IRÁNYMUTATÁSOK

AZ EURÓPAI KÖZPONTI BANK IRÁNYMUTATÁSA

(2012. szeptember 26.)

a Központi Értékpapír-adatbázis adatminőség-kezelési keretrendszeréről

(EKB/2012/21)

(2012/689/EU)

AZ EURÓPAI KÖZPONTI BANK KORMÁNYZÓTANÁCSA,

tekintettel a Központi Bankok Európai Rendszere és az Európai Központi Bank Alapokmányára és különösen annak 5.1., 12.1. és 14.3. cikkére,

tekintettel az Európai Központi Bank által végzett statisztikai adatgyűjtésről szóló, 1998. november 23-i 2533/98/EK tanácsi rendeletre [1],

mivel:

(1) A Központi Értékpapír-adatbázis (*Centralised Securities Database – CSDB*) egy egységes informatikai infrastruktúra, amelyet a Központi Bankok Európai Rendszerének (KBER) tagjai közösen működtetnek, beleértve azon, euroövezeten kívüli tagállamok nemzeti központi bankjait (NKB-k), amelyek önkéntesen részt vesznek a CSDB működtetésében. A Központi Értékpapír-adatbázis tételes adatokat tartalmaz, különösen az értékpapírokra, azok kibocsátóira és árára vonatkozóan.

(2) Az adatokat különböző forrásokból gyűjtik – beleértve a KBER tagjait, az egyes kereskedelmi adatszolgáltatókat, a nyilvános és közigazgatási forrásokat –, és azokat a Központi Értékpapír-adatbázis részére továbbítják. Fennáll azonban annak a kockázata, hogy a beérkezett beviteli adat pontatlan vagy hiányos. A Központi Értékpapír-adatbázis rendszere képes egyeztetni a részlegesen ellentmondásos, különböző forrásokból származó beviteli adatokat, és ki tudja szűrni a hiányos vagy hiányzó adatokat. A különböző, egymást átfedő forrásokból származó beviteli adatokat automatikusan, a lehető legnagyobb mértékig egy teljes és jó minőségű egységes adatrekordba rendezi össze.

(3) A Központi Értékpapír-adatbázisban szereplő adatok általános minőségét inkább a kimeneti adatok szintjén, semmint az egyedi beviteli adatok szintjén lehet értékelni. A kimeneti adatok teljességének, pontosságának és következetességének biztosítása érdekében a lehető legnagyobb mértékben szükséges meghatározni egy, a kimeneti adatkörökre alkalmazandó adatminőség-kezelési keretrendszert (*Data Quality Management – DQM*), amely a kimeneti adatok egy olyan részhalmaza, amely statisztikák előállításának elősegítésére vagy egyéb célokra használható. A kimeneti adatkört legkésőbb a minden egyes naptári hónap végétől számított hetedik napig kell az NKB-k rendelkezésére bocsátani.

(4) Néhány kimeneti adat olyan attribútumokat is tartalmaz, mint például az árak vagy a jövedelemmel kapcsolatos információk, amelyek várhatóan idővel változnak. Ezen attribútumokat statisztikai algoritmusok alkalmazásával a Központi Értékpapír-adatbázis rendszere automatikusan ellenőrzi. Ezen iránymutatásnak megfelelően csak az I. mellékletben foglalt adatminőség-kezelési célok tekintetében meghatározott attribútumok a tárgyai az illetékes hatóságok általi ellenőrzésnek. A támogatott adatköröket képező attribútumok teljes listája a II. mellékletben került meghatározásra.

(5) A Központi Értékpapír-adatbázis adatminőség-kezelési keretrendszerét a beviteli adatok forrására tekintet nélkül kell alkalmazni a kimeneti adatkörök tekintetében. A keretrendszernek meg kell határoznia az euroövezeten belüli NKB-nak, és adott esetben az Európai Központi Banknak (EKB) a Központi Értékpapír-adatbázis kimeneti adatainak minőségével kapcsolatos felelősségeit.

(6) A Központi Értékpapír-adatbázis adatminőség-kezelési keretrendszerének először is olyan adatminőség-kezelési célokon kell alapulnia, amelyek a kimeneti adatkörök minősége értékelési mutatószámait fejezik ki, másodszor pedig olyan adatminőség-kezelési módszereken, amelyek az egyes adatminőség-kezelési célok tekintetében azonosítják és rangsorolják az ellenőrizendő kimeneti adatkört. Továbbá olyan adatminőség-kezelési küszöbértékeken is alapulnia kell, amelyek meghatározzák egy adatminőség-kezelési cél elérése érdekében elvégzendő ellenőrzés minimum szintjét.

(7) Referenciaadatok hiányában az adatminőség-kezelési célok nem minden esetben azonosítanak hibát a kimeneti adatkörben, hanem csak olyan eseteket tudnak azonosítani, amikor a kimeneti adatkör kézi ellenőrzésére van szükség.

(8) Mivel a Központi Értékpapír-adatbázist valamennyi KBER-tag közösen működteti, mindannyiuknak azonos adatminőség-kezelési standardok követését kell megcélozniuk. Mindezen túlmenően az euroövezeten kívüli NKB-k vannak a legmegfelelőbb helyzetben az adatminőség-kezelés végrehajtására az azon kibocsátókra vonatkozó adatok tekintetében, amelyek a tagállamukban rezidensek. Annak elismerése mellett, hogy az EKB által elfogadott

[1] HL L 318., 1998.11.27., 8. o.

iránymutatások az euroövezeten kívüli NKB-kra nem róhatnak kötelezettségeket, a Központi Bankok Európai Rendszere és az Európai Központi Bank Alapokmányának 5. cikke egyaránt vonatkozik az euroövezeti és az euroövezeten kívüli NKB-kra. Ezért az euroövezeten kívüli NKB-knak meg kell tervezniük és végre kell hajtaniuk az összes olyan intézkedést, amelyet ezen iránymutatásnak megfelelően szükségesnek tartanak az adatminőség-kezelés elvégzése érdekében.

