LEITLINIEN

LEITLINIE DER EUROPÄISCHEN ZENTRALBANK

vom 26. September 2012

über das Rahmenwerk für das Datenqualitätsmanagement der zentralisierten Wertpapierdatenbank

(EZB/2012/21)

(2012/689/EU)

DER EZB-RAT —

gestützt auf die Satzung des Europäischen Systems der Zentralbanken und der Europäischen Zentralbank, insbesondere auf Artikel 5.1, 12.1 und 14.3,

gestützt auf die Verordnung (EG) Nr. 2533/98 des Rates vom 23. November 1998 über die Erfassung statistischer Daten durch die Europäische Zentralbank [1],

in Erwägung nachstehender Gründe:

(1) Bei der zentralisierten Wertpapierdatenbank (Centralised Securities Database, nachfolgend die „CSDB") handelt es sich um eine einheitliche IT-Infrastruktur, die von den Mitgliedern des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB) gemeinsam betrieben wird, einschließlich der nationalen Zentralbanken (NZBen) der Mitgliedstaaten, die dem Euro-Währungsgebiet nicht angehören, soweit sich diese NZBen freiwillig am Betrieb der CSDB beteiligen. In der CSDB werden Angaben zu einzelnen Positionen gespeichert, insbesondere über Wertpapiere, ihre Emittenten und Kurse.

(2) Die Daten werden von verschiedenen Quellen, u. a. von ESZB-Mitgliedern, ausgewählten kommerziellen Datenanbietern, von öffentlich zugänglichen Quellen sowie Verwaltungen gesammelt und in die CSDB eingeliefert. Es besteht jedoch das Risiko, dass die eingelieferten Datensätze (Inputdaten) ungenau oder unvollständig sind. Das CSDB-System ermöglicht es, aus verschiedenen Quellen stammende, teilweise widersprüchliche Inputdaten abzugleichen sowie unvollständige oder fehlende Daten zu erkennen. Es führt automatisch Inputdaten aus unterschiedlichen, sich überschneidenden Quellen so weit wie möglich zu einem vollständigen und qualitativ hochwertigen einheitlichen Datensatz zusammen.

(3) Die Gesamtqualität der Daten in der CSDB lässt sich nicht allein auf der Ebene der einzelnen Inputdatensätze, sondern nur auf der Ebene der zusammengeführten Ergebnisdatensätze (Outputdaten) beurteilen. Zur Gewährleistung größtmöglicher Vollständigkeit, Genauigkeit und Einheitlichkeit der Outputdaten muss ein Rahmenwerk für das Datenqualitätsmanagement (DQM) ausgewählter Ergebnisdaten (sogenannte Outputfeed-Daten) festgelegt werden, d. h. einer Gruppe von Outputdaten, die zur Erstellung von Statistiken und für andere Zwecke verwendet werden können. Diese Outputfeed-Daten werden den NZBen spätestens sieben Arbeitstage nach Ende eines jeden Kalendermonats zur Verfügung gestellt.

(4) Einige Outputfeed-Daten umfassen auch Wertpapiermerkmale (Attribute) wie Kurse oder renditebezogene Angaben, bei denen im Laufe der Zeit Schwankungen zu erwarten sind. Diese Attribute werden vom CSDB-System mithilfe statistischer Algorithmen automatisch überprüft. Lediglich bei den in Anhang I im Rahmen der einzelnen DQM-Ziele genannten Attributen erfolgt eine Überprüfung durch die zuständigen Stellen nach Maßgabe dieser Leitlinie. Die vollständige Liste der Attribute, die in die unterstützten Feeds einfließen, ist in Anhang II aufgeführt.

(5) Das Rahmenwerk für das DQM der CSDB sollte unabhängig von der Inputdatenquelle für alle Outputfeed-Daten gelten. In diesem Rahmen sollten die Verantwortlichkeiten der NZBen des Euro-Währungsgebiets hinsichtlich der Qualität der Outputdaten in der CSDB und, falls erforderlich, die Verantwortlichkeiten der Europäischen Zentralbank (EZB) festgelegt werden.

(6) Das Rahmenwerk für das DQM der CSDB sollte erstens auf DQM-Zielen beruhen, die Indikatoren zur Beurteilung der Qualität der Outputfeed-Daten darstellen, und zweitens auf DQM-Messziffern basieren, mithilfe derer für jedes DQM-Ziel die zu überprüfenden Outputfeed-Daten bestimmt und ihrer Priorität nach geordnet werden. Darüber hinaus sollte das DQM-Rahmenwerk auf DQM-Schwellenwerten beruhen, anhand derer der Mindestumfang der Überprüfung bestimmt wird, die bezüglich eines DQM-Ziels durchgeführt werden muss.

(7) Mangels vorhandener Vergleichsdaten lassen sich anhand der DQM-Ziele nicht immer Fehler in den Outputfeed-Daten erkennen, sondern nur die Fälle aufzeigen, in denen eine manuelle Überprüfung der Outputfeed-Daten notwendig ist.

(8) Da die CSDB von allen ESZB-Mitgliedern gemeinsam verwaltet wird, sollten diese alle die Einhaltung derselben DQM-Standards anstreben. Überdies sind die nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen am besten zur Durchführung des DQM für diejenigen Daten in der Lage, die sich auf die in ihrem jeweiligen Mitgliedstaat

[1] ABl. L 318 vom 27.11.1998, S. 8.

gebietsansässigen Emittenten beziehen. Die von der EZB verabschiedeten Leitlinien können zwar anerkanntermaßen keine Pflichten der nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen begründen, doch gilt Artikel 5 der Satzung des Europäischen Systems der Zentralbanken und der Europäischen Zentralbank sowohl für NZBen des Euro-Währungsgebiets als auch für nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörende NZBen. Die nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen sollten deshalb alle Maßnahmen erarbeiten und umsetzen, die sie zur Durchführung des DQM nach Maßgabe dieser Leitlinie für angemessen erachten.

