GAIRĖS

EUROPOS CENTRINIO BANKO GAIRĖS

2012 m. rugsėjo 26 d.

dėl centrinės vertybinių popierių duomenų bazės duomenų kokybės valdymo sistemos

(ECB/2012/21)

(2012/689/ES)

EUROPOS CENTRINIO BANKO VALDANČIOJI TARYBA,

atsižvelgdama į Europos centrinių bankų sistemos ir Europos Centrinio Banko statutą, ypač į jo 5 straipsnio 1 dalį, 12 straipsnio 1 dalį ir 14 straipsnio 3 dalį,

atsižvelgdama į 1998 m. lapkričio 23 d. Tarybos reglamentą (EB) Nr. 2533/98 dėl Europos centrinio banko renkamos statistinės informacijos [1],

kadangi:

(1) centrinė vertybinių popierių duomenų bazė (CVPDB) yra bendra informacinių technologijų infrastruktūra, kurią kartu valdo Europos centrinių bankų sistemos (ECBS) nariai, įskaitant CVPDB valdyme savanoriškai dalyvaujančius ne euro zonos valstybių narių nacionalinius centrinius bankus (NCB). CVPDB saugomi duomenys apie kiekvieną elementą atskirai, pirmiausia duomenys apie vertybinius popierius, jų emitentus ir kainas;

(2) duomenys renkami iš įvairių šaltinių, taip pat iš ECBS narių, tam tikrų komercinių duomenų teikėjų, viešosios srities ir administracinių šaltinių bei perduodami į CVPDB. Tačiau yra rizika, kad tokie pradiniai duomenys gali būti netikslūs arba neišsamūs. CVPDB sistema parengta suderinti dalinai prieštaraujančius skirtingų šaltinių pradinius duomenis ir gali aptikti neišsamius arba trūkstamus duomenis. Ji automatiškai kiek įmanoma didesne apimtimi sujungia pradinius duomenis iš įvairių persidengiančių šaltinių į išsamų ir aukštos kokybės bendrą įrašą;

(3) bendra CVPDB duomenų kokybė gali būti įvertinta tik išvedimo duomenų lygiu, o ne atskirų pradinių duomenų rinkinių lygiu. Kad kiek įmanoma labiau būtų užtikrintas išvedimo duomenų išsamumas, tikslumas ir nuoseklumas, būtina apibrėžti duomenų kokybės valdymo (DKV) sistemą, taikytiną atnaujintiems išvedimo duomenims, išvedimo duomenų porinkiniui, kurį galima naudoti rengiant statistiką arba kitais tikslais. Atnaujinti išvedimo duomenys pateikiami NCB ne vėliau kaip per septynias darbo dienas po kiekvieno kalendorinio mėnesio pabaigos;

(4) kai kurie atnaujinti išvedimo duomenys taip pat apima tokius požymius kaip kainos arba su pajamomis susijusi informacija, kurie laikui bėgant gali keistis. Šie požymiai CVPDB sistemoje patikrinami automatiškai, taikant statistinius algoritmus. Kompetentingos institucijos pagal šias gaires tikrina tik I priede kiekvienam DKV tikslui nurodytus požymius. Išsamus požymių, iš kurių susideda palaikomi srautai, sąrašas išdėstytas II priede;

(5) CVPDB DKV sistema turėtų būti taikoma atnaujintiems išvedimo duomenims, neatsižvelgiant į pradinių duomenų šaltinį. Ji turėtų numatyti euro zonos NCB, ir, jei reikia, Europos Centrinio Banko (ECB) atsakomybę dėl išvedimo duomenų kokybės CVPDB;

(6) CVPDB DKV sistema turėtų būti pagrįsta, pirma, DKV tikslais, kurie yra rodikliai vertinant atnaujintus išvedimo duomenis, ir, antra, DKV metrika, kuri kiekvienam atitinkamam DKV tikslui identifikuoja atnaujintus išvedimo duomenis, kurie turi būti patikrinti, ir nustato jų pirmenybę. Ji taip pat turėtų būti pagrįsta DKV ribomis, kurios nustato minimalius patikrinimo, kurį reikia atlikti atsižvelgiant į DKV tikslą, lygius;

