ΚΑΤΕΥΘΥΝΤΗΡΙΕΣ ΓΡΑΜΜΕΣ

ΚΑΤΕΥΘΥΝΤΗΡΙΑ ΓΡΑΜΜΗ ΤΗΣ ΕΥΡΩΠΑΪΚΗΣ ΚΕΝΤΡΙΚΗΣ ΤΡΑΠΕΖΑΣ

της 26ης Σεπτεμβρίου 2012

σχετικά με το πλαίσιο διαχείρισης της ποιότητας δεδομένων της κεντρικής βάσης δεδομένων για τους τίτλους

(ΕΚΤ/2012/21)

(2012/689/ΕΕ)

ΤΟ ΔΙΟΙΚΗΤΙΚΟ ΣΥΜΒΟΥΛΙΟ ΤΗΣ ΕΥΡΩΠΑΪΚΗΣ ΚΕΝΤΡΙΚΗΣ ΤΡΑΠΕΖΑΣ,

Έχοντας υπόψη το καταστατικό του ευρωπαϊκού συστήματος κεντρικών τραπεζών και της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας, και ιδίως τα άρθρα 5.1, 12.1 και 14.3,

Έχοντας υπόψη τον κανονισμό (ΕΚ) αριθ. 2533/98 του Συμβουλίου, της 23ης Νοεμβρίου 1998, σχετικά με τη συλλογή στατιστικών πληροφοριών από την Ευρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα [1],

Εκτιμώντας τα ακόλουθα:

(1) Η κεντρική βάση δεδομένων για τους τίτλους (Centralised Securities Database, εφεξής «CSDB») είναι μια ενιαία υποδομή που χρησιμοποιεί την τεχνολογία των πληροφοριών, τη λειτουργία της οποίας αναλαμβάνουν από κοινού τα μέλη του ευρωπαϊκού συστήματος κεντρικών τραπεζών (ΕΣΚΤ), συμπεριλαμβανομένων των εθνικών κεντρικών τραπεζών (ΕθνΚΤ) των κρατών μελών που δεν ανήκουν στη ζώνη του ευρώ, όταν αυτές συμμετέχουν οικειοθελώς στη λειτουργία της CSDB. Η CSDB αποθηκεύει δεδομένα ανά στοιχείο, ιδίως για τίτλους, για τους εκδότες και τις τιμές τους.

(2) Τα δεδομένα που συλλέγονται προέρχονται από διάφορες πηγές, συμπεριλαμβανομένων των μελών του ΕΣΚΤ, ορισμένων παρόχων δεδομένων εμπορικού χαρακτήρα, του δημοσίου τομέα και διοικητικών φορέων, και διαβιβάζονται στη CSDB. Ωστόσο, τα εν λόγω εισαγόμενα δεδομένα ενδέχεται να είναι ανακριβή ή ελλιπή. Το σύστημα της CSDB μπορεί να αποκαθιστά τη συμφωνία μεταξύ τέτοιων δεδομένων που προέρχονται από διάφορες πηγές και εμφανίζουν εν μέρει έλλειψη συνοχής και να εντοπίζει ελλιπή ή μη διαθέσιμα δεδομένα. Συνθέτει αυτομάτως εισαγόμενα δεδομένα που προέρχονται από διάφορες αλληλοεπικαλυπτόμενες πηγές σε ένα κατά το δυνατό πλήρες και ενιαίο μητρώο υψηλής ποιότητας.

(3) Η αξιολόγηση της συνολικής ποιότητας των δεδομένων της CSDB είναι δυνατή μόνο σε επίπεδο εξαγόμενων, και όχι σε επίπεδο μεμονωμένων συνόλων εισαγόμενων δεδομένων. Προκειμένου να διασφαλίζεται η κατά το δυνατόν πληρότητα, ακρίβεια και συνοχή των εξαγόμενων δεδομένων, είναι αναγκαίος ο καθορισμός πλαισίου διαχείρισης της ποιότητας δεδομένων (ΔΠΔ), που θα εφαρμόζεται στα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση, τα οποία αποτελούν υποσύνολο των εξαγόμενων δεδομένων και μπορούν να χρησιμοποιούνται προς υποστήριξη της παραγωγής στατιστικών ή να εξυπηρετούν και άλλες χρήσεις. Τα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση παρέχονται στις ΕθνΚΤ το αργότερο επτά εργάσιμες ημέρες μετά το τέλος κάθε ημερολογιακού μήνα.

(4) Κάποια εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση περιλαμβάνουν επίσης ιδιοχαρακτηριστικά, όπως τιμές ή πληροφορίες εισοδηματικής φύσης, ως προς τα οποία αναμένονται μεταβολές με την πάροδο του χρόνου. Τα εν λόγω ιδιοχαρακτηριστικά επαληθεύονται αυτομάτως από το σύστημα της CSDB με την εφαρμογή στατιστικών αλγορίθμων. Μόνο τα ιδιοχαρακτηριστικά που καθορίζονται στο παράρτημα I για κάθε στόχο της ΔΠΔ υπόκεινται σε επαλήθευση από τις αρμόδιες αρχές σύμφωνα με την παρούσα κατευθυντήρια γραμμή. Ο πλήρης κατάλογος των ιδιοχαρακτηριστικών που συνιστούν τα υποστηριζόμενα σύνολα εξαγόμενων δεδομένων παρατίθεται στο παράρτημα II.

(5) Το πλαίσιο ΔΠΔ της CSDB θα πρέπει να εφαρμόζεται στα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση ανεξάρτητα από την πηγή των εισαγόμενων δεδομένων. Θα πρέπει να ρυθμίζει τις αρμοδιότητες των ΕθνΚΤ της ζώνης του ευρώ σχετικά με την ποιότητα των εξαγόμενων δεδομένων στη CSDB και, κατά περίπτωση, εκείνων της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας (ΕΚΤ).

(6) Το πλαίσιο ΔΠΔ της CSDB θα πρέπει να βασίζεται, πρώτον, στους στόχους της ΔΠΔ που αποτελούν δείκτες αξιολόγησης της ποιότητας των εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση και, δεύτερον, στα μεγέθη της ΔΠΔ που εντοπίζουν και ιεραρχούν τα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση, τα οποία πρέπει να επαληθεύονται για κάθε συναφή στόχο της ΔΠΔ. Θα πρέπει επίσης να βασίζεται στα ελάχιστα επίπεδα εργασιών της ΔΠΔ που καθορίζουν το ελάχιστο επίπεδο επαλήθευσης που απαιτείται για κάθε στόχο της ΔΠΔ.

(7) Λόγω της απουσίας δεδομένων αναφοράς, οι στόχοι της ΔΠΔ δεν εντοπίζουν πάντοτε σφάλματα στα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση αλλά μπορούν να εντοπίζουν μόνο περιπτώσεις στις οποίες είναι αναγκαία η μη αυτοματοποιημένη επαλήθευση των εν λόγω δεδομένων.

(8) Καθώς τη λειτουργία της CSDB αναλαμβάνουν από κοινού όλα τα μέλη του ΕΣΚΤ, θα πρέπει όλα τους να επιδιώκουν να ακολουθούν τα ίδια πρότυπα ΔΠΔ. Επιπλέον, οι ΕθνΚΤ εκτός ζώνης του ευρώ είναι οι πλέον κατάλληλες να διενεργούν τη ΔΠΔ όσον αφορά δεδομένα που αφορούν εκδότες με κατοικία στα οικεία κράτη μέλη. Ενώ αναγνωρίζεται ότι οι κατευθυντήριες γραμμές που εκδίδει η ΕΚΤ δεν μπορούν

[1] ΕΕ L 318 της 27.11.1998, σ. 8.