(9) Zur Verbesserung der Qualität der Outputdaten sollte ein Datenquellenmanagement (Data Source Management — DSM) durchgeführt werden, um wiederkehrende und strukturelle Fehler in den Inputdaten bereits beim Datenanbieter zu erkennen und zu berichtigen —

HAT FOLGENDE LEITLINIE ERLASSEN:

Artikel 1

Begriffsbestimmungen

Im Sinne dieser Leitlinie sind die nachfolgend aufgeführten Begriffe wie folgt zu verstehen:

1. „CSDB“: die vom ESZB eingerichtete zentralisierte Wertpapierdatenbank, die sich in den Räumlichkeiten der EZB befindet;

2. „Inputdaten“: Daten, die dem ESZB von einer oder mehreren Datenquellen geliefert werden;

3. „Outputdaten“: Daten, die in der CSDB durch automatische Zusammenführung der Inputdaten zu einem vollständigen und qualitativ hochwertigen einheitlichen Datensatz erzeugt werden;

4. „Outputfeed-Daten“: Gruppe der in Anhang II aufgeführten Outputdaten und Attribute, die als Dateninput die Erstellung von Statistiken und andere Zwecke unterstützen;

5. „Datenqualitätsmanagement“ oder „DQM“: Gewährleistung, Überprüfung und Aufrechterhaltung der Qualität der Outputfeed-Daten durch Nutzung und Anwendung der DQM-Ziele, DQM-Messziffern, DQM-Schwellenwerte und des DQM-Arbeitsprozesses;

6. „Datenquellenmanagement“ oder „DSM“: Erkennung und Berichtigung wiederkehrender und/oder struktureller Fehler in den Inputdaten in direkter Zusammenarbeit mit dem Datenanbieter;

7. „anfängliches DQM“: das DQM der Outputfeed-Daten — einschließlich der Daten für den aktuellsten Zeitraum —, welches die für das DQM zuständigen Stellen monatlich unter Berücksichtigung der im Rahmen der Vorablieferungen von Monatsdaten zur Verfügung gestellten Outputfeed-Daten durchführen;

8. „regelmäßiges DQM“: das DQM der Outputfeed-Daten, welches die für das DQM zuständigen Stellen monatlich unter Berücksichtigung von nicht aus der CSDB, sondern aus verschiedenen Datenquellen stammenden Vergleichsdatendaten durchführen um sicherzustellen, dass die Qualität der CSDB-Outputdaten den für die CSDB-Feeddaten geltenden Anforderungen entspricht;

9. „DQM-Ziel“: ein Richtwert für die Beurteilung der Qualität der Outputfeed-Daten gemäß Anhang I;

10. „DQM-Messziffer“: ein statistischer Indikator zur Messung, inwieweit ein bestimmtes DQM-Ziel gemäß Anhang I erreicht wurde;

11. „DQM-Schwellenwert“: Mindestumfang der Überprüfung, die durchzuführen ist, um den Anforderungen des DQM-Rahmenwerks bezüglich eines DQM-Ziels zu entsprechen;

12. „DQM-Arbeitsprozess“: technischer Prozess zur Berichtigung der Inputdaten, um den durch eine DQM-Schwelle gestellten Anforderungen zu genügen;

13. „Vorablieferung von Monatsdaten“: regelmäßige monatliche Aktualisierung der Outputdaten und DQM-Messziffern, durch die vorläufige Outputdaten für den nächsten Monatsendstand erstellt werden;

14. „Arbeitstag“: ein ganzer Tag, an dem TARGET2 gemäß der Bekanntmachung auf der EZB-Website geöffnet ist;

15. „Überprüfung“: der Vorgang, bei dem die für das DQM zuständigen Stellen mithilfe des DQM-Arbeitsprozesses die CSDB-Outputfeeddaten prüfen und erforderlichenfalls die CSDB-Inputdaten berichtigen;

16. „gebietsansässig“: der in Artikel 1 der Verordnung (EG) Nr. 2533/98 definierte Begriff.

Artikel 2

Gegenstand und Geltungsbereich

(1) Diese Leitlinie legt ein Rahmenwerk für das DQM der CSDB mit dem Ziel fest, die Vollständigkeit, Genauigkeit und Einheitlichkeit der Outputdaten in der CSDB durch einheitliche Anwendung der Bestimmungen über die für diese Daten geltenden Qualitätsstandards zu gewährleisten.

(2) Das Rahmenwerk für das DQM der CSDB beruht auf dem DQM und dem DSM.

Artikel 3

Für das DQM zuständige Stellen

(1) Die NZB des Mitgliedstaats des Euro-Währungsgebiets, in dem der Wertpapieremittent gebietsansässig ist, ist für das Qualitätsmanagement der Daten zuständig, die diesen Emittenten betreffen.

(2) Die EZB ist für das Qualitätsmanagement der Daten zuständig, die außerhalb des Euro-Währungsgebiets gebietsansässige Emittenten betreffen, es sei denn, eine nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörende NZB hat die Verantwortung für die Durchführung des Qualitätsmanagements der Daten übernommen, die in ihrem Mitgliedstaat gebietsansässige Emittenten betreffen.