(7) kadangi nėra orientacinių duomenų, DKV tikslai atnaujintuose išvedimo duomenyse ne visada randa klaidas, bet tik gali nustatyti atvejus, kai atnaujintus išvedimo duomenis reikia patikrinti rankiniu būdu;

(8) kadangi CVPDB kartu valdo visi ECBS nariai, jie visi turėtų siekti laikytis tų pačių DKV standartų. Be to, ne euro zonos NCB patogiausia atlikti su jų atitinkamose valstybėse narėse reziduojančiais emitentais susijusių

[1] OL L 318, 1998 11 27, p. 8.

duomenų DKV. Nors pripažinta, kad ECB priimtos gairės negali nustatyti jokių pareigų ne euro zonos NCB, Europos centrinių bankų sistemos ir Europos Centrinio Banko statuto 5 straipsnis taikomas euro zonos ir ne euro zonos NCB. Todėl ne euro zonos NCB turėtų sukurti ir įgyvendinti visas priemones, kurias jie laiko tinkamomis siekiant vykdyti DKV pagal šias gaires;

(9) kad būtų pagerinta išvedimo duomenų kokybė, turėtų būti vykdomas duomenų šaltinio valdymas (DŠV), siekiant nustatyti ir ištaisyti pasikartojančias ir struktūrines klaidas pradiniuose duomenyse tiesiogiai su duomenų teikėju,

PRIĖMĖ ŠIAS GAIRES:

1 straipsnis

Apibrėžtys

Šiose gairėse:

1. CVPDB – ECBS įdiegta ECB patalpose esanti centrinė vertybinių popierių duomenų bazė;

2. pradiniai duomenys – iš vieno arba daugiau duomenų šaltinių į CVPDB pateikti duomenys;

3. išvedimo duomenys – duomenys, kurie automatiškai išvedami CVPDB sujungiant pradinius duomenis į išsamų, aukštos kokybės bendrą įrašą;

4. atnaujinti išvedimo duomenys – išvedimo duomenų porinkinis ir II priede išvardytos savybės, naudojamos kaip duomenų įnašas rengiant statistiką arba kitais tikslais;

5. duomenų kokybės valdymas arba DKV – atnaujintų išvedimo duomenų kokybės užtikrinimas, tikrinimas ir palaikymas naudojant ir taikant DKV tikslus, DKV metriką, DKV ribas ir DKV procesą;

6. duomenų šaltinio valdymas arba DŠV – pasikartojančių ir (arba) struktūrinių klaidų pradiniuose duomenyse radimas ir ištaisymas tiesiogiai su duomenų teikėju;

7. pradinis DKV – atnaujintų išvedimo duomenų, įskaitant naujausio laikotarpio duomenis, DKV, kurį kas mėnesį vykdo kompetentingos DKV institucijos, atsižvelgdamos į mėnesio pabaigos peržiūrai pateiktus atnaujintus išvedimo duomenis;

8. reguliarus DKV – atnaujintų išvedimo duomenų DKV, kurį kas mėnesį vykdo kompetentingos DKV institucijos, atsižvelgdamos į įvairių šaltinių pateiktus ne CVPDB orientacinius duomenis, kad būtų užtikrinta, jog CVPDB išvedimo duomenų kokybė atitinka CVPDB atnaujintų duomenų reikalavimus;

9. DKV tikslas – I priede pateiktos atnaujintų išvedimo duomenų kokybės vertinimo gairės;

10. DKV metrika – I priede pateiktas statistinis rodiklis, matuojantis tam tikro DKV tikslo pasiektą lygį;

11. DKV riba – minimalus patikrinimo lygis, būtinas, kad būtų išpildyti DKV sistemos reikalavimai DKV tikslui;

12. DKV procesas – pradiniams duomenims ištaisyti taikomas techninis procesas, kad būtų patenkinti reikalavimai DKV ribai;