να επιβάλλουν υποχρεώσεις σε ΕθνΚΤ εκτός ζώνης του ευρώ, το άρθρο 5 του καταστατικού του ευρωπαϊκού συστήματος κεντρικών τραπεζών και της Ευρωπαϊκής Κεντρικής Τράπεζας εφαρμόζεται σε ΕθνΚΤ τόσο εντός όσο και εκτός ζώνης του ευρώ. Οι ΕθνΚΤ εκτός ζώνης του ευρώ θα πρέπει, επομένως, να σχεδιάζουν και να εφαρμόζουν όλα τα μέτρα που θεωρούν κατάλληλα, προκειμένου να διενεργούν τη ΔΠΔ σύμφωνα με την παρούσα κατευθυντήρια γραμμή.

(9) Προς βελτίωση της ποιότητας των εξαγόμενων δεδομένων η διαχείριση των πηγών δεδομένων (ΔΠΗΔ) θα πρέπει να προσανατολίζεται στον εντοπισμό και τη διόρθωση, σε επίπεδο παρόχου των εισαγόμενων δεδομένων, επαναλαμβανόμενων και δομικών σφαλμάτων στα εν λόγω δεδομένα,

ΕΞΕΔΩΣΕ ΤΗΝ ΠΑΡΟΥΣΑ ΚΑΤΕΥΘΥΝΤΗΡΙΑ ΓΡΑΜΜΗ:

Άρθρο 1

Ορισμοί

Για τους σκοπούς της παρούσας κατευθυντήριας γραμμής νοούνται ως:

1) «CSDB»: η κεντρική βάση δεδομένων για τους τίτλους (Centralised Securities Database), η οποία ιδρύθηκε από το ΕΣΚΤ και βρίσκεται στις εγκαταστάσεις της ΕΚΤ·

2) «εισαγόμενο δεδομένο» (input data): οποιοδήποτε δεδομένο παρέχεται στη CSDB από μία ή περισσότερες πηγές δεδομένων·

3) «εξαγόμενο δεδομένο» (output data): δεδομένο που προκύπτει αυτομάτως στη CSDB από τη σύνθεση εισαγόμενων δεδομένων σε ένα πλήρες, υψηλής ποιότητας ενιαίο μητρώο·

4) «εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση» (output feed data): υποσύνολο των εξαγόμενων δεδομένων και χαρακτηριστικών που περιλαμβάνονται στον κατάλογο του παραρτήματος ΙΙ και χρησιμεύουν ως βάση για την υποστήριξη της παραγωγής στατιστικών ή για την εξυπηρέτηση άλλων χρήσεων·

5) «διαχείριση ποιότητας δεδομένων» ή «ΔΠΔ»: διασφάλιση, επαλήθευση και διατήρηση της ποιότητας των εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση, μέσω της χρήσης και της εφαρμογής των στόχων της ΔΠΔ, των μεγεθών της ΔΠΔ, των ελάχιστων επιπέδων εργασιών της ΔΠΔ και της ροής εργασιών ΔΠΔ·

6) «διαχείριση πηγών δεδομένων» ή «ΔΠΗΔ»: εντοπισμός και διόρθωση, σε επίπεδο παρόχου των δεδομένων, επαναλαμβανόμενων ή/και δομικών σφαλμάτων στα εισαγόμενα δεδομένα·

7) «αρχική ΔΠΔ»: ΔΠΔ όσον αφορά εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση, συμπεριλαμβανομένων των δεδομένων που καλύπτουν την εκάστοτε πιο πρόσφατη χρονική περίοδο, που διενεργείται από τις αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ σε μηνιαία βάση, αφού ληφθούν υπόψη τα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση που παρέχει η προεπισκόπηση τέλους μήνα·

8) «τακτική ΔΠΔ»: ΔΠΔ όσον αφορά εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση, που διενεργείται από τις αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ σε μηνιαία βάση, αφού ληφθούν υπόψη στοιχεία αναφοράς παρεχόμενα από διάφορες πηγές δεδομένων εκτός CSDB, προκειμένου να διασφαλίζεται ότι η ποιότητα των εξαγόμενων δεδομένων της CSDB πληροί τις απαιτήσεις της CSDB ως προς τα δεδομένα αυτά·

9) «στόχος της ΔΠΔ»: επίπεδο αναφοράς για την αξιολόγηση της ποιότητας των εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση, κατά τα ειδικότερα οριζόμενα στο παράρτημα Ι·

10) «μέγεθος της ΔΠΔ»: στατιστικός δείκτης που μετρά τον βαθμό επίτευξης ορισμένου στόχου της ΔΠΔ, κατά τα ειδικότερα οριζόμενα στο παράρτημα Ι·

11) «ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ»: το ελάχιστο επίπεδο της εργασίας επαλήθευσης που πρέπει να διεξάγεται ώστε να πληρούνται οι απαιτήσεις του πλαισίου ΔΠΔ σε σχέση με ορισμένο στόχο της ΔΠΔ·

12) «ροή εργασιών ΔΠΔ»: τεχνική διαδικασία που εφαρμόζεται για τη διόρθωση των εισαγόμενων δεδομένων, προκειμένου να τηρείται ένα ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ·

13) «προεπισκόπηση τέλους μήνα»: τακτική μηνιαία ενημέρωση των εξαγόμενων δεδομένων και των μεγεθών ΔΠΔ που παράγει έναν κατά προσέγγιση υπολογισμό των εξαγόμενων δεδομένων για την προσεχή κατάσταση τέλους μήνα·

14) «εργάσιμη ημέρα»: μια πλήρης ημέρα κατά την οποία το TARGET2 είναι ανοιχτό, σύμφωνα με τα σχετικά δημοσιευόμενα στοιχεία στον επίσημο δικτυακό τόπο της ΕΚΤ·

15) «επαλήθευση»: η διαδικασία κατά την οποία οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ ελέγχουν τα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση και, αν κριθεί αναγκαίο, διορθώνουν τα εισαγόμενα στη CSDB δεδομένα, εφαρμόζοντας εν προκειμένω τη ροή εργασιών ΔΠΔ·

16) «κάτοικος»: κάτοικος κατά την έννοια του άρθρου 1 του κανονισμού (ΕΚ) αριθ. 2533/98.

Άρθρο 2

Αντικείμενο και πεδίο εφαρμογής

1. Η παρούσα κατευθυντήρια γραμμή θεσπίζει πλαίσιο ΔΠΔ εντός της CSDB, σκοπός του οποίου είναι η διασφάλιση της πληρότητας, της ακρίβειας και της συνοχής των εξαγόμενων δεδομένων της CSDB με συνεπή εφαρμογή κανόνων που αφορούν τα πρότυπα ποιότητας των εν λόγω δεδομένων.

2. Το πλαίσιο ΔΠΔ της CSDB βασίζεται στη ΔΠΔ και στη ΔΠΗΔ.

Άρθρο 3

Αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ

1. Η ΕθνΚΤ του κράτους μέλους της ζώνης του ευρώ, του οποίου κάτοικος είναι ο εκδότης τίτλου, είναι αρμόδια για τη ΔΠΔ προκειμένου για τα δεδομένα που αφορούν τον εν λόγω εκδότη.

2. Η ΕΚΤ είναι αρμόδια για τη ΔΠΔ προκειμένου για τα δεδομένα που αφορούν εκδότες κατοίκους εκτός ζώνης του ευρώ, εκτός αν ορισμένη ΕθνΚΤ εκτός ζώνης του ευρώ έχει αποδεχθεί την αρμοδιότητα να διενεργεί ΔΠΔ προκειμένου για τα δεδομένα που αφορούν εκδότες κατοίκους του οικείου κράτους μέλους.

Άρθρο 4

ΔΠΔ, μεγέθη της ΔΠΔ και ελάχιστα επίπεδα εργασιών της ΔΠΔ

1. Οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ διενεργούν την αρχική ΔΠΔ και την τακτική ΔΠΔ. Κατά τη διενέργειά τους επαληθεύουν εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση, ανεξάρτητα από την πηγή τους.

2. Οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ εφαρμόζουν τα μεγέθη της ΔΠΔ σύμφωνα με το παράρτημα I.