(9) A kimeneti adatok minőségének javítása érdekében az adatforrás-kezelést (*Data Source Management – DSM*) a beviteli adatokban való ismétlődő és strukturális hibák azonosításának és kijavításának céljával közvetlenül az adatszolgáltatónak kell elvégeznie,

ELFOGADTA EZT AZ IRÁNYMUTATÁST:

1. cikk

Fogalommeghatározások

Ezen iránymutatás alkalmazásában:

1. „CSDB (*Centralised Securities Database*)": a KBER által felállított és az EKB helyiségeiben található Központi Értékpapír-adatbázis;

2. „beviteli adat *(input data)*": bármely, egy vagy több adatforrásból a Központi Értékpapír-adatbázis részére szolgáltatott adat;

3. „kimeneti adat *(output data)*": a beviteli adatok egy teljes, jó minőségű egységes adatrekordba történő rendezése folytán a Központi Értékpapír-adatbázisban automatikusan előálló adat;

4. „kimeneti adatkör *(output feed data)*": a kimeneti adat részhalmaza, valamint a II. mellékletben felsorolt jellemzők, amelyek statisztikák előállításának elősegítésére vagy egyéb célokra használható adatbevitelként szolgálnak;

5. „adatminőség-kezelés" vagy „DQM *(Data Quality Management)*": a kimeneti adatkör minőségének biztosítása, ellenőrzése és fenntartása, az adatminőség-kezelés céljainak, módszereinek, küszöbértékeinek és munkafolyamatainak használata és alkalmazása által;

6. „adatforrás-kezelés" vagy „DSM *(Data Source Management)*": a beviteli adatok ismétlődő és/vagy strukturális hibáinak közvetlenül az adatszolgáltató által történő azonosítása és kijavítása;

7. „kezdeti DQM": a kimeneti adatkör adatminőség-kezelése – beleértve a legutóbbi időszakra vonatkozó adatokat –, amelyet az illetékes DQM-hatóságok végeznek havonként, figyelembe véve a hó végi előzetes áttekintés során előállított kimeneti adatköröket;

8. „rendszeres DQM": a kimeneti adatkör adatminőség-kezelése, amelyet az illetékes DQM-hatóságok végeznek el havonként, figyelembe véve a különböző adatforrásokból származó nem-CSDB-referenciaadatokat, annak érdekében, hogy a Központi Értékpapír-adatbázis kimeneti adatainak minősége kielégítse a Központi Értékpapír-adatbázis adatköreire vonatkozó követelményeket;

9. „DQM-cél": a kimeneti adatkör minőségének értékelésére használt, az I. mellékletben meghatározott referencia;

10. „DQM-módszer": statisztikai mutatószám, amely az I. mellékletben meghatározottak szerint azt mutatja, hogy egy bizonyos DQM-célt milyen mértékben értek el;

11. „DQM-küszöbérték": egy adott DQM-célra vonatkozóan az adatminőség-kezelési keretrendszer követelményeinek kielégítése érdekében lefolytatandó ellenőrzési munka minimum szintje;

12. „DQM-munkafolyamat": technikai eljárás, amelyet a beviteli adatok kijavítására alkalmaznak a DQM-küszöbértéknek való megfelelés érdekében;

13. „hó végi előzetes áttekintés": a kimeneti adatok és azon DQM-módszerek rendszeres havonkénti frissítése, amely a következő hó végi állapot kimeneti adatait előre jelzik;

14. „munkanap": egy olyan teljes nap, amelyen a TARGET2 nyitva van, az EKB honlapján közzétettek szerint;

15. „ellenőrzés": olyan eljárás, amelynek során az illetékes DQM-hatóságok megvizsgálják a CSDB-kimeneti adatkört, és amennyiben szükséges, kijavítják a CSDB-beviteli adatokat, alkalmazva a DQM-munkafolyamatot;

16. „rezidens": jelentése azonos a 2533/98/EK rendelet 1. cikkében foglalt meghatározással.

2. cikk

Tárgy és hatály

(1) Ezen iránymutatás létrehozza a Központi Értékpapír-adatbázisban lévő adatminőség-kezelési keretrendszert, amelynek célja a Központi Értékpapír-adatbázisban foglalt kimeneti adatok teljességének, pontosságának és következetességének biztosítása az ilyen adatokra vonatkozó minőségi követelmények következetes alkalmazása által.

(2) A Központi Értékpapír-adatbázis adatminőség-kezelési keretrendszerének az adatminőség-kezelésen és az adatforrás-kezelésen kell alapulnia.

3. cikk

Illetékes DQM-hatóságok

(1) Egy adott kibocsátóhoz kapcsolódó adatok tekintetében azon euroövezeti tagállam NKB-ja az illetékes az adatminőség-kezeléssel kapcsolatban, ahol az értékpapír kibocsátója rezidens.

(2) Az EKB az illetékes adatminőség-kezelő azon adatok vonatkozásában, amelyek az euroövezeten kívül rezidens kibocsátókra vonatkoznak, kivéve, ha egy euroövezeten kívüli NKB felelősséget vállalt a tagállamában rezidens kibocsátók adataira vonatkozó adatminőség-kezelés lefolytatására.

4. cikk

DQM, DQM-módszerek és DQM-küszöbértékek

(1) Az illetékes DQM-hatóságok kezdeti és rendszeres adatminőség-ellenőrzést folytatnak le. Ennek során ellenőrzik a kimeneti adatköröket, függetlenül azok eredetétől.

(2) Az illetékes DQM-hatóságok az I. mellékletben foglaltaknak megfelelően alkalmazzák az adatminőség-kezelési módszereket.

(3) Az I. melléklet által lefedett attribútumokra az illetékes DQM-hatóságok olyan szintű DQM-küszöbértéket alkalmaznak, amely biztosítja a kimeneti adatkör minőségét az adott attribútumok használatának támogatására vonatkozó követelményeknek megfelelően a II. mellékletben meghatározottak szerint.

