets nominelle valuta (Den Internationale Standardiseringsorganisation ISO, 4217)	√	√	√	√	√

Output feed data-attributtens navn	Beskrivelse	Anvendelig feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue date (Udstedelsesdato)	Den dato, hvor udstederen leverer værdipapirerne til garanten mod betaling. Dette er dagen, hvor værdipapirerne for første gang kan leveres til investorerne. Bemærk: Hvad angår en strip, angiver denne kolonne datoen, hvor kuponen/hovedstolen strippes.	√	√	√	√	√
Maturity date (Forfaldsdato)	Dato, hvor gældsinstrumentet faktisk indfries.	√	√	√	√	√
Residual maturity (Restløbetid)	Restløbetiden for et instrument beregnet på den dato, hvor dataene registreres.					√
Issuer domicile country (Udsteders hjemsted)	Det land, hvor udstederen af værdipapiret juridisk er stiftet (domicil) (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (Udstedersektor i henhold til ENS)	Udstederens institutionelle sektor i henhold til ENS.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (Klassificering af udstederbranche efter European Classification of Economic Activities, NACE)	Økonomisk hovedaktivitet i henhold til NACE.	√				
Amount issued (Udstedt beløb)	Det beløb, der er blevet rejst ved udstedelse af gældsinstrumentet (i nominel værdi). Hvad angår en strip, angiver denne kolonne beløbet, som kuponen/hovedstolen er blevet strippet ved. Hvad angår et værdipapir udstedt i trancher, under en ISIN-kode, angiver denne kolonne det akkumulerede beløb, som er udstedt indtil nu. Udstedte beløb angives i nominel valuta.					√
Amount outstanding (Udestående beløb)	Udestående beløb i nominel værdi. Hvad angår et værdipapir udstedt i trancher, under den samme ISIN-kode, angiver denne kolonne det akkumulerede beløb, som er udstedt indtil nu efter fradrag af indfriede beløb. Værdier angives i nominel valuta. Udestående beløb angives i nominel valuta. Hvis den nominelle valuta mangler, angives det udestående beløb i euro.	√			√	√
Amount outstanding in euro (Udestående beløb i euro)	Udestående beløb omregnes til euro ved hjælp af vekselkursen for den nominelle valuta på datoen, hvor dataene registreres.				√	√
Market capitalisation (Markedskapitalisering)	Seneste tilgængelige markedskapitalisering. Markedskapitaliseringen angives i nominel valuta. Hvis den nominelle valuta mangler, angives markedskapitaliseringen i euro.				√	

Output feed data-attributtens navn	Beskrivelse	Anvendelig feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Den effektive rente)	Værdipapirets effektive rente angives i procent.				√	√
Short name (Forkortet navn)	Forkortet navn, valgt af udstederen, der defineres på grundlag af emissionens kendetegn og andre tilgængelige informationer.					√
Pool factor (Puljefaktor)	For realkreditlån er puljefaktoren eller faktoren for den resterende hovedstol den udestående hovedstol i den underliggende pulje af realkreditlån divideret med den oprindelige hovedstol.	√	√	√	√	√
Quotation basis (Grundlag for prisangivelse)	Prisangivelsen for instrumentet, f.eks. procent af nominelt beløb (procent) eller valuta pr. aktie/andel (stk.).	√	√	√	√	√
Price value (Kursværdi)	Senest tilgængelige repræsentative pris for instrumentet på referencedatoen baseret på instrumentets prisangivelsesgrundlag og i givet fald i nominel valuta. Hvad angår rentebærende værdipapirer, angives »clean price«, dvs. uden påløbne renter.	√	√	√	√	√
Price value type (Arten af kursværdi)	Arten af kursværdi, dvs. om den udgør en markedsværdi, en estimeret værdi eller en foruddefineret (default) værdi.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Månedlig gennemsnitskurs)	Gennemsnittet af de normaliserede kurser for instrumentet, der er tilgængelige i de sidste 30 dage frem til referencedatoen baseret på prisangivelsesgrundlaget og i givet fald i nominel valuta.	√			√	
Redemption type (Indfrielsestype)	Indfrielsestype, f.eks. bullet, perpetual, structured, annuity, serial, irregular, null, stepped.					√
Redemption frequency (Indfrielseshyppighed)	Antal indfrielser pr. år for et gældsinstrument.					√
Redemption price (Indfrielseskurs)	Endelig indfrielseskurs.					√
Accrued interest (Påløbne renter)	Påløbne renter siden den sidste kuponbetaling eller siden det tidspunkt, hvor forrentningen begyndte. Hvis denne værdi lægges til kursværdien for rentebærende værdipapirer, fås en såkaldt »dirty price«.	√	√	√		√
Accrued income factor (Faktor for påløben indkomst)	En værdipapirspecifik indtægtsfaktor i procent, der beregnes dagligt på grundlag af oplysninger om debitor. Faktoren beregnes ud fra påløben indkomst, dvs. at den viser den kombinerede effekt af påløbne renter og påløben indkomst, som kan tilskrives forskellen i udstedelses- og indfrielseskursen.	√	√	√	√	

Output feed data-attributtens navn	Beskrivelse	Anvendelig feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Kupontype)	Kupontype, dvs. fast, variabel, stepped mv.				√	√
Last coupon rate (Seneste kuponrente)	Seneste kuponrente i procent pr. år, som faktisk er udbetalt (årlig rente).	√	√	√	√	
Last coupon date (Seneste kupondato)	Dato for seneste faktisk betalte kuponrente. Attributten gør det muligt at fastslå, om den sidste faktisk betalte kuponrente falder inden for rapporteringsperioden eller ej.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Seneste kuponhyppighed)	Hyppighed pr. år, hvormed den seneste kuponrente er udbetalt: »årlig« bliver til »AN«, halvårlig« til »SA« osv.	√	√	√	√	
Dividend amount (Dividendebeløb)	Beløbet på den seneste dividende, der er betalt pr. aktie (angivet i type dividendebeløb) før skat (bruttodividende).	√		√	√	
Dividend amount type (Type dividendebeløb)	Dividendebeløb pr. aktie kan angives i dividendevalutaen eller i antal aktier.	√		√	√	
Dividend currency (Dividendevaluta)	ISO 4217-koden for den valuta, som den seneste dividende blev betalt i.	√		√	√	
Dividend Settlement date (Dividendeafviklingsdato)	Afviklingsdato for den seneste dividendebetaling. Attributten gør det muligt at fastslå, om det betalte dividendebeløb falder inden for rapporteringsperioden eller ej.	√		√	√	
Last split factor (Seneste splitfaktor)	Aktiesplit og omvendt aktiesplit.	√		√	√	
Last split date (Seneste splitdato)	Datoen for, hvornår et aktiesplit træder i kraft.	√		√	√	