3. Για τα ιδιοχαρακτηριστικά που καλύπτονται από το παράρτημα I, οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ εφαρμόζουν τα ελάχιστα επίπεδα εργασιών της ΔΠΔ σε βαθμό που διασφαλίζει την ποιότητα των εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση σύμφωνα με τις απαιτήσεις που συνεπάγεται η υποστήριξη των κατά περίπτωση χρήσεων για τα εν λόγω ιδιοχαρακτηριστικά, κατά τα προβλεπόμενα στο παράρτημα II.

Άρθρο 5

Αρχική ΔΠΔ

1. Η αρχική ΔΠΔ εφαρμόζεται για τους στόχους αριθ. 1, 2, 3α, 3β και 6 της ΔΠΔ, κατά τα ειδικότερα οριζόμενα στο παράρτημα I.

2. Η ΕΚΤ καθιστά διαθέσιμη την προεπισκόπηση τέλους μήνα επτά εργάσιμες ημέρες πριν από το τέλος κάθε ημερολογιακού μήνα.

3. Κατά τη διενέργεια της αρχικής ΔΠΔ οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ επαληθεύουν ουσιώδεις στατιστικές οριακές τιμές, ώστε να διασφαλίζεται ότι, μετά την ολοκλήρωση της αρχικής ΔΠΔ, τα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση αντικατοπτρίζουν κατά το δυνατόν τις πιο πρόσφατες εξελίξεις.

4. Οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ επαληθεύουν τα δεδομένα της προεπισκόπησης τέλους μήνα έως τη δεύτερη εργάσιμη ημέρα του επόμενου ημερολογιακού μήνα, στο μέτρο που δεν πληρούνται, σύμφωνα με τα μεγέθη της ΔΠΔ, τα ελάχιστα επίπεδα εργασιών της ΔΠΔ.

5. Στις περιπτώσεις που δεν υπάρχουν διαθέσιμα στοιχεία αναφοράς εκτός της CSDB, η αρχική ΔΠΔ βασίζεται αποκλειστικά σε πληροφορίες που είναι ήδη διαθέσιμες στην αρμόδια αρχή για τη ΔΠΔ ή μπορούν να αποκτηθούν εύκολα χωρίς τη δημιουργία νέου πλαισίου αναφοράς δεδομένων.

6. Οι αρμόδιες αρχές της ΔΠΔ διορθώνουν τα εισαγόμενα δεδομένα σύμφωνα με τη ροή εργασιών ΔΠΔ, κάνοντας χρήση του συστήματος της CSDB ή παρέχοντας αρχεία εισαγόμενων δεδομένων στην ΕΚΤ, κατά περίπτωση.

Άρθρο 6

Τακτική ΔΠΔ

1. Η τακτική ΔΠΔ εφαρμόζεται στους στόχους αριθ. 3α, 3β, 4, 5 και 6 της ΔΠΔ, κατά τα ειδικότερα οριζόμενα στο παράρτημα I.

2. Οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ διενεργούν την τακτική ΔΠΔ εντός ενός μήνα μετά το τέλος κάθε ημερολογιακού μήνα. Επαληθεύουν τα εξαγόμενα δεδομένα προς περαιτέρω χρήση, λαμβάνοντας υπόψη όλες τις εκάστοτε διαθέσιμες πληροφορίες, έως τη δεύτερη εργάσιμη ημέρα του ημερολογιακού μήνα μετά τον μήνα της διενέργειας της τακτικής ΔΠΔ.

3. Οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ διορθώνουν τα εισαγόμενα δεδομένα σύμφωνα με τη συμφωνηθείσα ροή εργασιών της ΔΠΔ, κάνοντας χρήση του συστήματος της CSDB ή παρέχοντας αρχεία εισαγόμενων δεδομένων στην ΕΚΤ, κατά περίπτωση.

Άρθρο 7

Καθήκοντα σχετικά με τη ΔΠΗΔ

1. Οι αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ εντοπίζουν τα όποια ζητήματα ΔΠΗΔ και τα αναφέρουν στην ΕΚΤ.

2. Η ΕΚΤ αντιμετωπίζει τα επαναλαμβανόμενα σφάλματα υψίστης προτεραιότητας που αφορούν τη ΔΠΗΔ σε συνεργασία με τις οικείες αρμόδιες αρχές για τη ΔΠΔ εντός ενός μήνα από την ημερομηνία κατά την οποία ένα ζήτημα ΔΠΗΔ αναφέρεται στην ΕΚΤ.

Άρθρο 8

Διορθώσεις εισαγόμενων δεδομένων

Εφόσον διαθέτει βελτιωμένα εισαγόμενα δεδομένα, ορισμένη αρμόδια αρχή για τη ΔΠΔ χρησιμοποιεί το σύστημα της CSDB, προκειμένου να διορθώσει οποιοδήποτε σφάλμα ή παράλειψη στα εισαγόμενα δεδομένα που δεν διορθώθηκε κατά την εκτέλεση της επαλήθευσης κατά τα ειδικότερα οριζόμενα στο άρθρο 5 παράγραφος 4.

Άρθρο 9

Ετήσια έκθεση ποιότητας

Λαμβάνοντας υπόψη τις απόψεις της επιτροπής στατιστικής του ΕΣΚΤ, η εκτελεστική επιτροπή της ΕΚΤ υποβάλλει ετησίως έκθεση στο διοικητικό συμβούλιο σχετικά με την ποιότητα των εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση.

Άρθρο 10

Απλοποιημένη διαδικασία τροποποίησης

Λαμβάνοντας υπόψη τις απόψεις της επιτροπής στατιστικής του ΕΣΚΤ, η εκτελεστική επιτροπή της ΕΚΤ εξουσιοδοτείται να προβαίνει σε τροποποιήσεις τεχνικού χαρακτήρα στα παραρτήματα της παρούσας κατευθυντήριας γραμμής, υπό την προϋπόθεση ότι οι εν λόγω τροποποιήσεις δεν θα επιφέρουν μεταβολές στο βασικό εννοιολογικό πλαίσιο της κατευθυντήριας γραμμής, συμπεριλαμβανομένης της κατανομής των αρμοδιοτήτων μεταξύ της ΕΚΤ και των ΕθνΚΤ, ούτε θα επηρεάσουν ουσιωδώς τον φόρτο εργασίας των αρμόδιων αρχών για τη ΔΠΔ όσον αφορά την παροχή στοιχείων. Η εκτελεστική επιτροπή ενημερώνει το διοικητικό συμβούλιο για κάθε τέτοια τροποποίηση χωρίς αδικαιολόγητη καθυστέρηση.

Άρθρο 11

Έναρξη ισχύος

1. Η παρούσα κατευθυντήρια γραμμή αρχίζει να ισχύει την 1η Νοεμβρίου 2012.

2. Η παρούσα κατευθυντήρια γραμμή αρχίζει να εφαρμόζεται από την 1η Ιουλίου 2013.

Άρθρο 12

Αποδέκτες

Η παρούσα κατευθυντήρια γραμμή απευθύνεται σε όλες τις κεντρικές τράπεζες του Ευρωσυστήματος.

Φρανκφούρτη, 26 Σεπτεμβρίου 2012.