5. cikk

Kezdeti DQM

(1) Az I. mellékletben meghatározottak szerint a kezdeti DQM-et az 1., 2., 3a., 3b. és 6. DQM-cél vonatkozásában kell alkalmazni.

(2) Az EKB minden naptári hónap végét hét munkanappal megelőzően közzéteszi a hó végi előzetes áttekintést.

(3) A kezdeti DQM lefolytatása során az illetékes DQM-hatóságok ellenőrzik a lényeges kiugró statisztikai értékeket annak biztosítása érdekében, hogy a kezdeti DQM lefolytatását követően a kimeneti adatkörök a lehető legnagyobb mértékig tükrözzék a legutóbbi fejleményeket.

(4) Az illetékes DQM-hatóságok a következő naptári hónap második munkanapjának végéig ellenőrzik a hó végi előzetes áttekintés adatait annyiban, amennyiben azok a DQM-módszer szerint a DQM-küszöbértéknek nem felelnek meg.

(5) A CSDB-n kívül elérhető referenciaadatok hiányában a kezdeti DQM kizárólag a már az illetékes DQM-hatóság rendelkezésére álló információn alapul, vagy olyan információn, amely könnyen elérhető új adatszolgáltatási követelmények felállítása nélkül.

(6) Az illetékes DQM-hatóságok a DQM-munkafolyamatnak megfelelően a CSDB-rendszer használatával, vagy adott esetben a beviteli adatfájlok EKB részére történő szolgáltatásával javítják ki a beviteli adatokat.

6. cikk

Rendszeres DQM

(1) Az I. mellékletben meghatározottak szerint a rendszeres DQM-et a 3a., 3b., 4., 5. és 6. DQM-cél esetében kell alkalmazni.

(2) Az illetékes DQM-hatóságok a rendszeres DQM-et minden egyes naptári hónap végét követő egy hónapon belül végzik el. Az összes elérhető információt figyelembe véve ellenőrzik a kimeneti adatköröket, legkésőbb azon hónapot követő naptári hónap második munkanapjáig, amelyben a rendszeres DQM-et lefolytatták.

(3) Az illetékes DQM-hatóságok a kialakított DQM-munkafolyamatnak megfelelően a CSDB-rendszer használatával vagy, adott esetben, a beviteli adatfájloknak az EKB részére történő szolgáltatásával javítják ki a beviteli adatokat.

7. cikk

A DSM-hez kapcsolódó feladatok

(1) Az illetékes DQM-hatóságoknak azonosítaniuk kell bármely, a DSM-el kapcsolatos kérdést, és azokat jelenteniük kell az EKB-nak.

(2) Az EKB az érintett illetékes DQM-hatóságokkal együttműködésben orvosolja a DSM-hez kapcsolódó magas prioritású ismétlődő hibákat, azoknak az EKB részére történő bejelentése időpontját követő egy hónapon belül.

8. cikk

A beviteli adatok javítása

Amennyiben az illetékes DQM-hatóság javított beviteli adatokkal rendelkezik, úgy az a CSDB-rendszert használja bármely, a beviteli adataiban lévő azon hibák vagy mulasztások kijavítására, amelyek nem kerültek javításra az 5. cikk (4) bekezdésében meghatározott ellenőrzés során.

9. cikk

Éves minőségi jelentés

Figyelembe véve a KBER Statisztikai Bizottságának véleményét, az EKB Igazgatósága évente beszámol a Kormányzótanácsnak a kimeneti adatkörök minőségéről.

10. cikk

Egyszerűsített módosítási eljárás

Figyelembe véve a KBER Statisztikai Bizottságának véleményét, az EKB Igazgatósága technikai módosításokat végezhet ezen iránymutatás mellékleteiben, feltéve, hogy az ilyen módosítások nem változtatják meg az iránymutatás mögöttes koncepcionális keretét – beleértve az EKB és az NKB-k közötti felelősség megosztását – és nem érintik az illetékes DQM-hatóságok jelentési terhét. Az Igazgatóság haladéktalanul értesíti a Kormányzótanácsot bármilyen ilyen módosításról.

11. cikk

Hatálybalépés

(1) Ez az iránymutatás 2012. november 1-jén lép hatályba.

(2) Ezt az iránymutatást 2013. július 1-jétől kell alkalmazni.

12. cikk

Címzettek

Ennek az iránymutatásnak a címzettje az eurorendszer valamennyi központi bankja.

Kelt Frankfurt am Mainban, 2012. szeptember 26-án.