13. mėnesio pabaigos peržiūra – reguliarus mėnesinis išvedimo duomenų ir DKV metrikos atnaujinimas, kurį atliekant gaunama išvedimo duomenų aproksimacija ateinančios mėnesio pabaigos statusui;

14. darbo diena – visa diena, kai veikia TARGET2, kaip nurodyta ECB interneto svetainėje;

15. patikrinimas – procesas, kai kompetentingos DKV institucijos patikrina CVPDB atnaujintus išvedimo duomenis ir, prireikus, taikydamos DKV procesą, ištaiso CVPDB pradinius duomenis;

16. rezidentas – turi tokią pat reikšmę, kaip apibrėžta Reglamento (EB) Nr. 2533/98 1 straipsnyje.

2 straipsnis

Dalykas ir taikymo sritis

1. Šiomis gairėmis CVPDB sukuriama DKV sistema, kurios tikslas yra užtikrinti išvedimo duomenų CVPDB išsamumą, tikslumą ir nuoseklumą sistemingai taikant kokybės standartų tokiems duomenims taisykles.

2. CVPDB DKV sistema pagrįsta DKV ir DŠV.

3 straipsnis

Kompetentingos DKV institucijos

1. Euro zonos valstybės narės, kurioje reziduoja vertybinių popierių emitentas, NCB atsako už duomenų, susijusių su tuo emitentu, DKV.

2. Jei ne euro zonos NCB neprisiima atsakomybės vykdyti duomenų, susijusių su jo valstybėje narėje reziduojančiais emitentais, DKV, ECB atsako už duomenų, susijusių su ne euro zonoje reziduojančiais emitentais, DKV.

4 straipsnis

DKV, DKV metrika ir DKV ribos

1. Kompetentingos DKV institucijos vykdo pradinį DKV ir reguliarų DKV. Tuo metu, neatsižvelgdamos į tai, kas yra atnaujintų išvedimo duomenų šaltinis, juos tikrina.

2. Kompetentingos DKV institucijos taiko DKV metriką vadovaudamosi I priedu.

3. Kompetentingos DKV institucijos I priede nurodytiems požymiams taiko DKV ribas tokiu lygiu, kuris užtikrina atnaujintų išvedimo duomenų kokybę pagal II priede nurodytus reikalavimus palaikyti šių atitinkamų požymių naudojimą.

5 straipsnis

Pradinis DKV

1. Pradinis DKV taikomas 1, 2, 3a, 3b ir 6 DKV tikslams, kaip nurodyta I priede.

2. ECB pateikia susipažinti mėnesio pabaigos peržiūrą likus septynioms dienoms iki kiekvieno kalendorinio mėnesio pabaigos.

3. Kompetentingos DKV institucijos, vykdydamos pradinį DKV, patikrina pagrindinius statistiškai atmestinus rezultatus, kad užtikrintų, jog atlikus pradinį DKV, atnaujinti išvedimo duomenys kiek įmanoma atspindi naujausius pokyčius.

4. Kompetentingos DKV institucijos iki kito kalendorinio mėnesio antros darbo dienos pabaigos patikrina mėnesio pabaigos peržiūros duomenis tokia apimtimi, kiek, remiantis DKV metrika, nepasiektos DKV ribos.

5. Kai nėra ne CVPDB orientacinių duomenų, vykdant pradinį DKV remiamasi tik informacija, kuri jau prieinama kompetentingai DKV institucijai arba kurią galima lengvai gauti nereikalaujant teikti naujų statistinių duomenų.

6. Kompetentingos DKV institucijos pradinius duomenis ištaiso pagal DKV procesą, naudodamos CVPDB sistemą arba, atitinkamai, teikdamos pradinių duomenų bylas ECB.

6 straipsnis

Reguliarus DKV

1. Reguliarus DKV taikomas 3a, 3b, 4, 5 ir 6 DKV tikslams, kaip nurodyta I priede.

2. Kompetentingos DKV institucijos reguliarų DKV atlieka per vieną mėnesį po kiekvieno kalendorinio mėnesio pabaigos. Jos patikrina atnaujintus išvedimo duomenis, atsižvelgdamos į visą tuo metu turimą informaciją, ne vėliau kaip iki kalendorinio mėnesio, einančio po mėnesio, kurį buvo atliktas reguliarus DKV, antros darbo dienos.