Για το διοικητικό συμβούλιο της ΕΚΤ
Ο Πρόεδρος της ΕΚΤ
Mario DRAGHI

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ I

ΣΤΟΧΟΙ ΤΗΣ ΔΠΔ, ΕΦΑΡΜΟΓΗ, ΙΔΙΟΧΑΡΑΚΤΗΡΙΣΤΙΚΑ ΚΑΙ ΒΑΣΗ ΕΛΑΧΙΣΤΟΥ ΕΠΙΠΕΔΟΥ ΕΡΓΑΣΙΩΝ ΤΗΣ ΔΠΔ

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
Στόχος 1: **Σταθερότητα δεδομένων — στοιχεία υπολοίπων**	Έννοια: Το μέγεθος ορίζεται για κάθε συνδυασμό χώρας κατοικίας / τομέα ως σταθμισμένος κατά τον όγκο «δείκτης μεταβολής», σταθμισμένος με χρηματικές αξίες. Η τιμή δείκτη 1 δηλώνει ότι το οικείο ιδιοχαρακτηριστικό δεν έχει μεταβληθεί για κανέναν υποκείμενο τίτλο, ενώ η τιμή δείκτη 0 δηλώνει ότι το οικείο ιδιοχαρακτηριστικό έχει μεταβληθεί για όλους τους τίτλους. Αν ο δείκτης πέσει κάτω από το 1, οι μεμονωμένοι τίτλοι προσδιορίζονται με το μεταβληθέν ιδιοχαρακτηριστικό που προκάλεσε την πτώση του, με σκοπό την επαλήθευση της μεταβολής έως ότου επιτευχθεί η τήρηση του ελάχιστου επιπέδου εργασιών. Γεγονότα που προκαλούν μεταβολή του δείκτη: Για τα ιδιοχαρακτηριστικά με περιορισμένο πεδίο τιμών, οποιαδήποτε διαφορά σε μηνιαία βάση στο ιδιοχαρακτηριστικό θεωρείται ότι προκαλεί μεταβολή του δείκτη. Για τα διαρκή ιδιοχαρακτηριστικά, οποιαδήποτε διαφορά σε μηνιαία βάση μεγαλύτερη του 25 % θεωρείται ότι προκαλεί μεταβολή του δείκτη. Κάλυψη: Το μέγεθος αυτό της ΔΠΔ καλύπτει όλες τις μετοχές/μερίδια αμοιβαίων κεφαλαίων, τους μετοχικούς τίτλους και τα χρεόγραφα, συμπεριλαμβανομένων των πιστοποιητικών των οποίων η ημερομηνία λήξης δεν είναι μεγαλύτερη των τριών μηνών.	Ο στόχος 1 αξιολογεί τη σταθερότητα των στοιχείων υπολοίπων. Μη επαληθευθείσες μεταβολές σε ιδιοχαρακτηριστικά της CSDB δεν μειώνουν το ποσοστό των σταθερών δεδομένων κάτω από το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ για καθέναν από τους ακόλουθους τομείς εκδοτών του ευρωπαϊκού συστήματος λογαριασμών (ΕΣΛ) ([1]): — S.11 «μη χρηματοοικονομικές εταιρείες» (S.11 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.121 «η κεντρική τράπεζα» (S.121 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.122 «εταιρείες που δέχονται καταθέσεις, εκτός από την κεντρική τράπεζα» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.123 «αμοιβαία κεφάλαια της χρηματαγοράς (ΑΚΧΑ)» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.124 «αμοιβαία κεφάλαια μη ΑΚΧΑ» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.125 «λοιποί ενδιάμεσοι χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί, εκτός από ασφαλιστικές εταιρείες και συνταξιοδοτικά ταμεία» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.126 «επικουρικοί χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί και φορείς» (S.124 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.127 «θυγατρικοί χρηματοοικονομικοί οργανισμοί και δανειστές χρήματος» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.128 «ασφαλιστικές εταιρείες (ΑΕ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.129 «συνταξιοδοτικά ταμεία (ΣΤ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.13 «γενική κυβέρνηση» (S.13 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95).	Ρητά ιδιοχαρακτηριστικά: Ημερομηνία έκδοσης για το χρέος, ημερομηνία λήξης για το χρέος, ονομαστικό νόμισμα, βάση τιμής, κατηγορία ΕΣΛ του μέσου, χώρα κατοικίας του εκδότη, τομέας εκδότη ΕΣΛ, ταξινόμηση εκδότη κατά την ευρωπαϊκή ταξινόμηση οικονομικών δραστηριοτήτων (NACE), ανεξόφλητο ποσό, αριθμός μετοχών σε κυκλοφορία για εισηγμένες μετοχές.	Ανεξόφλητα ποσά ή κεφαλαιοποίηση της αγοράς σε ευρώ, που εκφράζονται ως τμήμα των στοιχείων υπολοίπων.

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
Στόχος 2: **Ακρίβεια δεδομένων — νέες εκδόσεις και εξοφλήσεις· καθαρές εκδόσεις**	Έννοια: Το μέγεθος ορίζεται για κάθε συνδυασμό χώρας κατοικίας / τομέα και καλύπτει νέες εκδόσεις, εξοφλήσεις και ανεξόφλητα ποσά χρεογράφων που διατυπώνονται ως ποσοστά. Το μέγεθος συνδέει τη δραστηριότητα καθαρής έκδοσης κατά τη διάρκεια του μήνα με το ανεξόφλητο ποσό στο τέλος του προηγούμενου μήνα (μεταβολή ποσοστού) και παρακολουθεί τη σχετική εξέλιξη του ανεξόφλητου χρέους. Είναι πιθανή η πρόσβαση σε αναλυτικά στοιχεία και σε επίπεδο επιμέρους νέων εκδόσεων και εξοφλήσεων που έχουν προκαλέσει τη μεταβολή στα ανεξόφλητα ποσά. Οι εν λόγω εξελίξεις επαληθεύονται μέχρι να επιτευχθεί τήρηση του ελάχιστου επιπέδου εργασιών.	Ο στόχος 2 αξιολογεί τις νέες εκδόσεις και εξοφλήσεις σε σχέση με τα αντίστοιχα στοιχεία υπολοίπων. Τα μη επαληθευμένα στοιχεία ανεξόφλητων υπολοίπων νέων εκδόσεων και εξοφλήσεων χρεογράφων που διατυπώνονται ως ποσοστά δεν υπερβαίνουν σε καθαρή βάση το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ για καθέναν από τους ακόλουθους τομείς εκδοτών του ΕΣΛ: — S.11 «μη χρηματοοικονομικές εταιρείες» (S.11 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.121 «η κεντρική τράπεζα» (S.121 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.122 «εταιρείες που δέχονται καταθέσεις, εκτός από την κεντρική τράπεζα» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.123 «αμοιβαία κεφάλαια της χρηματαγοράς (ΑΚΧΑ)» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.124 «αμοιβαία κεφάλαια μη ΑΚΧΑ» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.125 «λοιποί ενδιάμεσοι χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί, εκτός από ασφαλιστικές εταιρείες και συνταξιοδοτικά ταμεία» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.126 «επικουρικοί χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί και φορείς» (S.124 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.127 «θυγατρικοί χρηματοοικονομικοί οργανισμοί και δανειστές χρήματος» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.128 «ασφαλιστικές εταιρείες (ΑΕ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.129 «συνταξιοδοτικά ταμεία (ΣΤ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.13 «γενική κυβέρνηση» (S.13 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95).	Ρητά ιδιοχαρακτηριστικά: ανεξόφλητο ποσό. Έμμεσα ιδιοχαρακτηριστικά: Ημερομηνία έκδοσης, ημερομηνία λήξης, ονομαστικό νόμισμα, τιμή βάσης, κατηγορία ΕΣΛ του μέσου, χώρα κατοικίας του εκδότη, τομέας ΕΣΛ του εκδότη.	Ανεξόφλητα ποσά σε ευρώ, που εκφράζονται ως σχετική εξέλιξη σε σύγκριση με τα αντίστοιχα στοιχεία υπολοίπων.