az EKB Kormányzótanácsa nevében
az EKB elnöke
Mario DRAGHI

I. MELLÉKLET

DQM-CÉLOK, -VÉGREHAJTÁS, -ATTRIBÚTUMOK ÉS A DQM-KÜSZÖBÉRTÉK ALAPJA

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
1. cél: **Adatstabilitás– állományi adatok**	Koncepció: A módszer minden egyes rezidens ország/szektor kombináció tekintetében meghatározásra kerül mint forgalommal súlyozott „változási index", pénzmennyiségekkel súlyozva. Az 1-es indexérték azt mutatja, hogy az adott attribútum nem változott egyik alapul szolgáló értékpapír esetében sem, míg a 0-s indexérték azt mutatja, hogy az adott attribútum valamennyi értékpapír tekintetében megváltozott. Ha egy mutató 1-es érték alá esik, az egyedi értékpapírokat az index esését okozó megváltozott attribútum szerint kell azonosítani a változás ellenőrzésével, mindaddig, amíg a küszöbértéket el nem érik. Az index változását kiváltó események: Diszkrét attribútumok esetén bármely, az attribútumban hónapról hónapra bekövetkező változás akként tekintendő, mint amely az indexben változást eredményez. Folytonos attribútumok esetén bármely, az attribútumban hónapról hónapra bekövetkező, 25 %-ot meghaladó változás akként tekintendő, mint amely indexváltozást eredményez. Alkalmazási kör: Ez a DQM-módszer alkalmazandó valamennyi befektetési alap befektetési jegye, valamint a tulajdonviszonyt és hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok esetében, beleértve azon certifikátokat (*certificates*) is, amelyek lejárata három hónapnál nem régebbi.	Az 1. cél felméri az állományi adatok stabilitását. A CSDB-attribútumok nem ellenőrzött változásai nem csökkentik a stabil adatok részarányát a DQM-küszöbértéken túl a Európai Számlák Rendszere (*European System of Accounts – ESA*) ([1]) alábbi egyes kibocsátó szektoraiban: — S.11 „nem pénzügyi vállalatok" (S.11 az ESA 95 szerint) — S.121 „a központi bank" (S.121 az ESA 95 szerint) — S.122 „betétgyűjtő vállalatok a központi bank kivételével" (S.122 az ESA 95 szerint) — S.123 „pénzpiaci alapok (*money market funds – MMF*)" (S.122 az ESA 95 szerint) — S.124 „nem pénzpiaci befektetési alapok" (S.123 az ESA 95 szerint) — S.125 „egyéb pénzügyi közvetítők, a biztosítóintézetek és a nyugdíjpénztárak kivételével" (S.123 az ESA 95 szerint) — S.126 „pénzügyi kiegészítő tevékenységet végző vállalatok" (S.124 az ESA 95 szerint) — S.127 „zárt pénzügyi vállalatok és pénzkölcsönzők" (S.123 az ESA 95 szerint) — S.128 „biztosítóintézetek (IC)" (S.125 az ESA 95 szerint) — S.129 „nyugdíjpénztárak (PF)" (S.125 az ESA95 szerint) — S.13 „kormányzat" (S.13 az ESA 95 szerint).	Explicit attribútumok: Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok esetén a kibocsátás és a lejárat dátuma, névleges pénznem, ár mértéke, ESA-instrumentumosztályozás, a kibocsátó rezidens országa, a kibocsátó ESA-szektora, a kibocsátó Gazdasági Tevékenységek Európai Osztályozása (NACE) szerinti besorolása, forgalomban lévő állomány, tőzsdén jegyzett részvények esetében a forgalomban lévő részvények.	Forgalomban lévő állomány vagy piaci tőkeérték euróban, az állományi adatok részeként meghatározva.

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
2. cél: **Adatpontosság – új kibocsátások és visszaváltások; nettó kibocsátások**	Koncepció: A módszer minden egyes rezidens ország/szektor kombináció tekintetében meghatározásra kerül, és lefedi az új kibocsátásokat, a visszaváltásokat és a százalékban jegyzett hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok forgalomban lévő állományát. A módszer összeköti a hónap folyamán lezajlott nettó kibocsátási tevékenységet az előző hónap végén fennálló forgalomban lévő állománnyal (százalékbeli változás), és figyelemmel kíséri az állományok relatív fejlődését. Lehetőség van az egyedi új kibocsátások és visszaváltások szintjére vonatkozó, azon tételes adatokhoz történő hozzáférésre, amelyek a forgalomban lévő állományban történő változást eredményezték. Ezeket az eseményeket addig kell ellenőrizni, amíg a küszöbértéket el nem elérik.	A 2. cél az új kibocsátásokat és visszaváltásokat az érintett állományi adattal szemben értékeli. A százalékban jegyzett hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok új kibocsátásokkal és visszaváltásokkal kapcsolatos forgalomban lévő állományára vonatkozó, nem ellenőrzött adat nettó értelemben nem haladhatja meg a DQM-küszöbértéket a következő ESA-kibocsátói szektorok esetében: — S.11 „nem pénzügyi vállalatok” (S.11 az ESA 95 szerint) — S.121 „a központi bank” (S.121 az ESA 95 szerint) — S.122 „betétgyűjtő vállalatok a központi bank kivételével” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.123 „pénzpiaci alapok (MMF)” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.124 „nem pénzpiaci befektetési alapok” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.125 „egyéb pénzügyi közvetítők, a biztosítóintézetek és a nyugdíjpénztárak kivételével” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.126 „pénzügyi kiegészítő tevékenységet végző vállalatok” (S.124 az ESA 95 szerint) — S.127 „zárt pénzügyi vállalatok és pénzkölcsönzők” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.128 „biztosítóintézetek (IC)” (S.125 az ESA 95 szerint) — S.129 „nyugdíjpénztárak (PF)” (S.125 az ESA95 szerint) — S.13 „kormányzat” (S.13 az ESA 95 szerint).	Explicit attribútumok: Forgalomban lévő állomány. Implicit attribútumok: Kibocsátás dátuma, lejárat dátuma, névleges pénznem, ár mértéke, ESA-instrumentumosztályozás, a kibocsátó rezidens országa, a kibocsátó ESA-szektora.	Forgalomban lévő állomány euróban, az érintett állományi adathoz viszonyítottan relatív növekményként kifejezve.