3. Kompetentingos DKV institucijos ištaiso pradinius duomenis pagal suderintą DKV procesą naudodamos CVPDB sistemą arba, atitinkamai, teikdamos pradinių duomenų bylas ECB.

7 straipsnis

Su DŠV susiję uždaviniai

1. Kompetentingos DKV institucijos nustato DŠV problemas ir apie jas praneša ECB.

2. ECB bendradarbiaudamas su atitinkamomis kompetentingomis DKV institucijomis randa būdus, kaip užkirsti kelią pasikartojančioms didelio prioriteto DŠV klaidoms per vieną mėnesį nuo dienos, kai ECB buvo pranešta apie DŠV problemą.

8 straipsnis

Pradinių duomenų ištaisymai

Kompetentinga DKV institucija, patobulinusi pradinius duomenis, naudoja CVPDB sistemą pradinių duomenų, kurie nebuvo pataisyti per 5 straipsnio 4 dalyje nurodytą patikrinimą, klaidoms ir praleidimams ištaisyti.

9 straipsnis

Metinis pranešimas apie kokybę

Atsižvelgdama į ECBS statistikos komiteto nuomonę, ECB vykdomoji valdyba kasmet teikia Valdančiajai tarybai pranešimą apie atnaujintų išvedimo duomenų kokybę.

10 straipsnis

Supaprastinta dalinių pakeitimų tvarka

Atsižvelgdama į ECBS statistikos komiteto nuomonę, ECB vykdomoji valdyba turi teisę padaryti šių gairių priedų techninius dalinius pakeitimus, jeigu tokie daliniai pakeitimai nepakeičia esminio konceptualaus gairių pagrindo, įskaitant pareigų tarp ECB ir NCB padalijimą, ir nedaro didelio poveikio kompetentingų DKV institucijų atskaitomybės naštai. Vykdomoji valdyba apie visus tokius dalinius pakeitimus nedelsdama praneša Valdančiajai tarybai.

11 straipsnis

Įsigaliojimas

1. Šios gairės įsigalioja 2012 m. lapkričio 1 d.

2. Šios gairės taikomos nuo 2013 m. liepos 1 d.

12 straipsnis

Adresatai

Šios gairės skirtos visiems Eurosistemos centriniams bankams.

Priimta Frankfurte prie Maino 2012 m. rugsėjo 26 d.