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
Στόχος 3α: **Ακρίβεια δεδομένων — υποστήριξη ορθής τομεακής κατανομής και εξαγωγής δεδομένων ανά εκδότη**	Εννοιολογικό υπόβαθρο: Η CSDB συνδέει πληροφορίες για τον εκδότη και το μέσο με βάση συσχετισμό που θα μπορούσε να περιγραφεί ως «ένας προς πολλά», δηλαδή ένας εκδότης μπορεί να συνδέεται με πολλά μέσα, ενώ κάθε μέσο συνδέεται μόνο με έναν εκδότη. Η εν λόγω σύνδεση μέσου-εκδότη γίνεται μέσω ατομικών κωδικών αναγνώρισης εκδότη που παρέχονται από τους διαφορετικούς παρόχους ειαγόμενων δεδομένων. Αν και οι εν λόγω κωδικοί αναγνώρισης διαφέρουν μεταξύ των παρόχων δεδομένων, καθώς επί του παρόντος δεν υπάρχει κάποιο κοινό πρότυπο, θα πρέπει να παρουσιάζουν συνοχή. Αν οι πάροχοι εισαγόμενων δεδομένων παρέχουν ανακόλουθους (ασύμφωνους) κωδικούς αναγνώρισης εκδότη για το ίδιο μέσο, δηλαδή αν διαφωνούν για τον εκδότη, το μέσο δεν μπορεί να αποδοθεί σε συγκεκριμένο εκδότη και καταλήγει σε «ομάδα ασυμφωνίας». Οι ομάδες ασυμφωνίας εξακολουθούν να μπορούν να ταξινομηθούν ορθά ανά χώρα και τομέα, αλλά δεν υπάρχει σταθερός σύνδεσμος προς τον σχετικό εκδότη του μέσου. Η θέση μέσων στις ομάδες ασυμφωνίας παρεμποδίζει τη σταθερή και αξιόπιστη εξαγωγή όλων των μέσων που εκδίδονται από ορισμένο εκδότη. Η θέση μέσων στις ομάδες ασυμφωνίας αυξάνει τον κίνδυνο της λανθασμένης ταξινόμησης ανά χώρα κατοικίας ή τομέα. Έννοια: Για κάθε χώρα κατοικίας, το μέγεθος προσδιορίζει τα μέσα σε ομάδες ασυμφωνίας και τα συνδέει ως ποσοστό επί του αριθμού ή των χρηματικών αξιών με όλα τα μέσα για την εν λόγω χώρα. Κάλυψη: Το μέγεθος καλύπτει όλα τα μέσα στη CSDB.	Ο στόχος 3α αξιολογεί την ορθή αναγνώριση του πληθυσμού εκδοτών. Στις περιπτώσεις που παρατηρείται ασυμφωνία σχετικά με τον εκδότη ενός μέσου, δηλαδή στις περιπτώσεις μέσων που καταλήγουν στις «ομάδες ασυμφωνίας», τα εν λόγω μέσα δεν υπερβαίνουν το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ.	Ρητά ιδιοχαρακτηριστικά: Κωδικός αναγνώρισης εκδότη που χρησιμοποιείται για την ομαδοποίηση.	Ανεξόφλητα ποσά σε ευρώ που αφορούν τα μέσα στις ομάδες ασυμφωνίας, που εκφράζονται ως ποσοστό επί όλων των μέσων.

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
Στόχος 3β: **Ακρίβεια δεδομένων — υποστήριξη ορθής τομεακής κατανομής και εξαγωγής δεδομένων ανά εκδότη**	Εννοιολογικό υπόβαθρο: Η CSDB συνδέει πληροφορίες για τον εκδότη και το μέσο με βάση συσχετισμό που θα μπορούσε να περιγραφεί ως «ένας προς πολλά», δηλαδή ένας εκδότης μπορεί να συνδέεται με πολλά μέσα, ενώ κάθε μέσο συνδέεται μόνο με έναν εκδότη. Η εν λόγω σύνδεση μέσου-εκδότη γίνεται μέσω ατομικών κωδικών αναγνώρισης εκδότη που παρέχονται από τους διαφορετικούς παρόχους εισαγόμενων δεδομένων. Αν και οι εν λόγω κωδικοί αναγνώρισης διαφέρουν μεταξύ των παρόχων δεδομένων, καθώς επί του παρόντος δεν υπάρχει κάποιο κοινό πρότυπο, θα πρέπει να παρουσιάζουν συνοχή. Αν κανένας πάροχος δεδομένων δεν παρέχει κωδικό αναγνώρισης εκδότη για συγκεκριμένο μέσο, συντρέχει κίνδυνος αυτό να μην αποδοθεί σε συγκεκριμένο εκδότη και να καταλήξει σε «ομάδα αυθύπαρκτων» αποτελούμενη αποκλειστικά από το εν λόγω μέσο. Οι ομάδες αυθύπαρκτων εξακολουθούν να μπορούν να ταξινομηθούν ορθά ανά χώρα και τομέα, αλλά δεν υπάρχει σταθερός σύνδεσμος προς τον σχετικό εκδότη του μέσου. Η θέση μέσων στις ομάδες αυθύπαρκτων παρεμποδίζει τη σταθερή και αξιόπιστη εξαγωγή όλων των μέσων που εκδίδονται από ορισμένο εκδότη. Η θέση μέσων στις ομάδες αυθύπαρκτων αυξάνει τον κίνδυνο της λανθασμένης ταξινόμησης ανά χώρα κατοικίας ή τομέα, δεδομένου ότι τα εν λόγω μέσα συχνά παρέχονται με ελλιπείς πληροφορίες. Έννοια: Για κάθε χώρα κατοικίας το μέγεθος προσδιορίζει τα μέσα σε ομάδες αυθύπαρκτων και τα συνδέει ως ποσοστό επί του αριθμού ή των χρηματικών αξιών με όλα τα μέσα για την εν λόγω χώρα.	Ο στόχος 3β αξιολογεί την ορθή αναγνώριση του πληθυσμού εκδοτών. Στις περιπτώσεις που δεν υπάρχουν αξιόπιστες πληροφορίες για τον εκδότη ενός μέσου, δηλαδή στις περιπτώσεις μέσων που καταλήγουν στις ομάδες αυθύπαρκτων, τα εν λόγω μέσα δεν υπερβαίνουν το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ.	Ρητά ιδιοχαρακτηριστικά: Κωδικός αναγνώρισης εκδότη που χρησιμοποιείται για την ομαδοποίηση.	Ανεξόφλητα ποσά σε ευρώ που αφορούν τα μέσα στις ομάδες αυθύπαρκτων, που εκφράζονται ως ποσοστό επί όλων των μέσων.

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
	Κάλυψη: Το μέγεθος καλύπτει όλα τα μέσα στη CSDB.			
Στόχος 4: **Ακρίβεια δεδομένων — ανεξόφλητο ποσό χρεογράφων συμπεριλαμβανομένων των πιστοποιητικών**	Έννοια: Το μέγεθος συγκεντρώνει τα ανεξόφλητα ποσά για τα χρεόγραφα συμπεριλαμβανομένων των πιστοποιητικών ανά χώρα κατοικίας κάθε εκδότη και τομέα εκδότη σύμφωνα με την έννοια των στατιστικών στοιχείων που αφορούν εκδόσεις τίτλων (SEC). Το συγκεντρωτικό αυτό μέγεθος συγκρίνεται με τον αντίστοιχο αριθμό των SEC και υπολογίζεται η ποσοστιαία απόκλιση των δεδομένων της CSDB. Οι μη επαληθευμένες και μη αιτιολογημένες διαφορές δεν υπερβαίνουν το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ.	Ο στόχος 4 συγκρίνει τα εξαγόμενα δεδομένα της CSDB με εξωτερικά δεδομένα αναφοράς. Μη επαληθευθείσες και μη αιτιολογημένες διαφορές ανάμεσα στα συγκεντρωτικά δεδομένα της CSDB και στις αντίστοιχες πληροφορίες των στατιστικών στοιχείων που αφορούν τις εκδόσεις τίτλων (SEC) και προέρχονται από την ΕΚΤ ή άλλα αξιόπιστα στοιχεία αναφοράς, εφόσον υπάρχουν τέτοια δεδομένα αναφοράς, δεν υπερβαίνουν το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ για την ίδια ημερομηνία αναφοράς για καθέναν από τους ακόλουθους τομείς εκδοτών του ΕΣΛ: — S.11 «μη χρηματοοικονομικές εταιρείες» (S.11 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.121 «η κεντρική τράπεζα» (S.121 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.122 «εταιρείες που δέχονται καταθέσεις, εκτός από την κεντρική τράπεζα» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.123 «αμοιβαία κεφάλαια της χρηματαγοράς (ΑΚΧΑ)» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.124 «αμοιβαία κεφάλαια μη ΑΚΧΑ» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.125 «λοιποί ενδιάμεσοι χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί, εκτός από ασφαλιστικές εταιρείες και συνταξιοδοτικά ταμεία» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.126 «επικουρικοί χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί και φορείς» (S.124 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.127 «θυγατρικοί χρηματοοικονομικοί οργανισμοί και δανειστές χρήματος» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.128 «ασφαλιστικές εταιρείες (ΑΕ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.129 «συνταξιοδοτικά ταμεία (ΣΤ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.13 «γενική κυβέρνηση» (S.13 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95).	Ρητά ιδιοχαρακτηριστικά: Ανεξόφλητα ποσά σε ευρώ, κεφαλαιοποίηση της αγοράς σε ευρώ. Έμμεσα ιδιοχαρακτηριστικά: ημερομηνία έκδοσης, ημερομηνία λήξης, νόμισμα, τομέας εκδότη ΕΣΛ, χώρα κατοικίας.	Ανεξόφλητα ποσά ή κεφαλαιοποίηση της αγοράς σε ευρώ, που εκφράζονται ως ποσοστιαία διαφορά μεταξύ των στοιχείων αναφοράς της CSDB και των εξωτερικών στοιχείων αναφοράς.