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
3a. cél: **Adatpontosság – támogatja a kibocsátók megfelelő szektorbesorolását és az adatkinyerést**	A koncepció háttere: A CSBD összeköti a kibocsátóra és az instrumentumra vonatkozó adatokat az „egyet a többhöz” elvként jellemezhető kapcsolódási alapon, azaz egy kibocsátó több instrumentumhoz is hozzákapcsolható, míg egy instrumentum csak egy kibocsátóhoz kapcsolódik. Az instrumentum és a kibocsátó közötti kapcsolatot a különböző beviteliadat-szolgáltatóktól származó egyedi kibocsátóazonosítókkal hozzák létre. Ezek az azonosítók adatszolgáltatónként eltérőek, mivel egyelőre nem áll rendelkezésre egységes szabvány, azonban az azonosítóknak következetesnek kell lenniük. Amennyiben a beviteliadat-szolgáltatók ellentmondásos (eltérő) kibocsátóazonosítókat szolgáltatnak egy azonos instrumentum vonatkozásában, azaz amennyiben nincs köztük egyetértés a kibocsátó vonatkozásában, az eszközt nem lehet egy meghatározott kibocsátóhoz rendelni és az az „ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjába” (*clash-group*) kerül besorolásra. Lehetőség van az ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjainak megfelelő besorolására ország és szektor szerint, de nem áll fenn következetes kapcsolat az instrumentum érintett kibocsátójával. Az ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjaiban lévő eszközök megakadályozzák az egy adott kibocsátó által kibocsátott valamennyi instrumentum következetes és megbízható kinyerését. Az ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjaiban szereplő instrumentumok növelik a rezidens ország vagy a szektor szerinti téves besorolás veszélyét. Koncepció: A módszer valamennyi rezidens ország vonatkozásában azonosítja az ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjaiban lévő instrumentumokat, és azokat a darabszám vagy a pénzmennyiség százalékos arányában az adott országhoz tartozó valamennyi instrumentumhoz kapcsolja. Alkalmazási kör: A módszer a CSDB-ben található valamennyi instrumentumra vonatkozik.	A 3a. cél a kibocsátók állománya azonosításának helyességét értékeli. Ha egy instrumentum kibocsátójának vonatkozásában ellentmondás áll fenn, azaz az „ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjaiban” instrumentumok szerepelnek, az ilyen instrumentumok nem haladhatják meg a DQM-küszöbértéket.	Explicit attribútumok: A csoportosításhoz használt kibocsátóazonosító.	Forgalomban lévő állomány euróban az ellentmondásos azonosítóval rendelkező instrumentumok csoportjaiban szereplő instrumentumok vonatkozásában, valamennyi instrumentum százalékos arányában kifejezve.

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
3b. cél: **Adatpontosság – támogatja a kibocsátók megfelelő szektorbesorolását és az adatkinyerést**	A koncepció háttere: A CSBD összeköti a kibocsátóra és az instrumentumra vonatkozó adatokat az „egyet a többhöz” elvként jellemezhető kapcsolódási alapon, azaz egy kibocsátó több instrumentumhoz is hozzákapcsolható, míg egy instrumentum csak egy kibocsátóhoz kapcsolódik. Az instrumentum és a kibocsátó közötti kapcsolatot a különböző beviteliadat-szolgáltatóktól származó egyedi kibocsátóazonosítók révén jön létre. Ezek az azonosítók adatszolgáltatónként eltérőek, mivel egyelőre nem áll rendelkezésre egységes szabvány, azonban az azonosítóknak következetesnek kell lenniük. Amennyiben egyetlen adatszolgáltató sem szolgáltat egy adott instrumentum vonatkozásában a kibocsátóra vonatkozó kibocsátóazonosítót, úgy fennáll annak a kockázata, hogy az adott instrumentum nem kerül egy meghatározott kibocsátóhoz besorolásra, hanem az az „azonosító nélküli instrumentumok csoportjába (*stand-alone group*) kerül besorolásra, amely mindössze ebből az instrumentumból áll. Lehetőség van az azonosító nélküli instrumentumok csoportjainak ország és szektor szerinti megfelelő besorolására, de nem áll fenn következetes kapcsolat az instrumentum kibocsátójával. Az azonosító nélküli instrumentumok csoportjaiban lévő instrumentumok megakadályozzák az egy adott kibocsátó által kibocsátott valamennyi instrumentum következetes és megbízható kinyerését. Az azonosító nélküli instrumentumok csoportjaiban szereplő instrumentumok növelik a rezidens ország vagy szektor szerinti téves besorolás veszélyét, tekintettel arra, hogy azokat gyakorta hiányos adatokkal együtt szolgáltatják. Koncepció: A módszer valamennyi rezidens ország vonatkozásában azonosítja az azonosító nélküli instrumentumok csoportjaiban lévő instrumentumokat, és azokat a darabszám vagy a monetáris összeg százalékos arányában az adott országhoz tartozó valamennyi instrumentumhoz kapcsolja.	A 3b. cél a kibocsátók állománya azonosításának helyességét értékeli. Ha egy instrumentum kibocsátójának vonatkozásában nem áll rendelkezésre megbízható információ, azaz az „azonosító nélküli instrumentumok csoportjaiban” instrumentumok szerepelnek, az ilyen instrumentumok nem haladhatják meg a DQM-küszöbértéket.	Explicit attribútumok: A csoportosításhoz használt kibocsátóazonosító.	Forgalomban lévő állomány euróban az azonosító nélküli instrumentumok csoportjaiban szereplő instrumentumok vonatkozásában, valamennyi instrumentum százalékos arányában kifejezve.