Artikel 4

DQM, DQM-Messziffern und DQM-Schwellenwerte

(1) Die für das DQM zuständigen Stellen führen das anfängliche DQM und regelmäßige DQM durch. Dabei überprüfen sie Outputfeed-Daten ungeachtet der Datenquelle.

(2) Die für das DQM zuständigen Stellen wenden DQM-Messziffern im Einklang mit Anhang I an.

(3) Hinsichtlich der in Anhang I aufgeführten Attribute wenden die für das DQM zuständigen Stellen DQM-Schwellenwerte so an, dass die Qualität der Outputfeed-Daten den Anforderungen genügt, die den unterstützten Verwendungszwecken der jeweiligen Attribute gemäß Anhang II entsprechen.

Artikel 5

Anfängliches DQM

(1) Das anfängliche DQM gilt für die in Anhang I bezeichneten DQM-Ziele 1, 2, 3a, 3b und 6.

(2) Die EZB stellt sieben Arbeitstage vor Ende eines jeden Kalendermonats Vorablieferungen von Monatsdaten zur Verfügung.

(3) Bei Durchführung des anfänglichen DQMs überprüfen die für das DQM zuständigen Stellen erhebliche statistische Ausreißer, um sicherzustellen, dass nach Abschluss des anfänglichen DQMs die Outputfeed-Daten so weit wie möglich die jüngsten Entwicklungen widerspiegeln.

(4) Bis zum Ende des zweiten Arbeitstags des darauffolgenden Kalendermonats überprüfen die für das DQM zuständigen Stellen die Vorablieferungen von Monatsdaten, soweit die durch die DQM-Schwellenwerte gestellten Anforderungen nach den DQM-Messziffern nicht erfüllt worden sind.

(5) Sind außerhalb der CSDB keine Vergleichsdaten verfügbar, stützt sich das anfängliche DQM ausschließlich auf Informationen, die der für das DQM zuständigen Stelle ohne Weiteres zugänglich oder die ohne Einrichtung neuer Meldestrukturen einfach zu beschaffen sind.

(6) Die für das DQM zuständigen Stellen berichtigen Inputdaten gemäß dem DQM-Arbeitsprozess durch Nutzung des CSDB-Systems oder gegebenenfalls durch Übermittlung von Einlieferungsdateien an die EZB.

Artikel 6

Regelmäßiges DQM

(1) Das regelmäßige DQM gilt für die in Anhang I genannten DQM-Ziele 3a, 3b, 4, 5 und 6.

(2) Die für das DQM zuständigen Stellen führen innerhalb eines Monats nach Ende eines jeden Kalendermonats ein regelmäßiges DQM durch. Sie überprüfen die Outputfeed-Daten anhand aller aktuell verfügbaren Angaben bis spätestens zum zweiten Arbeitstag des Kalendermonats, der auf den Monat folgt, in dem das regelmäßige DQM durchgeführt wird.

(3) Die für das DQM zuständigen Stellen berichtigen Inputdaten gemäß dem vereinbarten DQM-Arbeitsprozess durch Nutzung des CSDB-Systems oder gegebenenfalls durch Übermittlung von Einlieferungsdateien an die EZB.

Artikel 7

Aufgaben im Zusammenhang mit dem DSM

(1) Die für das DQM zuständigen Stellen identifizieren Probleme im Zusammenhang mit dem DSM und melden sie der EZB.

(2) Innerhalb eines Monats nach Meldung eines solchen Problems an die EZB befasst sich die EZB mit wiederkehrenden, vorrangig zu behebenden Fehlern im Rahmen des DSMs, wobei sie mit der betreffenden, für das DQM zuständigen Stelle zusammenarbeitet.

Artikel 8

Berichtigung von Inputdaten

Eine für das DQM zuständige Stelle berichtigt — sofern sie über Inputdaten verfügt, deren Qualität sich verbessert hat — mithilfe des CSDB-Systems alle in ihren Inputdaten enthaltenen Fehler und Lücken, die nicht im Zuge der in Artikel 5 Absatz 4 vorgesehenen Überprüfung berichtigt worden sind.

Artikel 9

Jährlicher Qualitätsbericht

Unter Berücksichtigung der Position des Ausschusses für Statistik des ESZB erstattet das Direktorium der EZB dem EZB-Rat jährlich Bericht über die Qualität der Outputfeed-Daten.

Artikel 10

Vereinfachtes Änderungsverfahren

Unter Berücksichtigung der Position des Ausschusses für Statistik des ESZB ist das Direktorium der EZB befugt, technische Änderungen der Anhänge dieser Leitlinie vorzunehmen, wenn durch diese Änderungen weder das zugrunde liegende konzeptionelle Rahmenwerk der Leitlinie, einschließlich der Aufgabenverteilung zwischen der EZB und den NZBen, geändert noch der Meldeaufwand der für das DQM zuständigen Stellen wesentlich berührt wird. Das Direktorium teilt dem EZB-Rat alle Änderungen unverzüglich mit.

Artikel 11

Inkrafttreten

(1) Diese Leitlinie tritt am 1. November 2012 in Kraft.

(2) Diese Leitlinie gilt ab dem 1. Juli 2013.

Artikel 12

Adressaten

Diese Leitlinie ist an alle Zentralbanken des Eurosystems gerichtet.

Geschehen zu Frankfurt am Main am 26. September 2012.