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
Στόχος 5: **Ακρίβεια δεδομένων — μετοχικοί τίτλοι κεφαλαιοποίησης αγοράς**	Έννοια: Το μέγεθος συγκεντρώνει την κεφαλαιοποίηση αγοράς σχετικά με μετοχές ανά χώρα κατοικίας κάθε εκδότη και τομέα εκδότη σύμφωνα με την έννοια των στατιστικών στοιχείων που αφορούν τις εκδόσεις τίτλων. Το συγκεντρωτικό αυτό μέγεθος συγκρίνεται με τον αντίστοιχο αριθμό των SEC και υπολογίζεται η ποσοστιαία απόκλιση των δεδομένων της CSDB. Οι μη επαληθευμένες και μη αιτιολογημένες διαφορές δεν υπερβαίνουν το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ.	Ο στόχος 5 συγκρίνει τα εξαγόμενα δεδομένα της CSDB με εξωτερικά δεδομένα αναφοράς. Οι μη επαληθευμένες και μη αιτιολογημένες διαφορές ανάμεσα στις συγκεντρωτικές πληροφορίες της CSDB και στις αντίστοιχες πληροφορίες των στατιστικών στοιχείων που αφορούν στις εκδόσεις τίτλων (SEC) που προέρχονται από την ΕΚΤ ή άλλα αξιόπιστα στοιχεία αναφοράς, εφόσον υπάρχουν τέτοια δεδομένα αναφοράς, δεν υπερβαίνουν το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ για την ίδια ημερομηνία αναφοράς για καθέναν από τους ακόλουθους τομείς εκδοτών του ΕΣΛ: — S.11 «μη χρηματοοικονομικές εταιρείες» (S.11 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.121 «η κεντρική τράπεζα» (S.121 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.122 «εταιρείες που δέχονται καταθέσεις, εκτός από την κεντρική τράπεζα» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.123 «αμοιβαία κεφάλαια της χρηματαγοράς (ΑΚΧΑ)» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.124 «αμοιβαία κεφάλαια μη ΑΚΧΑ» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.125 «λοιποί ενδιάμεσοι χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί, εκτός από ασφαλιστικές εταιρείες και συνταξιοδοτικά ταμεία» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.126 «επικουρικοί χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί και φορείς» (S.124 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.127 «θυγατρικοί χρηματοοικονομικοί οργανισμοί και δανειστές χρήματος» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.128 «ασφαλιστικές εταιρείες (ΑΕ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.129 «συνταξιοδοτικά ταμεία (ΣΤ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.13 «γενική κυβέρνηση» (S.13 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95).	Ρητά ιδιοχαρακτηριστικά: Ανεξόφλητο ποσό σε ευρώ, αριθμός μετοχών σε κυκλοφορία για εισηγμένες μετοχές. Έμμεσα ιδιοχαρακτηριστικά: ονομαστικό νόμισμα, τομέας ΕΣΛ του εκδότη, χώρα κατοικίας, αξία τιμής για εισηγμένες μετοχές (έλεγχος οριακής τιμής μόνο).	Ανεξόφλητα ποσά ή κεφαλαιοποίηση της αγοράς σε ευρώ, που εκφράζονται ως ποσοστιαία διαφορά μεταξύ των στοιχείων αναφοράς της CSDB και των εξωτερικών στοιχείων αναφοράς.

Στόχος ΔΠΔ	Μεγέθη ΔΠΔ	Εφαρμογή	Ιδιοχαρακτηριστικά εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση	Βάση ελάχιστου επιπέδου εργασιών της ΔΠΔ
Στόχος 6: **Ακρίβεια δεδομένων — ταξινόμηση εκδότη**	Έννοια: Το μέγεθος κατατάσσει τους εκδότες για κάθε συνδυασμό χώρας κατοικίας / τομέα εκδότη σύμφωνα με τις συνολικές τους υποχρεώσεις από τίτλους (μετοχικούς τίτλους και χρέος συνδυασμένα). Το μέγεθος δηλώνει επίσης τις απόλυτες μεταβολές στην κατάταξη ανάμεσα στους διαφορετικούς εκδότες, ώστε να διευκολύνεται ο εντοπισμός σημαντικών οριακών τιμών στα ανεξόφλητα ποσά ή την κεφαλαιοποίηση της αγοράς. Η χώρα κατοικίας και η ταξινόμηση του τομέα του εκδότη επαληθεύονται μέχρι το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ. Κάλυψη: Το μέγεθος καλύπτει όλα τα μερίδια αμοιβαίων κεφαλαίων, τους μετοχικούς τίτλους και τα χρεόγραφα που δεν έχουν ημερομηνία λήξης μεγαλύτερη από τρεις μήνες.	Ο στόχος 6 αξιολογεί τη στατιστική ταξινόμηση των εκδοτών. Η στατιστική ταξινόμηση των εκδοτών μέχρι το ελάχιστο επίπεδο εργασιών της ΔΠΔ επαληθεύεται για καθέναν από τους ακόλουθους τομείς εκδοτών του ΕΣΛ: — S.11 «μη χρηματοοικονομικές εταιρείες» (S.11 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.121 «η κεντρική τράπεζα» (S.121 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.122 «εταιρείες που δέχονται καταθέσεις, εκτός από την κεντρική τράπεζα» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.123 «αμοιβαία κεφάλαια της χρηματαγοράς (ΑΚΧΑ)» (S.122 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.124 «αμοιβαία κεφάλαια μη ΑΚΧΑ» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.125 «λοιποί ενδιάμεσοι χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί, εκτός από ασφαλιστικές εταιρείες και συνταξιοδοτικά ταμεία» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.126 «επικουρικοί χρηματοπιστωτικοί οργανισμοί και φορείς» (S.124 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.127 «θυγατρικοί χρηματοοικονομικοί οργανισμοί και δανειστές χρήματος» (S.123 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.128 «ασφαλιστικές εταιρείες (ΑΕ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.129 «συνταξιοδοτικά ταμεία (ΣΤ)» (S.125 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95) — S.13 «γενική κυβέρνηση» (S.13 σύμφωνα με το ΕΣΛ 95).	Τομέας εκδότη του ΕΣΛ, χώρα κατοικίας.	Ανεξόφλητα ποσά ή κεφαλαιοποίηση της αγοράς σε ευρώ, που εκφράζονται ως «κεφαλαιοποίηση», δηλαδή ανεξόφλητα ποσά συν κεφαλαιοποίηση της αγοράς ανά εκδότη.