ECB valdančiosios tarybos vardu
ECB pirmininkas
Mario DRAGHI

I PRIEDAS

DKV TIKSLAI, ĮGYVENDINIMAS, POŽYMIAI IR DKV RIBŲ PAGRINDAS

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
1 tikslas: **Duomenų stabilumas – likučių duomenys**	Koncepcija: Metrika kiekvienam rezidavimo šalies ir (arba) sektoriaus deriniui apibrėžiama kaip svertinis pokyčio indeksas pagal apimtį, matuojamas pinigų sumomis. Indekso vertė, lygi 1, rodo, kad atitinkamas požymis susijusiems vertybiniams popieriams nepasikeitė, o indekso vertė, lygi 0, rodo, kad atitinkamas požymis pasikeitė visiems vertybiniams popieriams. Jei indeksas nukrenta žemiau 1, kad būtų patikrintas pokytis, kol bus pasiekta riba, identifikuojami atskiri vertybiniai popieriai su pakitusiu požymiu, kuris lėmė indekso smukimą. Indekso pokytį sukeliantys įvykiai: Laikoma, kad bet koks diskrečiųjų požymių mėnesinis skirtumas sukelia indekso pokytį. Laikoma, kad bet koks nuolatinių požymių mėnesinis skirtumas, didesnis nei 25 %, sukelia indekso pokytį. Aprėptis: Ši DKV metrika apima visas investicinių fondų akcijas, nuosavybės priemones ir skolos vertybinius popierius, taip pat sertifikatus, kurių termino pabaigos diena (*maturity date*) ne vėliau kaip už trijų mėnesių.	1 tikslas įvertina likučių duomenų stabilumą. Nepatikrinti CVPDB požymių pokyčiai nesumažina stabilių duomenų dalies žemiau DKV ribos nei vienam iš šių Europos sąskaitų sistemos (ESS) [1] emitentų sektorių: — S.11 „ne finansų bendrovės“ (S.11 pagal ESS 95) — S.121 „centrinis bankas“(S.121 pagal ESS 95) — S.122 „indėlius priimančios bendrovės, išskyrus centrinį banką“ (S.122 pagal ESS 95) — S.123 „pinigų rinkos fondai (PRF)“ (S.122 pagal ESS 95) — S.124 „investiciniai fondai, išskyrus PRF“ (S.123 pagal ESS 95) — S.125 „kiti finansiniai tarpininkai, išskyrus draudimo bendroves ir pensijų fondus“ (S.123 pagal ESS 95) — S.126 „finansinės pagalbinės įmonės“ (S.124 pagal ESS 95) — S.127 „priklausomos finansų įstaigos ir pinigų skolintojai“ (S.123 pagal ESS 95) — S.128 „draudimo bendrovės (DB)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.129 „pensijų fondai (PF)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.13 „valdžios sektorius“ (S.13 pagal ESS 95).	Nurodyti požymiai: skolos emisijos diena (*issue date*), skolos termino pabaigos diena (*maturity date*), nominalioji valiuta (*nominal currency*), kotiravimo pagrindas (*quotation basis*), priemonės klasė pagal ESS (*Instrument ESA class*), emitento rezidavimo šalis, emitento sektorius pagal ESS (*issuer ESA sector*), emitento klasė pagal Europos ekonominės veiklos rūšių klasifikaciją (NACE) (*Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification*), neapmokėta suma (*amount outstanding*), neapmokėtų kotiruojamų akcijų kiekis.	Neapmokėtos sumos (*amounts outstanding*) arba rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) eurais, išreikšta kaip likučių duomenų dalis.

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
2 tikslas: **Duomenų tikslumas – naujos emisijos ir išpirkimai, grynosios emisijos**	Koncepcija: Metrika apibrėžiama kiekvienam rezidavimo šalies ir (arba) sektoriaus deriniui ir apima naujas emisijas, išpirkimus ir procentais išreikštas skolos vertybinių popierių neapmokėtas sumas. Metrika susieja mėnesio grynosios emisijos veiklą su praėjusio mėnesio pabaigos neapmokėta suma (procentinis pokytis) ir atlieka likusios skolos santykinio pokyčio stebėseną. Galima pažiūrėti išskaidytus duomenis iki atskirų naujų emisijų ir išpirkimų, lėmusių neapmokėtų sumų pokytį. Šie pokyčiai patikrinami, kol pasiekiama riba.	2 tikslas įvertina naujas emisijas ir išpirkimus atitinkamų likučių duomenų atžvilgiu. Nepatikrinti nurodyti procentais duomenys apie skolos vertybinių popierių naujų emisijų ir išpirkimų neapmokėtas sumas grynąja verte neviršija DKV ribos nei vienam iš šių ESS emitentų sektorių: — S.11 „ne finansų bendrovės“ (S.11 pagal ESS 95) — S.121 „centrinis bankas“(S.121 pagal ESS 95) — S.122 „indėlius priimančios bendrovės, išskyrus centrinį banką“ (S.122 pagal ESS 95) — S.123 „pinigų rinkos fondai (PRF)“ (S.122 pagal ESS 95) — S.124 „investiciniai fondai, išskyrus PRF“ (S.123 pagal ESS 95) — S.125 „kiti finansiniai tarpininkai, išskyrus draudimo bendroves ir pensijų fondus“ (S.123 pagal ESS 95) — S.126 „finansinės pagalbinės įmonės“ (S.124 pagal ESS 95) — S.127 „priklausomos finansų įstaigos ir pinigų skolintojai“ (S.123 pagal ESS 95) — S.128 „draudimo bendrovės (DB)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.129 „pensijų fondai (PF)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.13 „valdžios sektorius“ (S.13 pagal ESS 95).	Nurodyti požymiai: neapmokėta suma (*amount outstanding*). Numanomi požymiai: emisijos diena (*issue date*), termino pabaigos diena (*maturity date*), nominalioji valiuta (*nominal currency*), kotiravimo pagrindas (*quotation basis*), priemonės klasė pagal ESS (*instrument ESA class*), emitento rezidavimo šalis, emitento sektorius pagal ESS (*issuer ESA sector*).	Neapmokėtos sumos eurais (*amounts outstanding in euro*), išreikštos kaip santykinis pokytis palyginus su atitinkamais likučių duomenimis.