Für den EZB-Rat
Der Präsident der EZB
Mario DRAGHI

ANHANG I

DQM-ZIELE, DURCHFÜHRUNG, ATTRIBUTE, BASIS DER DQM-SCHWELLENWERTE

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
Ziel 1: **Datenstabilität — Bestandsdaten**	Konzept: Die Messziffer wird für jede Kombination von Sitzland/Sektor definiert als volumengewichteter „Änderungsindex“, gewichtet mit den monetären Beträgen. Ein Indexwert von 1 zeigt an, dass sich die betreffende Attributsausprägung bei den zugrunde liegenden Wertpapieren nicht verändert hat, während ein Indexwert von 0 anzeigt, dass sich das betreffende Attribut bei allen Wertpapieren verändert hat. Fällt ein Indexwert unter 1, werden die einzelnen Wertpapiere mit der veränderten Attributsausprägung ermittelt, die ursächlich für den Rückgang des Indexes sind, um die Änderung bis zum Erreichen des DQM-Schwellenwerts zu überprüfen. Indexänderungen auslösende Ereignisse: Bei diskreten Attributen gilt jede von einem zum anderen Monat auftretende Differenz als Auslöser einer Indexänderung. Bei dynamischen Attributen gilt jede von einem zum anderen Monat auftretende Differenz von mehr als 25 % als Auslöser einer Indexänderung. Geltungsbereich: Diese DQM-Messziffer gilt für alle Investmentfondsanteile, Anteilsrechte und Schuldverschreibungen, einschließlich Zertifikaten, deren Fälligkeitsdatum nicht länger als drei Monate zurückliegt.	Mit Ziel 1 wird die Stabilität der Bestandsdaten beurteilt. Nichtüberprüfte Änderungen der CSDB-Attribute dürfen nicht dazu führen, dass der Anteil stabiler Daten unter den DQM-Schwellenwert für jeden der nachfolgenden Emittentensektoren des Europäischen Systems Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen (ESVG) [1] sinkt: — S.11 „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften“ (S.11 gemäß ESVG 95) — S.121 „Zentralbank“ (S.121 gemäß ESVG 95) — S.122 „Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.123 „Geldmarktfonds“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.124 „Investmentfonds, die keine Geldmarktfonds sind“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.125 „sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Pensionskassen)“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.126 „Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten“ (S.124 gemäß ESVG 95) — S.127 „firmeneigene Finanzinstitute und Geldgeber“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.128 „Versicherungsgesellschaften“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.129 „Pensionskassen“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.13 „Staat“ (S.13 gemäß ESVG 95)	Explizite Attribute: Emissionsdatum von Schuldverschreibungen, Fälligkeitsdatum von Schuldverschreibungen, Nominalwährung, Notierungsart, Wertpapierart des Instruments, Land der Sitzland des Emittenten, Sektor des Emittenten, NACE-Klassifizierung (europäische Klassifizierung der Wirtschaftszweige) des Emittenten, Umlauf, Anzahl der ausstehenden Aktien bei börsennotierten Aktien	Umlauf oder Marktkapitalisierung in Euro, ausgedrückt als Anteil der Bestandsdaten

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
Ziel 2: **Datengenauigkeit — Neuemissionen und Tilgungen; Nettoemissionen**	Konzept: Die Messziffer wird für jede Kombination von Sitzland/Sektor definiert und gilt für Neuemissionen, Tilgungen und Umlauf von Schuldverschreibungen, ausgedrückt in Prozent. Die Messziffer setzt die Nettoemissionstätigkeit während des Monats in Relation zu dem am Ende des Vormonats ausstehenden Betrag (prozentuale Änderung) und ermöglicht die Beobachtung der relativen Entwicklungen ausstehender Schuldverschreibungen. Ermöglicht wird der Zugriff auf disaggregierte Daten bis hinab auf die Ebene der einzelnen Neuemission und Tilgung, die ursächlich für die Änderung der ausstehenden Beträge ist. Diese Entwicklungen werden bis zum Erreichen des Schwellenwerts überprüft.	Mit Ziel 2 werden Neuemissionen und Tilgungen im Verhältnis zu den jeweiligen Bestandsdaten beurteilt. Nichtüberprüfte Daten über ausstehende Beträge bei Neuemissionen und über die Tilgung von Schuldverschreibungen, ausgedrückt in Prozent, dürfen netto nicht den DQM-Schwellenwert für jeden der nachfolgenden Emittentensektoren überschreiten: — S.11 „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften“ (S.11 gemäß ESVG 95) — S.121 „Zentralbank“ (S.121 gemäß ESVG 95) — S.122 „Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.123 „Geldmarktfonds“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.124 „Investmentfonds, die keine Geldmarktfonds sind“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.125 „sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Pensionskassen)“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.126 „Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten“ (S.124 gemäß ESVG 95) — S.127 „firmeneigene Finanzinstitute und Geldgeber“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.128 „Versicherungsgesellschaften“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.129 „Pensionskassen“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.13 „Staat“ (S.13 gemäß ESVG 95)	Explizite Attribute: Umlauf Implizite Attribute: Emissionsdatum, Fälligkeitsdatum, Nominalwährung, Notierungsart, Wertpapierart des Instruments, Sitzland des Emittenten, Sektor des Emittenten	Umlauf in Euro, ausgedrückt als relative Entwicklung im Vergleich zu den jeweiligen Bestandsdaten