(1) Η αρίθμηση των κατηγοριών αντικατοπτρίζει την αρίθμηση που χρησιμοποιείται στην πρόταση κανονισμού του Ευρωπαϊκού Κοινοβουλίου και του Συμβουλίου για το ευρωπαϊκό σύστημα εθνικών και περιφερειακών λογαριασμών της Ευρωπαϊκής Ένωσης, COM(2010) 774 τελικό.

ΠΑΡΑΡΤΗΜΑ II

ΣΥΝΟΛΑ ΕΞΑΓΟΜΕΝΩΝ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ ΚΑΙ ΙΔΙΟΧΑΡΑΚΤΗΡΙΣΤΙΚΑ ΕΞΑΓΟΜΕΝΩΝ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ ΠΡΟΣ ΠΕΡΑΙΤΕΡΩ ΧΡΗΣΗ ΠΟΥ ΚΑΛΥΠΤΟΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΟ ΠΛΑΙΣΙΟ ΤΗΣ ΔΠΔ

Το πλαίσιο της ΔΠΔ καλύπτει τα ακόλουθα σύνολα εξαγόμενων δεδομένων (feeds) που υποστηρίζουν διαφορετικές χρήσεις:

— Σύνολα εξαγόμενων δεδομένων που υποστηρίζουν τις στατιστικές του εξωτερικού τομέα (EXT 1.0)

— Σύνολα εξαγόμενων δεδομένων για χρηματοδοτικές εταιρείες ειδικού σκοπού που υποστηρίζουν τις στατιστικές για τις χρηματοδοτικές εταιρείες ειδικού σκοπού (FVC 1.0)

— Σύνολα εξαγόμενων δεδομένων για επενδυτικούς οργανισμούς που υποστηρίζουν τις στατιστικές για τους επενδυτικούς οργανισμούς (IF 1.0)

— Σύνολα εξαγόμενων δεδομένων για την κατοχή αξιογράφων που υποστηρίζουν τις στατιστικές για την κατοχή αξιογράφων (SHS 1.0)

— Σύνολα εξαγόμενων δεδομένων για τη χρηματοδότηση κυβερνήσεων μέσω της έκδοσης τίτλων που υποστηρίζουν τις στατιστικές για τη χρηματοδότηση κυβερνήσεων μέσω της έκδοσης τίτλων (GSF 1.0)

Ιδιοχαρακτηριστικά των εξαγόμενων δεδομένων προς περαιτέρω χρήση που συνιστούν τα υποστηριζόμενα σύνολα εξαγόμενων δεδομένων:

Ονομασία ιδιοχαρακτηριστικού εξαγόμενου δεδομένου προς περαιτέρω χρήση	Περιγραφή	Εφαρμοστέο σύνολο εξαγόμενων δεδομένων				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code [Κωδικός Διεθνούς Αριθμού Αναγνώρισης Τίτλων (ISIN)]	Κωδικός αναγνώρισης τίτλου ISIN	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class [Κατηγορία μέσου κατά το Ευρωπαϊκό Σύστημα Λογαριασμών (ΕΣΛ)]	Ταξινόμηση του τίτλου σύμφωνα με το ΕΣΛ	√	√	√	√	√
Debt type (Είδος χρέους)	Είδος χρεογράφου				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Ιδιοχαρακτηριστικό που μπορεί να χρησιμοποιηθεί για τον εντοπισμό τίτλων που πρέπει να περιλαμβάνονται στα «τρέχοντα ανεξόφλητα ποσά», σύμφωνα με τους ορισμούς των SEC της ΕΚΤ					√
Instrument supplementary class (Συμπληρωματική κατηγορία μέσου)	Συμπληρωματικό ιδιοχαρακτηριστικό που επιτρέπει την εξακρίβωση του κατά πόσο ένα μέσο πρέπει να συμπεριλαμβάνεται στα SEC ή όχι. Το ιδιοχαρακτηριστικό αυτό μπορεί να λαμβάνει αξίες όπως 1 = «coupon strip» (απόκομμα τοκομεριδίου), 2 = «principal strip» (απόκομμα κεφαλαίου) κ.λπ.					√
Security status (Κατάσταση τίτλου)	Συμπληρωματικό ιδιοχαρακτηριστικό που επιτρέπει την εξακρίβωση του κατά πόσο ένα μέσο πρέπει να συμπεριλαμβάνεται στα SEC ή όχι. Το ιδιοχαρακτηριστικό αυτό μπορεί να δηλώνει αν ένα μέσο είναι ενεργό ή όχι.					√
Asset securitisation type (Είδος τιτλοποίησης περιουσιακών στοιχείων)	Είδος διασφάλισης περιουσιακών στοιχείων.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Ιδιοχαρακτηριστικό που δηλώνει κατά πόσο ένα μέσο είναι αποδεκτό ως ασφάλεια για τις πιστοδοτικές και πιστοληπτικές πράξεις του ευρωσυστήματος				√	
Nominal currency (Ονομαστικό νόμισμα)	Νόμισμα στο οποίο εκφράζεται το μέσο [Διεθνής Οργανισμός Τυποποίησης (ISO) 4217]	√	√	√	√	√

Ονομασία ιδιοχαρακτηριστικού εξαγόμενου δεδομένου προς περαιτέρω χρήση	Περιγραφή	Εφαρμοστέο σύνολο εξαγόμενων δεδομένων				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (Ημερομηνία έκδοσης)	Η ημερομηνία κατά την οποία οι τίτλοι παραδίδονται από τον εκδότη στον ανάδοχο έναντι πληρωμής. Είναι η ημερομηνία που οι τίτλοι είναι διαθέσιμοι για παράδοση για πρώτη φορά σε επενδυτές. Σημείωση: Προκειμένου περί αποκόμματος, η εν λόγω στήλη δηλώνει την ημερομηνία κατά την οποία αποκόπτεται το τοκομερίδιο/κεφάλαιο.	√	√	√	√	√
Maturity date (Ημερομηνία λήξης)	Ημερομηνία κατά την οποία το χρεόγραφο εξοφλείται στην πράξη	√	√	√	√	√
Residual maturity (Εναπομένουσα ληκτότητα)	Η εναπομένουσα ληκτότητα ενός μέσου που υπολογίζεται κατά την ημερομηνία αποτύπωσης των δεδομένων					√
Issuer domicile country (Χώρα εγκατάστασης εκδότη)	Χώρα νόμιμης σύστασης (έδρα) του εκδότη του τίτλου (ISO 3166)	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (Τομέας ΕΣΛ του εκδότη)	Θεσμικός τομέας του εκδότη σύμφωνα με το ΕΣΛ	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification [Ταξινόμηση κατά την Ευρωπαϊκή Ταξινόμηση των Οικονομικών Δραστηριοτήτων (NACE) του εκδότη]	Κύρια οικονομική δραστηριότητα σύμφωνα με τη NACE	√				
Amount issued (Εκδοθέν ποσό)	Ποσό του χρεογράφου κατά την έκδοση (ονομαστική αξία) Προκειμένου περί αποκόμματος, η εν λόγω στήλη δηλώνει το ποσό στο οποίο έχει αποκοπεί το τοκομερίδιο/κεφάλαιο. Προκειμένου περί τίτλου εκδοθέντος κατά τμήματα, υπό τον ίδιο ISIN, η στήλη δηλώνει το σωρευτικό ποσό που επί του παρόντος έχει εκδοθεί. Το εκδοθέν ποσό εκφράζεται σε ονομαστικό νόμισμα.					√
Amount outstanding (Ανεξόφλητο ποσό)	Ανεξόφλητο ποσό σε ονομαστική αξία. Προκειμένου περί τίτλου εκδοθέντος κατά τμήματα, υπό τον ίδιο ISIN, η στήλη αυτή υποδεικνύει το σωρευτικό ποσό που επί του παρόντος έχει εκδοθεί, μείον τις εξοφλήσεις. Οι αξίες δίνονται σε ονομαστικό νόμισμα. Το ανεξόφλητο ποσό εκφράζεται σε ονομαστικό νόμισμα. Αν δεν εμφανίζεται ονομαστικό νόμισμα, το ανεξόφλητο ποσό εκφράζεται σε ευρώ.	√			√	√
Amount outstanding in euro (Ανεξόφλητο ποσό σε ευρώ)	Ανεξόφλητο ποσό μετατραπέν σε ευρώ με χρήση της ισοτιμίας του ευρώ έναντι του ονομαστικού νομίσματος που ισχύει κατά την ημερομηνία του πληθυσμού				√	√
Market capitalisation (Κεφαλαιοποίηση αγοράς)	Τελευταία διαθέσιμη κεφαλαιοποίηση της αγοράς. Η κεφαλαιοποίηση της αγοράς εκφράζεται σε ονομαστικό νόμισμα. Αν δεν εμφανίζεται ονομαστικό νόμισμα, η κεφαλαιοποίηση της αγοράς εκφράζεται σε ευρώ.				√	