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
	Alkalmazási kör: A módszer a CSDB-ben található valamennyi instrumentumra vonatkozik.			
4. cél: **Adatpontosság – a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok – beleértve a certifikátokat is – forgalomban lévő állománya**	Koncepció: A módszer összesíti a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok – beleértve a certifikátokat is – forgalomban lévő állományát az egyes kibocsátók rezidens országa, valamint kibocsátó szektora szerint az értékpapír-kibocsátási statisztikákban (*Securities Issues Statistics – SEC*) meghatározott koncepció alapján. Ezt az összesítést a vonatkozó SEC-adathoz kell hasonlítani és a CSDB-adat százalékos eltérését kell kiszámítani. A nem ellenőrzött és a meg nem magyarázott eltérések nem haladhatják meg a DQM-küszöbértéket.	A 4. cél a CSDB-kimeneti adatokat a külső referenciaadatokhoz viszonyítja. Az aggregált CSDB-adatok, az EKB SEC-től származó vonatkozó adatok, illetve az egyéb megbízható referenciaadatok közötti nem ellenőrzött és meg nem magyarázott eltérések – az ilyen referenciaadatok rendelkezésre állásának függvényében – nem haladhatják meg az azonos referencia-időszakra vonatkozó DQM-küszöbértékeket a következő ESA-kibocsátó szektoroknál: — S.11 „nem pénzügyi vállalatok” (S.11 az ESA 95 szerint) — S.121 „a központi bank” (S.121 az ESA 95 szerint) — S.122 „betétgyűjtő vállalatok a központi bank kivételével” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.123 „pénzpiaci alapok (MMF)” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.124 „nem pénzpiaci befektetési alapok” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.125 „egyéb pénzügyi közvetítők, a biztosítóintézetek és a nyugdíjpénztárak kivételével” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.126 „pénzügyi kiegészítő tevékenységet végző vállalatok” (S.124 az ESA 95 szerint) — S.127 „zárt pénzügyi vállalatok és pénzkölcsönzők” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.128 „biztosítóintézetek (IC)” (S.125 az ESA 95 szerint) — S.129 „nyugdíjpénztárak (PF)” (S.125 az ESA95 szerint) — S.13 „kormányzat” (S.13 az ESA 95 szerint).	Explicit attribútumok: Forgalomban lévő állomány euróban, piaci tőkeérték euróban. Implicit attribútumok: Kibocsátás dátuma, lejárat dátuma, denomináció, a kibocsátó ESA-szektora, a kibocsátó rezidens országa.	Forgalomban lévő állomány vagy piaci tőkeérték euróban, a CSDB- és a külső referenciaadatok közötti százalékos különbségként kifejezve.

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
5. cél: **Adatpontosság – részvények piaci tőkeértéke**	Koncepció: A módszer összesíti a részvények piaci tőkeértékét az egyes kibocsátók rezidens országa, valamint a kibocsátó szektor szerint az értékpapír-kibocsátási statisztikákban meghatározott koncepció alapján. Ezt az összesítést a vonatkozó SEC-adathoz kell hasonlítani, és a CSDB-adat százalékos eltérését kell kiszámítani. A nem ellenőrzött és a meg nem magyarázott eltérések nem haladhatják meg a DQM-küszöbértéket.	A 5. cél a CSDB-kimeneti adatokat a külső referenciaadatokhoz viszonyítja. Az aggregált CSDB-adatok, az EKB SEC-től származó, illetve az egyéb megbízható referenciaadatok közötti nem ellenőrzött és meg nem magyarázott eltérések – az ilyen referenciaadatok rendelkezésre állásának függvényében – nem haladhatják meg a DQM-küszöbértékeket a következő ESA kibocsátó szektorok vonatkozásában: — S.11 „nem pénzügyi vállalatok” (S.11 az ESA 95 szerint) — S.121 „a központi bank” (S.121 az ESA 95 szerint) — S.122 „betétgyűjtő vállalatok a központi bank kivételével” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.123 „pénzpiaci alapok (MMF)” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.124 „nem pénzpiaci befektetési alapok” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.125 „egyéb pénzügyi közvetítők, a biztosítóintézetek és a nyugdíjpénztárak kivételével” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.126 „pénzügyi kiegészítő tevékenységet végző vállalatok” (S.124 az ESA 95 szerint) — S.127 „zárt pénzügyi vállalatok és pénzkölcsönzők” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.128 „biztosítóintézetek (IC)” (S.125 az ESA 95 szerint) — S.129 „nyugdíjpénztárak (PF)” (S.125 az ESA95 szerint) — S.13 „kormányzat” (S.13 az ESA 95 szerint).	Explicit attribútumok: Forgalomban lévő állomány euróban, a jegyzett részvények vonatkozásában a forgalomban lévő részvények darabszáma. Implicit attribútumok: Névleges pénznem, a kibocsátó ESA-szektora, a jegyzett részvények árértéke (csak a kiugró értékek ellenőrzése).	Forgalomban lévő állomány vagy piaci tőkeérték euróban, CSDB- és a külső referenciaadatok közötti százalékos különbségként kifejezve.

DQM-cél	DQM-módszerek	Végrehajtás	Kimenetiadatkör- attribútumok	A DQM-küszöbérték alapja
6. cél: **Adatpontosság – a kibocsátó osztályozása**	Koncepció: A módszer a kibocsátókat a kibocsátó rezidens országa/kibocsátó szektora szerinti kombinációban rangsorolja, a teljes értékpapír-alapú kötelezettségeik alapján (tulajdonviszonyt és hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok együttesen). A módszer a különböző kibocsátók besorolásában bekövetkező abszolút változásokat is mutatja annak érdekében, hogy elősegítse a kiugró értékek azonosítását a forgalomban lévő állomány vagy a piaci tőkeérték azonosítását. A kibocsátó rezidens országát és szektor besorolását a DQM-küszöbérték elérésig kell ellenőrizni. Alkalmazási kör: A módszer alkalmazandó valamennyi olyan befektetési alap befektetési jegy, valamint a tulajdonviszonyt és hitelviszonyt megtestesítő értékpapír esetében, amelyek lejárata három hónapnál nem régebbi.	Az 6. cél felméri a kibocsátók statisztikai osztályozását. A kibocsátók megfelelő statisztikai osztályozását valamennyi alábbi ESA-kibocsátó szektor vonatkozásában a DQM-küszöbérték eléréséig kell ellenőrizni. — S.11 „nem pénzügyi vállalatok” (S.11 az ESA 95 szerint) — S.121 „a központi bank” (S.121 az ESA 95 szerint) — S.122 „betétgyűjtő vállalatok a központi bank kivételével” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.123 „pénzpiaci alapok (MMF)” (S.122 az ESA 95 szerint) — S.124 „nem pénzpiaci befektetési alapok” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.125 „egyéb pénzügyi közvetítők, a biztosítóintézetek és a nyugdíjpénztárak kivételével” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.126 „pénzügyi kiegészítő tevékenységet végző vállalatok” (S.124 az ESA 95 szerint) — S.127 „zárt pénzügyi vállalatok és pénzkölcsönzők” (S.123 az ESA 95 szerint) — S.128 „biztosítóintézetek (IC)” (S.125 az ESA 95 szerint) — S.129 „nyugdíjpénztárak (PF)” (S.125 az ESA95 szerint) — S.13 „kormányzat” (S.13 az ESA 95 szerint).	A kibocsátó ESA-szektora és rezidens országa.	Forgalomban lévő állomány vagy piaci tőkeérték euróban, „kapitalizációként”-ként kifejezve, azaz a forgalomban lévő állomány plusz a piaci tőkeérték kibocsátónként.