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
Ziel 3a: **Datengenauigkeit — Erleichterung der korrekten Sektorzuweisung und Datenerhebung nach Emittenten**	Konzeptioneller Hintergrund: In der CSDB werden Angaben über Emittent und Instrument in eine als „eins zu vielen“ zu bezeichnende Relation gebracht, d. h., ein Emittent kann zu vielen Instrumenten in Beziehung gesetzt werden, aber jedes einzelne Instrument nur zu einem einzigen Emittenten. Diese Verknüpfung Instrument/Emittent wird durch individuelle Emittentenkennungen hergestellt, die von den einzelnen Dateneinlieferer zur Verfügung gestellt werden. Diese Kennungen sind von Einlieferer zu Einlieferer verschieden, weil es bisher noch keine gemeinsame Norm gibt, sollten jedoch widerspruchsfrei sein. Falls Dateneinlieferer für ein und dasselbe Instrument widersprüchliche (kollidierende) Emittentenkennungen angeben, d. h., falls sie hinsichtlich des Emittenten verschiedener Meinung sind, kann das Instrument keinem bestimmten Emittenten zugeordnet werden und wird in eine „Kollisionsgruppe“ eingestuft. Kollisionsgruppen lassen sich unter Umständen noch korrekt nach Ländern und Sektoren klassifizieren, es gibt jedoch keine kohärente Verknüpfung zu dem betreffenden Emittenten des Instruments. Die Einstufung von Instrumenten in Kollisionsgruppen verhindert die kohärente und zuverlässige Erfassung aller von einem bestimmten Emittenten ausgegebenen Instrumente. Die Einstufung von Instrumenten in Kollisionsgruppen erhöht das Risiko einer falschen Klassifikation nach Sitzländern bzw. Sektoren. Konzept: Anhand der Messziffer werden für jedes Sitzland die Instrumente in Kollisionsgruppen festgestellt; ihr prozentualer Anteil nach Anzahl oder nach monetären Beträgen wird zu allen Instrumenten des betreffenden Landes in Beziehung gesetzt. Geltungsbereich: Die Messziffer gilt für alle in der CSDB erfassten Instrumente.	Mit Ziel 3a wird die korrekte Feststellung der Gesamtheit der Emittenten beurteilt. Soweit hinsichtlich des Emittenten eines Instruments Uneinigkeit besteht, d. h. Instrumente in „Kollisionsgruppen“ eingestuft sind, muss sich dies in den durch den DQM-Schwellenwert festgelegten Grenzen halten.	Explizite Attribute: die zur Gruppeneinteilung verwendeten Emittentenkennungen	Umlauf in Euro bezogen auf die Instrumente in Kollisionsgruppen, ausgedrückt als prozentualer Anteil aller Instrumente

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
Ziel 3b: **Datengenauigkeit — Erleichterung der korrekten Sektorzuweisung und Datenerhebung nach Emittenten**	Konzeptioneller Hintergrund: In der CSDB werden Angaben über Emittent und Instrument in eine als „eins zu vielen“ zu bezeichnende Relation gebracht, d. h., ein Emittent kann zu vielen Instrumenten in Beziehung gesetzt werden, aber jedes einzelne Instrument nur zu einem einzigen Emittenten. Diese Verknüpfung Instrument/Emittent wird durch individuelle Emittentenkennungen hergestellt, die von den einzelnen Dateneinlieferern zur Verfügung gestellt werden. Diese Kennungen sind von Einlieferer zu Einlieferer verschieden, weil es bisher noch keine gemeinsame Norm gibt, sollten jedoch widerspruchsfrei sein. Falls kein Datenanbieter für ein bestimmtes Instrument einen Emittenten angibt, besteht die Gefahr, dass das Instrument keinem bestimmten Emittenten zugeordnet und deshalb in eine „Eigengruppe“ eingestuft wird, die nur aus diesem einen Instrument besteht. Eigengruppen lassen sich unter Umständen noch korrekt nach Ländern und Sektoren klassifizieren, es gibt jedoch keine kohärente Verknüpfung zu dem betreffenden Emittenten des Instruments. Die Einstufung von Instrumenten in Eigengruppen verhindert die kohärente und zuverlässige Erfassung aller von einem bestimmten Emittenten ausgegebenen Instrumente. Die Einstufung von Instrumenten in Eigengruppen erhöht das Risiko einer falschen Klassifikation nach Sitzländern bzw. Sektoren, da sie häufig mit unvollständigen Angaben versehen sind. Konzept: Anhand der Messziffer werden für jedes Sitzland die Instrumente in Eigengruppen festgestellt; ihr prozentualer Anteil nach Anzahl oder nach monetären Beträgen wird zu allen Instrumenten des betreffenden Landes in Beziehung gesetzt.	Mit Ziel 3b wird die korrekte Feststellung der Gesamtheit der Emittenten beurteilt. Soweit keine zuverlässigen Angaben über den Emittenten eines Instruments vorliegen, d. h. Instrumente in „Eigengruppen“ eingestuft sind, muss sich dies in den durch den DQM-Schwellenwert festgelegten Grenzen halten.	Explizite Attribute: die zur Gruppeneinteilung verwendeten Emittentenkennungen	Umlauf in Euro bezogen auf die Instrumente in Eigengruppen, ausgedrückt als prozentualer Anteil aller Instrumente