Ονομασία ιδιοχαρακτηριστικού εξαγόμενου δεδομένου προς περαιτέρω χρήση	Περιγραφή	Εφαρμοστέο σύνολο εξαγόμενων δεδομένων				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Απόδοση στη λήξη)	Συγκεκριμένη απόδοση του τίτλου στη λήξη του σε ποσοστό				√	√
Short name (Σύντομη ονομασία)	Σύντομη ονομασία που δίδεται από τον εκδότη και καθορίζεται βάσει των χαρακτηριστικών της έκδοσης και κάθε διαθέσιμης πληροφορίας					√
Pool factor (Συντελεστής ομαδοποίησης)	Προκειμένου περί τίτλων εξασφαλισμένων με ενυπόθηκα δάνεια, ο συντελεστής ομαδοποίησης ή συντελεστής εναπομένοντος υπολοίπου κεφαλαίου είναι το ανεξόφλητο υπόλοιπο του κεφαλαίου των ομαδοποιημένων ενυπόθηκων δανείων τα οποία αφορά ο τίτλος διαιρούμενο με το αρχικό υπόλοιπο κεφαλαίου	√	√	√	√	√
Quotation basis (Βάση τιμής)	Βάση ορισμού της τιμής του μέσου, π.χ. ποσοστό ονομαστικής (επί τοις εκατό) ή νόμισμα ανά μετοχή/μονάδα (μονάδες)	√	√	√	√	√
Price value (Αξία τιμής)	Τελευταία διαθέσιμη αντιπροσωπευτική τιμή του μέσου κατά την ημερομηνία αναφοράς στη βάση τιμής και το ονομαστικό νόμισμα, κατά περίπτωση, του μέσου. Προκειμένου περί έντοκων τίτλων, παρέχεται η καθαρή τιμή, δηλαδή εξαιρουμένων των δεδουλευμένων τόκων.	√	√	√	√	√
Price value type (Είδος αξίας τιμής)	Φύση της αξίας τιμής, δηλαδή εάν αντιπροσωπεύει αποτίμηση της αγοράς, εκτιμηθείσα ή αρχική αξία.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Μηνιαία μέση τιμή)	Μέσος όρος των ονομαστικών τιμών του μέσου που διατίθενται τις 30 τελευταίες ημερολογιακές ημέρες μέχρι την ημερομηνία αναφοράς επί της βάσης της τιμής και του ονομαστικού νομίσματος του μέσου, κατά περίπτωση.	√			√	
Redemption type (Είδος εξόφλησης)	Είδος εξόφλησης, π.χ. πλήρης αποπληρωμή κατά τη λήξη (bullet), διαρκής, διαρθρωμένη, σε τακτά διαστήματα, τμηματική, έκτακτη, μηδενική, κλιμακούμενη					√
Redemption frequency (Συχνότητα εξόφλησης)	Αριθμός εξοφλήσεων ορισμένου χρεογράφου ανά έτος					√
Redemption price (Τιμή εξόφλησης)	Τελική τιμή εξόφλησης					√
Accrued interest (Δεδουλευμένοι τόκοι)	Δεδουλευμένοι τόκοι από την τελευταία πληρωμή του τοκομεριδίου ή από την ημερομηνία έναρξης της τοκοφορίας. Προκειμένου περί τοκοφόρων τίτλων, το άθροισμα της εν λόγω τιμής και της τιμής αξίας είναι η λεγόμενη «ακαθάριστη τιμή».	√	√	√		√
Accrued income factor (Συντελεστής δεδουλευμένου εισοδήματος)	Ειδικός συντελεστής ημερήσιου εισοδήματος του τίτλου εκφραζόμενος ως ποσοστό, που υπολογίζεται σύμφωνα με τη μέθοδο του οφειλέτη. Ο συντελεστής βασίζεται σε δεδουλευμένα, δηλαδή στην απόδοση του συνδυαστικού αποτελέσματος δεδουλευμένου τόκου και εισοδήματος που οφείλεται στη διαφορά των τιμών έκδοσης και εξαγοράς.	√	√	√	√	

Ονομασία ιδιοχαρακτηριστικού εξαγόμενου δεδομένου προς περαιτέρω χρήση	Περιγραφή	Εφαρμοστέο σύνολο εξαγόμενων δεδομένων				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Είδος τοκομεριδίου)	Είδος τοκομεριδίου, π.χ. σταθερό, κυμαινόμενο, κλιμακούμενο κ.λπ.				√	√
Last coupon rate (Τελευταίο επιτόκιο τοκομεριδίου)	Τελευταίο επιτόκιο τοκομεριδίου, εκφραζόμενο ως ποσοστό, ανά έτος που πληρώθηκε πραγματικά (ετήσια βάση)	√	√	√	√	
Last coupon date (Τελευταία ημερομηνία τοκομεριδίου)	Ημερομηνία του τελευταίου επιτοκίου τοκομεριδίου που πληρώθηκε πραγματικά. Το ιδιοχαρακτηριστικό επιτρέπει να εξακριβωθεί κατά πόσο το τελευταίο επιτόκιο τοκομεριδίου που πληρώθηκε πραγματικά εμπίπτει στην περίοδο παροχής στοιχείων ή όχι.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Τελευταία συχνότητα τοκομεριδίου)	Συχνότητα ανά έτος στην οποία αποπληρώνεται το τελευταίο επιτόκιο τοκομεριδίου: η «annual» (ετήσια) μετατρέπεται σε «AN», η «semi-annual» (εξαμηνιαία) σε «SA» κ.λπ.	√	√	√	√	
Dividend amount (Ποσό μερίσματος)	Ποσό της τελευταίας πληρωμής μερίσματος ανά μετοχή (σε είδος ποσού μερίσματος) προ φορολόγησης (ακαθάριστο μέρισμα)	√		√	√	
Dividend amount type (Τύπος ποσού μερίσματος)	Το ποσό μερίσματος ανά μετοχή μπορεί να εκφράζεται σε νόμισμα μερίσματος ή σε αριθμό μετοχών.	√		√	√	
Dividend currency (Νόμισμα μερίσματος)	Κωδικός ISO 4217 του νομίσματος της τελευταίας πληρωμής μερίσματος	√		√	√	
Dividend Settlement date (Ημερομηνία διακανονισμού μερίσματος)	Ημερομηνία διακανονισμού της τελευταίας πληρωμής μερίσματος. Το ιδιοχαρακτηριστικό επιτρέπει να εξακριβωθεί κατά πόσο το ποσό του μερίσματος που πληρώθηκε εμπίπτει στην περίοδο παροχής στοιχείων ή όχι.	√		√	√	
Last split factor (Συντελεστής τελευταίας διάσπασης)	Διασπάσεις μετοχών και αντίστροφες διασπάσεις μετοχών	√		√	√	
Last split date (Ημερομηνία τελευταίας διάσπασης)	Ημερομηνία από την οποία παράγει αποτελέσματα η διάσπαση μετοχής	√		√	√	