([1]) A kategóriák számozása tükrözi az Európai Unióban a nemzeti és regionális számlák európai rendszeréről szóló európai parlamenti és tanácsi rendeletre irányuló javaslat (COM(2010) 774 végleges) által bevezetett számozást.

II. MELLÉKLET

AZ ADATMINŐSÉG-KEZELÉSI KERETRENDSZERBE TARTOZÓ ÁLLOMÁNYOK ÉS KIMENETIADATKÖR-ATTRIBÚTUMOK

Az adatminőség-kezelési keretrendszerbe az alábbi, különböző célokat szolgáló állományok tartoznak:

— Külfölddel kapcsolatos statisztikákat támogató állomány (EXT 1.0)

— Speciális pénzügyi közvetítő vállalatokra vonatkozó állomány, amely a speciális pénzügyi közvetítő vállalatokkal kapcsolatos statisztikákat támogatja (FVC 1.0)

— Befektetési alapokkal kapcsolatos, a befektetési alapokra vonatkozó statisztikákat támogató állomány (IF 1.0)

— Értékpapír-állományokkal kapcsolatos, az értékpapír-állományokra vonatkozó statisztikákat támogató állomány (SHS 1.0)

— Az állam értékpapírokkal történő finanszírozásával kapcsolatos, az állam értékpapírokkal történő finanszírozására vonatkozó statisztikákat támogató állomány (GSF 1.0)

A támogatott állományokat alkotó kimenetiadatkör-attribútumok:

A kimenetiadatkör-attribútum neve	Leírás	Alkalmazandó állomány				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (Értékpapírok Nemzetközi Azonosító Száma [ISIN])	ISIN értékpapír-azonosító.	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (Az instrumentum Számlák Európai Rendszere [ESA] szerinti osztályozása)	Az értékpapír ESA szerinti besorolása.	√	√	√	√	√
Debt type (Értékpapírtípus)	A hitelviszonyt megtestesítő értékpapír típusa.				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Ez az attribútum azon értékpapírok azonosítására használható, amelyeknek az „aktuális forgalomban lévő állományban" szerepelniük kell, összhangban az EKB SEC-ben foglalt fogalommeghatározásokkal.					√
Instrument supplementary class (Kiegészítő instrumentumosztály)	Kiegészítő attribútum, amely lehetővé teszi annak azonosítását, hogy egy instrumentumot fel kell-e venni a SEC-be, vagy sem. Ez az attribútum az alábbi értékeket mutathatja: 1 = „kamatszelvény *(coupon strip)*", 2 = „tőkeszelvény *(principal strip)*" stb.					√
Security status (Az értékpapír állapota)	Kiegészítő attribútum, amely lehetővé teszi annak azonosítását, hogy egy instrumentumot fel kell-e venni a SEC-be, vagy sem. Ez az attribútum azonosítani tudja azt, hogy egy instrumentum lejárt-e már vagy sem.					√
Asset securitisation type (A biztosíték típusa)	A biztosítékként szolgáló eszköz típusa.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Olyan attribútum, amely azt mutatja, hogy az adott instrumentum felajánlható-e fedezetként az eurorendszer hitelműveleteiben.				√	
Nominal currency (Névleges pénznem)	Az instrumentum névleges pénzneme (Nemzetközi Szabványügyi Szervezet [ISO] 4217).	√	√	√	√	√

A kimenetiadatkör-attribútum neve	Leírás	Alkalmazandó állomány				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (Kibocsátás időpontja)	Az az időpont, amikor a kibocsátó az értékpapírokat fizetés ellenében azok jegyzőjének rendelkezésre bocsátja. Ez az az időpont, amikor az értékpapírok a befektetők részére történő leszállításra első ízben állnak rendelkezésre. *Megjegyzés:* Egy szelvény *(strip)* esetében ez az oszlop azt az időpontot mutatja, amikor a kamat/tőkeszelvényt leválasztották.	√	√	√	√	√
Maturity date (Lejárat időpontja)	Az az időpont, amikor a hitelviszonyt megtestesítő értékpapírt ténylegesen visszaváltják.	√	√	√	√	√
Residual maturity (Hátralévő futamidő)	Egy instrumentum hátralévő futamideje, az adatok feldolgozásának napján.					√
Issuer domicile country (A kibocsátó rezidens országa)	Az értékpapír kibocsátójának bejegyzés (székhely) szerinti országa (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (Kibocsátó ESA-szektor)	Az értékpapír kibocsátójának intézményi szektora az ESA-besorolás szerint.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (A kibocsátó Gazdasági Tevékenységek Európai Osztályozása [NACE] szerinti besorolása)	A NACE szerinti fő gazdasági tevékenység.	√				
Amount issued (Kibocsátott mennyiség)	A hitelviszonyt megtestesítő értékpapír azon összege, amely a kibocsátáskor elkelt (névérték). Egy szelvény *(strip)* esetében ez az oszlop azt az időpontot mutatja, amikor a kamat/tőkeszelvényt leválasztották. Egy sorozatban kibocsátott értékpapír esetén ez az oszlop egy ISIN-kód alatt mutatja az eddigi kibocsátások halmozott összegét. A kibocsátott mennyiség névleges pénznemben denominálva.					√
Amount outstanding (Forgalomban lévő állomány)	A forgalomban lévő állomány névértéken. Egy sorozatban kibocsátott értékpapír esetén ez az oszlop egy ISIN-kód alatt mutatja az eddigi kibocsátott mennyiségek halmozott összegét, a visszaváltásokat nettó értéken. Az értékek névleges pénznemben megadva. A forgalomban lévő állomány névleges pénznemben denominálva. Amennyiben a névleges pénznem nem ismert, a forgalomban lévő állomány euróban denominálva.	√			√	√
Amount outstanding in euro (Forgalomban lévő állomány euróban)	A forgalomban lévő állomány euróra átváltva a névleges pénznemre vonatkozó, a feldolgozás napján irányadó átváltási árfolyam alkalmazásával.				√	√
Market capitalisation (Piaci tőkeérték)	A rendelkezésre álló legutóbbi piaci tőkeérték. A piaci tőkeérték névleges pénznemben denominálva. Amennyiben a névleges pénznem nem ismert, a piaci tőkeérték euróban denominálva.				√	