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
	Geltungsbereich: Die Messziffer gilt für alle in der CSDB erfassten Instrumente.			
Ziel 4: **Datengenauigkeit — ausstehender Betrag auf Schuldverschreibungen, einschließlich Zertifikaten**	Konzept: Anhand der Messziffer werden die Umläufe von Schuldverschreibungen, einschließlich Zertifikaten, nach Sitzland jedes einzelnen Emittenten und nach Emittentensektor gemäß den Grundsätzen der Wertpapieremissionsstatistik aggregiert. Dieses Aggregat wird mit dem entsprechenden Wert in der Wertpapieremissionsstatistik verglichen; sodann wird die prozentuale Abweichung der CSDB-Daten berechnet. Die nicht überprüften und nicht erklärbaren Differenzen dürfen den DQM-Schwellenwert nicht überschreiten.	Mit Ziel 4 werden die CSDB-Outputdaten mit externen Vergleichsdaten verglichen. Die nichtüberprüften und nichterklärbaren Differenzen zwischen den aggregierten CSDB-Daten und den entsprechenden Angaben in der EZB-Wertpapieremissionsstatistik bzw. aus sonstigen zuverlässigen Richtwerten, sofern solche Vergleichsdaten verfügbar sind, dürfen den DQM-Schwellenwert für jeden der nachfolgenden Emittentensektoren für dasselbe Referenzdatum nicht überschreiten: — S.11 „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften“ (S.11 gemäß ESVG 95) — S.121 „Zentralbank“ (S.121 gemäß ESVG 95) — S.122 „Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.123 „Geldmarktfonds“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.124 „Investmentfonds, die keine Geldmarktfonds sind“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.125 „sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Pensionskassen)“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.126 „Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten“ (S.124 gemäß ESVG 95) — S.127 „firmeneigene Finanzinstitute und Geldgeber“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.128 „Versicherungsgesellschaften“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.129 „Pensionskassen“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.13 „Staat“ (S.13 gemäß ESVG 95)	Explizite Attribute: Umlauf in Euro, Marktkapitalisierung in Euro Implizite Attribute: Emissionsdatum, Fälligkeitsdatum, Währung, Sektor des Emittenten, Sitzland	Umlauf oder Marktkapitalisierung in Euro, ausgedrückt als prozentuale Differenz zwischen der CSDB und externen Richtwerten

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
Ziel 5: **Datengenauigkeit — Marktkapitalisierung von Anteilsrechten**	Konzept: Anhand der Messziffer wird die Marktkapitalisierung von Anteilen nach Sitzland jedes einzelnen Emittenten und nach Emittentensektoren gemäß den Grundsätzen der Wertpapieremissionsstatistik aggregiert. Dieses Aggregat wird mit dem entsprechenden Wert in der Wertpapieremissionsstatistik verglichen; sodann wird die prozentuale Abweichung der CSDB-Daten berechnet. Die nicht überprüften und nichterklärbaren Differenzen dürfen den DQM-Schwellenwert nicht überschreiten.	Mit Ziel 5 werden die CSDB-Outputdaten mit externen Vergleichsdaten verglichen. Die nicht überprüften und nicht erklärbaren Differenzen zwischen den aggregierten CSDB-Angaben und den entsprechenden Angaben in der EZB-Wertpapieremissionsstatistik bzw. aus sonstigen zuverlässigen Richtwerten, sofern solche Vergleichsdaten verfügbar sind, dürfen den DQM-Schwellenwert für jeden der nachfolgenden Emittentensektoren für dasselbe Referenzdatum nicht überschreiten: — S.11 „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften“ (S.11 gemäß ESVG 95) — S.121 „Zentralbank“ (S.121 gemäß ESVG 95) — S.122 „Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.123 „Geldmarktfonds“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.124 „Investmentfonds, die keine Geldmarktfonds sind“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.125 „sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Pensionskassen)“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.126 „Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten“ (S.124 gemäß ESVG 95) — S.127 „firmeneigene Finanzinstitute und Geldgeber“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.128 „Versicherungsgesellschaften“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.129 „Pensionskassen“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.13 „Staat“ (S.13 gemäß ESVG 95)	Explizite Attribute: Umlauf in Euro, Anzahl der ausstehenden Anteile bei börsennotierten Aktien Implizite Attribute: Nominalwährung, ESVG-Sektor des Emittenten, Sitzland, Kurswert börsennotierter Aktien (nur Ausreißerkontrolle)	Umlauf oder Marktkapitalisierung in Euro, ausgedrückt als prozentuale Differenz zwischen der CSDB und externen Richtwerten

DQM-Ziel	DQM-Messziffern	Durchführung	Outputfeed-datenattribute	Basis des DQM-Schwellenwerts
Ziel 6: **Datengenauigkeit — Klassifizierung der Emittenten**	Konzept: Anhand dieser Messziffer wird für jede Kombination von Sitzland/Sektor eine Rangfolge der Emittenten nach Gesamtverbindlichkeiten aus Wertpapieren (Anteilsrechte und Schuldverschreibungen zusammen) aufgestellt. Die Messziffer macht außerdem absolute Rangfolgeänderungen unter den verschiedenen Emittenten sichtbar, um die Feststellung signifikanter Ausreißer bei den Umläufen oder der Marktkapitalisierung zu erleichtern. Das Sitzland und die Sektorklassifizierung des Emittenten werden bis zum Erreichen des DQM-Schwellenwerts überprüft. Geltungsbereich: Die Messziffer gilt für alle Investmentfondsanteile, Anteilsrechte und Schuldverschreibungen, deren Fälligkeitsdatum nicht länger als drei Monate zurückliegt.	Mit Ziel 6 wird die statistische Klassifizierung der Emittenten beurteilt. Die statistische Klassifizierung der Emittenten wird für jeden der nachfolgenden Emittentensektoren bis zum Erreichen des DQM-Schwellenwerts überprüft: — S.11 „Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften“ (S.11 gemäß ESVG 95) — S.121 „Zentralbank“ (S.121 gemäß ESVG 95) — S.122 „Kreditinstitute (ohne die Zentralbank)“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.123 „Geldmarktfonds“ (S.122 gemäß ESVG 95) — S.124 „Investmentfonds, die keine Geldmarktfonds sind“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.125 „sonstige Finanzinstitute (ohne Versicherungsgesellschaften und Pensionskassen)“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.126 „Kredit- und Versicherungshilfstätigkeiten“ (S.124 gemäß ESVG 95) — S.127 „firmeneigene Finanzinstitute und Geldgeber“ (S.123 gemäß ESVG 95) — S.128 „Versicherungsgesellschaften“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.129 „Pensionskassen“ (S.125 gemäß ESVG 95) — S.13 „Staat“ (S.13 gemäß ESVG 95)	Sektor des Emittenten, Sitzland	Umlauf oder Marktkapitalisierung in Euro, ausgedrückt als „Kapitalisierung“, d. h. Umlauf plus Marktkapitalisierung je Emittent