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
3a tikslas: **Duomenų tikslumas – teisingo priskyrimo sektoriui ir duomenų išvedimo pagal emitentą palaikymas**	Konceptualus pagrindimas: CVPDB susieja informaciją apie emitentą ir priemonę santykio pagrindu, kurį galima apibūdinti kaip „vienas su daugeliu“, t. y. vienas emitentas gali būti susietas su daug priemonių, o kiekviena priemonė – tik su vienu emitentu. Šis priemonės-emitento ryšys pateikiamas per įvairių pradinių duomenų teikėjų pateiktus atskiro emitento identifikatorius. Šie duomenų teikėjų identifikatoriai skiriasi, nes kol kas nėra bendro standarto, tačiau jie turėtų būti suderinti. Jei pradinių duomenų teikėjai pateikia nesuderintus (neatitinkančius) tos pačios priemonės emitento identifikatorius, t. y. jei nesutinkama, kas yra emitentas, priemonės negalima priskirti konkrečiam emitentui, todėl ji įrašoma į „neatitikimų grupę“. Neatitikimų grupės gali būti teisingai klasifikuojamos pagal šalį ir sektorių, tačiau neturi suderinto saito su atitinkamu priemonės emitentu. Dėl priemonių buvimo neatitikimų grupėse neįmanoma suderintai ir patikimai išvesti visų konkretaus emitento išleistų priemonių. Priemonių buvimas neatitikimų grupėse padidina riziką neteisingai suklasifikuoti pagal rezidavimo šalį arba sektorių. Koncepcija: Kiekvienai rezidavimo šaliai metrika nustato neatitikimų grupėse esančias priemones ir jas, kaip procentinę dalį, susieja su visų priemonių tai šaliai skaičiumi arba piniginėmis sumomis. Aprėptis: Metrika apima visas CVPDB priemones.	3a tikslas įvertina emitentų visumos nustatymo teisingumą. Jei nesutinkama, kas yra priemonės emitentas, t. y. yra priemonių neatitikimų grupėje, tokios priemonės neviršija DKV ribos.	Nurodyti požymiai: grupuojant vartojamas emitento identifikatorius.	Neapmokėtos sumos eurais (*amounts outstanding in euro*), susietos su priemonėmis neatitikimų grupėse, išreikštos kaip procentinė visų priemonių dalis.