A kimenetiadatkör-attribútum neve	Leírás	Alkalmazandó állomány				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Lejáratig számított hozam)	Értékpapír-specifikus, lejáratig számított hozam százalékban kifejezve.				√	√
Short name (Rövid név)	A kibocsátó által megadott rövid név, amely a kibocsátás jellemzőin és az egyéb rendelkezésre álló információkon alapul.					√
Pool factor (Pooltényező)	A jelzálog-fedezetű értékpapírok esetében a fennmaradó tőketartozást jelző pooltényező meghatározásához a jelzáloggal fedezett értékpapír aktuális tőketartozása elosztandó az eredeti fennálló tőketartozás összegével.	√	√	√	√	√
Quotation basis (Ár mértéke)	Az instrumentum árának mértéke, pl.: százalékban vagy az egy részvényre/egységre (egységekre) jutó devizában kifejezve.	√	√	√	√	√
Price value (Árérték)	Az értékpapír legutolsó, a referenciaidőpontban rendelkezésre álló ára az ár mértékének megfelelően és adott esetben az értékpapír névleges pénznemében kifejezve. A kamatozó értékpapírok esetén nettó ár, azaz a felhalmozott kamat nélküli ár.	√	√	√	√	√
Price value type (Árérték típusa)	Az árérték jellege, azaz amennyiben az piaci értékelést, becsült vagy alapértelmezett értéket tartalmaz.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Havi átlagár)	Az instrumentum referenciadátumig terjedő legutóbbi 30 napban normalizált árának az átlaga, az ár mértékének megfelelően és adott esetben az instrumentum névleges pénznemében kifejezve.	√			√	
Redemption type (Visszaváltás típusa)	A visszaváltás típusa, pl.: lejáratkor fizető, lejárat nélküli, strukturált, járadékot fizető, sorozat, rendhagyó, kamat nélküli, lépcsőzetes.					√
Redemption frequency (Visszaváltás gyakorisága)	A hitelviszonyt megtestesítő értékpapír visszaváltásának évenkénti száma.					√
Redemption price (Visszaváltási ár)	Utolsó visszaváltási ár.					√
Accrued interest (Felhalmozott kamat)	Az utolsó kamatfizetés óta vagy az időbeli elhatárolás kezdeti időpontja óta felhalmozott kamat. A kamatozó értékpapírok esetében ennek az értéknek az árértékhez történő hozzáadása adja meg az úgynevezett „piszkos árat” *(dirty price)*.	√	√	√		√
Accrued income factor (Bevételek aktív időbeli elhatárolásának tényezője)	Értékpapír-specifikus, napi bevételi tényező százalékban kifejezve, a hitelezői megközelítés figyelembevételével számítva. A faktor időbeli elhatárolásokon alapul, azaz a felhalmozott kamaton és a kibocsátási és a visszaváltási ár közötti különbözetből származó jövedelem.	√	√	√	√	

A kimenetiadatkör-attribútum neve	Leírás	Alkalmazandó állomány				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Kamatozás típusa)	A kamatozás típusa, pl.: rögzített, változó, lépcsőzetes stb.				√	√
Last coupon rate (Utolsó kamatfizetés dátuma)	Az éves viszonylatban kifizetett utolsó kamatláb összege százalékában kifejezve (éves kamatláb).	√	√	√	√	
Last coupon date (Utolsó kamatfizetési időpont)	A kamatláb tényleges kifizetésének legutóbbi időpontja. Az attribútum lehetővé teszi annak azonosítását, hogy a kamatláb legutolsó tényleges kifizetésének időpontja az adatszolgáltatási időszakba esik vagy sem.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Utolsó kamatfizetési gyakoriság)	Évenkénti gyakoriság, amelyben a legutolsó kamatláb kifizetésre kerül. Az „éves” átalakul AN-é, a „féléves” pedig SA-vá.	√	√	√	√	
Dividend amount (Osztalék mennyisége)	A legutóbbi, egy részvényre kifizetett osztalék mennyisége (az osztalék mennyiségének típusában), adózás előtt (bruttó osztalék).	√		√	√	
Dividend amount type (Osztalék mennyiségének típusa)	Az egy részvényre jutó osztalék mennyisége pénznemben vagy a részvények darabszámában denominálható.	√		√	√	
Dividend currency (Osztalékfizetés pénzneme)	A legutolsó osztalékfizetés pénznemének ISO 4217 kódja.	√		√	√	
Dividend Settlement date (Osztalékelszámolási időpont)	A legutolsó osztalék kifizetésének elszámolási időpontja. Az attribútum lehetővé teszi annak azonosítását, hogy a kifizetett osztalékösszeg az adatszolgáltatási időszakba esik vagy sem.	√		√	√	
Last split factor (Legutolsó részvényfelosztási tényező)	A részvények felosztása és összevonása.	√		√	√	
Last split date (Legutolsó részvényfelosztási időpont)	Az az időpont, amellyel a részvényfelosztás hatályossá válik.	√		√	√	