(1) Die Nummerierung der Kategorien entspricht der durch den Vorschlag für eine Verordnung des Europäischen Parlaments und des Rates zum Europäischen System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen auf nationaler und regionaler Ebene in der Europäischen Union, KOM(2010) 774 endgültig, eingeführten Nummerierung.

ANHANG II

VOM DQM-RAHMENWERK ERFASSTE FEEDS UND OUTPUTFEED-DATENATTRIBUTE

Das DQM-Rahmenwerk gilt für die nachstehenden Feeds, die zur Unterstützung verschiedener Verwendungen dienen:

— Feed zur Unterstützung der Außenwirtschaftsstatistiken (EXT 1.0)

— Feed finanzielle Mantelkapitalgesellschaften zur Unterstützung der Statistik über finanzielle Mantelkapitalgesellschaften (FVC 1.0)

— Feed Investmentfonds zur Unterstützung der Statistik über Investmentfonds (IF 1.0)

— Feed Wertpapierbesitz zur Unterstützung der Statistik über Wertpapierbesitz (SHS 1.0)

— Feed Staatsfinanzierung durch Wertpapiere zur Unterstützung der staatlichen Finanzstatistiken (GSF 1.0)

Outputfeed-Datenattribute, die in die unterstützten Feeds einfließen:

Output feed data attribute name [Bezeichnung des Outputfeed-Datenattributs]	Beschreibung	Einschlägiger Feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code	ISIN-Wertpapierkennung	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class [Wertpapierart gemäß Europäischem System Volkswirtschaftlicher Gesamtrechnungen (ESVG)]	Klassifizierung des Wertpapiers nach dem ESVG	√	√	√	√	√
Debt type [Art der Schuldverschreibung]	Art der Schuldverschreibung				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Attribut zur Feststellung von Wertpapieren, die entsprechend den Definitionen der Wertpapieremissionsstatistik der EZB unter „aktueller Umlauf“ geführt werden sollten					√
Instrument supplementary class [Instrument-Ergänzungsklasse]	Ergänzendes Attribut zur Ermöglichung der Feststellung, ob ein Instrument in die Wertpapieremissionsstatistik aufgenommen werden sollte; dieses Attribut kann Werte wie etwa 1 = „Kuponstrip“, 2 = „Kapitalstrip“ usw. annehmen					√
Security status [Wertpapierstatus]	Ergänzendes Attribut zur Ermöglichung der Feststellung, ob ein Instrument in die Wertpapieremissionsstatistik aufgenommen werden sollte; dieses Attribut kann die Aktualität eines Instruments anzeigen					√
Asset securitisation type [Art der Verbriefung von Vermögenswerten]	Art der Verbriefung von Vermögenswerten		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Attribut zur Angabe, ob ein Instrument zur Verpfändung als Sicherheit für Kreditgeschäfte des Eurosystems geeignet ist				√	
Nominal currency [Nominalwährung]	Nominalwährung des Instruments (ISO 4217)	√	√	√	√	√

Output feed data attribute name [Bezeichnung des Outputfeed-Datenattributs]	Beschreibung	Einschlägiger Feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date [Emissionsdatum]	Tag, an dem der Emittent die Wertpapiere dem Übernehmer gegen Entgelt liefert; ab diesem Tag stehen die Wertpapiere erstmals zur Lieferung an Anleger zur Verfügung. Anmerkung: Im Fall eines Strips ist in dieser Spalte der Zeitpunkt angegeben, zu dem der Kupon-/Kapitalstrip erfolgt.	√	√	√	√	√
Maturity date [Fälligkeitsdatum]	Termin der tatsächlichen Tilgung einer Schuldverschreibung	√	√	√	√	√
Residual maturity [Restlaufzeit]	Restlaufzeit eines Instruments zum Zeitpunkt des Dateneintrags					√
Issuer domicile country [Sitzland des Emittenten]	Land der rechtlichen Verankerung (domicile) des Wertpapieremittenten (ISO 3166)	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector [Sektor des Emittenten]	Institutioneller Sektor, dem der Emittent gemäß dem ESVG angehört	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification [Klassifizierung des Emittenten nach NACE (europäische Klassifizierung der Wirtschafszweige)]	In erster Linie ausgeübte wirtschaftliche Tätigkeit gemäß NACE	√				
Amount issued [Emissionsvolumen]	Bei der Emission eingenommener Betrag der Schuldverschreibung (Nennwert) Im Fall eines Strips ist in dieser Spalte der Betrag des Kupon-/Kapitalstrips angegeben. Bei in Tranchen unter einer einzigen ISIN aufgelegten Wertpapieren ist in dieser Spalte der bisher emittierte kumulative Betrag angegeben. Angabe des emittierten Betrags in der Nominalwährung					√
Amount outstanding [Umlauf]	Umlauf zum Nennwert; bei in Tranchen unter derselben ISIN aufgelegten Wertpapieren ist in dieser Spalte der bisher emittierte kumulative Betrag ohne Tilgungen angegeben; Angaben jeweils in der Nominalwährung Angabe des Umlaufs in der Nominalwährung Bei fehlender Information über die Nominalwährung Angabe des Umlaufs in Euro	√			√	√
Amount outstanding in euro [Umlauf in Euro]	Umlauf in Euro, umgerechnet zum beim Dateneintrag für die Nominalwährung gültigen Eurowechselkurs				√	√
Market capitalisation [Marktkapitalisierung]	Neuester verfügbarer Marktkapitalisierungsbetrag; Angabe in der Nominalwährung Bei fehlender Information über die Nominalwährung Angabe der Marktkapitalisierung in Euro				√	

Output feed data attribute name [Bezeichnung des Outputfeed-Datenattributs]	Beschreibung	Einschlägiger Feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity [Rendite]	Wertpapierspezifische Rendite in Prozent				√	√
Short name [Kurzbezeichnung]	Vom Emittent gewählte Kurzbezeichnung auf der Grundlage der Merkmale der Emission und aller verfügbaren Informationen					√
Pool factor [Poolfaktor]	Bei hypothekarisch gesicherten Wertpapieren ist der Poolfaktor bzw. der Restkapitalfaktor der ausstehende Kapitalbetrag des dem Wertpapier unterlegten Hypothekenpools dividiert durch den ursprünglichen Kapitalbetrag.	√	√	√	√	√
Quotation basis [Notierungsart]	Grundlage für die Notierung des Instruments, z. B. Prozentsatz des Nennbetrags (Prozent) oder Währung pro Aktie/Anteil (Stücke)	√	√	√	√	√
Price value [Kurswert]	Neuester verfügbarer repräsentativer Kurs des Instruments am Referenztag in der Notierungsart, gegebenenfalls in der Nominalwährung des Instruments; bei verzinslichen Wertpapieren Angabe des clean price, d. h. ohne aufgelaufene Zinsen	√	√	√	√	√
Price value type [Art des Kurswertes]	Art des Kurswertes, d. h. Marktwert, Schätzung oder Pauschalwert	√	√	√	√	√
Monthly average price [monatlicher Durchschnittskurs]	Durchschnitt der verfügbaren normalisierten Kurse des Instruments in den letzten 30 Kalendertagen bis zum Referenztag in der Notierungsart, gegebenenfalls in der Nominalwährung des Instruments	√			√	
Redemption type [Art der Tilgung]	Art der Tilgung, z. B. endfällig, laufend, strukturiert, verrentet, seriell, unregelmäßig, null, abgestuft					√
Redemption frequency [Häufigkeit der Tilgung]	Anzahl der Tilgungen einer Schuldverschreibung pro Jahr					√
Redemption price [Rückzahlungskurs]	Rückzahlungsschlusskurs					√
Accrued interest [aufgelaufene Zinsen]	Seit dem letzten Zinszahltermin oder seit Beginn der Verzinsung aufgelaufene Zinsen; bei verzinslichen Wertpapieren ergibt die Addition dieses Werts zum Kurswert den sogenannten „dirty price“	√	√	√		√
Accrued income factor [Faktor aufgelaufene Einnahmen]	Täglicher wertpapierspezifischer Faktor in Prozent, berechnet nach dem Schuldneransatz; der Faktor beruht auf antizipativen Posten, d. h. dem kombinierten Effekt aus aufgelaufenen Zinsen und Einnahmen, die sich aufgrund der Differenz zwischen Ausgabekurs und Rückzahlungskurs ergeben	√	√	√	√	

Output feed data attribute name [Bezeichnung des Outputfeed-Datenattributs]	Beschreibung	Einschlägiger Feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type [Art der Verzinsung]	Art der Verzinsung, z. B. fest, variabel, abgestuft usw.				√	√
Last coupon rate [letzter Zinssatz]	Letzter tatsächlich gezahlter Zinssatz in Prozent per annum (auf Jahresrate hochgerechnet)	√	√	√	√	
Last coupon date [letzter Zinszahltermin]	Termin des letzten tatsächlich gezahlten Zinssatzes; Attribut zur Ermöglichung der Feststellung, ob der letzte tatsächlich gezahlte Zinssatz in den Berichtszeitraum fällt	√	√	√	√	
Last coupon frequency [Häufigkeit der letzten Verzinsung]	Häufigkeit der Zahlung zum letzten Zinssatz pro Jahr; „jährlich" wird als AN (annual), „halbjährlich als SA (semi-annual) usw. angegeben	√	√	√	√	
Dividend amount [Dividendenbetrag]	Betrag der letzten Dividendenzahlung pro Aktie (Angabe nach Art des Dividendenbetrags) vor Steuern (Bruttodividende)	√		√	√	
Dividend amount type [Art des Dividendenbetrags]	Der Dividendenbetrag pro Aktie kann angegeben werden in der Dividendenwährung oder als Aktienanzahl	√		√	√	
Dividend currency [Dividendenwährung]	Kennung der Währung der letzten Dividendenzahlung nach ISO 4217	√		√	√	
Dividend Settlement date [Dividendenabrechnungstermin]	Abrechnungstermin der letzten Dividendenzahlung; Attribut zur Ermöglichung der Feststellung, ob die Dividendenzahlung in den Berichtszeitraum fällt	√		√	√	
Last split factor [letzter Splitfaktor]	Aktiensplit und Aktienzusammenlegung	√		√	√	
Last split date [letzter Splittermin]	Termin des Wirksamwerdens des Aktiensplits	√		√	√	