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
3b tikslas: **Duomenų tikslumas – teisingo priskyrimo sektoriui ir duomenų išvedimo pagal emitentą palaikymas**	Konceptualus pagrindimas: CVPDB susieja informaciją apie emitentą ir priemonę santykio pagrindu, kurį galima apibūdinti kaip „vienas su daugeliu“, t. y. vienas emitentas gali būti susietas su daug priemonių, o kiekviena priemonė – tik su vienu emitentu. Šis priemonės-emitento saitas pateikiamas per įvairių pradinių duomenų teikėjų pateiktus atskiro emitento identifikatorius. Šie duomenų teikėjų identifikatoriai skiriasi, nes kol kas nėra bendro standarto, tačiau jie turėtų būti suderinti. Jei nei vienas duomenų teikėjas nepateikia konkrečios priemonės emitento identifikatorius, kyla rizika, kad priemonė nebus priskirta konkrečiam emitentui, todėl ji įrašoma į tik iš šios priemonės sudarytą „vienetinę grupę“. Vienetinės grupės gali būti teisingai klasifikuojamos pagal šalį ir sektorių, tačiau neturi suderinto saito su atitinkamu priemonės emitentu. Dėl priemonių buvimo vienetinėse grupėse neįmanoma suderintai ir patikimai išvesti visų konkretaus emitento išleistų priemonių. Priemonių buvimas vienetinėse grupėse padidina riziką neteisingai suklasifikuoti pagal rezidavimo šalį arba sektorių, nes jos dažnai nurodomos pateikiant neišsamią informaciją. Koncepcija: Kiekvienai rezidavimo šaliai metrika nustato vienetinėse grupėse esančias priemones ir jas, kaip procentinę dalį, susieja su visų priemonių tai šaliai skaičiumi arba piniginėmis sumomis.	3b tikslas įvertina emitentų visumos nustatymo teisingumą. Jei nėra patikimos informacijos, kas yra priemonės emitentas, t. y. yra priemonių vienetinėse grupėse, tokios priemonės neviršija DKV ribos.	Nurodyti požymiai: grupuojant vartojamas emitento identifikatorius.	Neapmokėtos sumos eurais (*amounts outstanding in euro*), susietos su priemonėmis vienetinėse grupėse, išreikštos kaip procentinė visų priemonių dalis.

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
	Aprėptis: Metrika apima visas CVPDB priemones.			
4 tikslas: **Duomenų tikslumas – skolos vertybinių popierių, įskaitant sertifikatus, neapmokėta suma (*amount outstanding*)**	Koncepcija: Laikantis vertybinių popierių emisijos statistikos (SEC) koncepcijos, metrika suveda neapmokėtas skolos vertybinių popierių, įskaitant sertifikatus, sumas pagal kiekvieno emitento rezidavimo šalį ir pagal emitento sektorių. Šie suvestiniai duomenys palyginami su atitinkamu SEC skaičiumi ir apskaičiuojamas CVPDB duomenų procentinis nuokrypis. Nepatikrinti ir nepaaiškinti skirtumai neviršija DKV ribos.	4 tikslas palygina CVPDB išvedimo duomenis su išoriniais orientaciniais duomenimis. Nepatikrinti ir nepaaiškinti skirtumai tarp suvestinių CVPDB duomenų ir atitinkamos informacijos pagal ECB SEC arba kitus patikimus orientacinius duomenis, atsižvelgiant į galimybę gauti tokius orientacinius duomenis, tą pačią ataskaitinę dieną neviršija DKV ribos nei vienam iš šių ESS emitentų sektorių: — S.11 „ne finansų bendrovės“ (S.11 pagal ESS 95) — S.121 „centrinis bankas“ (S.121 pagal ESS 95) — S.122 „indėlius priimančios bendrovės, išskyrus centrinį banką“ (S.122 pagal ESS 95) — S.123 „pinigų rinkos fondai (PRF)“ (S.122 pagal ESS 95) — S.124 „investiciniai fondai, išskyrus PRF“ (S.123 pagal ESS 95) — S.125 „kiti finansiniai tarpininkai, išskyrus draudimo bendroves ir pensijų fondus“ (S.123 pagal ESS 95) — S.126 „finansinės pagalbinės įmonės“ (S.124 pagal ESS 95) — S.127 „priklausomos finansų įstaigos ir pinigų skolintojai“ (S.123 pagal ESS 95) — S.128 „draudimo bendrovės (DB)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.129 „pensijų fondai (PF)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.13 „valdžios sektorius“ (S.13 pagal ESS 95).	Nurodyti požymiai: neapmokėta suma eurais (*amount outstanding in euro*), rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) eurais. Numanomi požymiai: emisijos diena (*issue date*), termino pabaigos diena (*maturity date*), valiuta, priemonės sektorius pagal ESS (*issuer ESA sector*), rezidavimo šalis.	Neapmokėtos sumos (*amounts outstanding*) arba rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) eurais, išreikštos kaip skirtumas procentais tarp CVPDB ir išorinių orientacinių duomenų.

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
5 tikslas: **Duomenų tikslumas – nuosavybės priemonių rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*)**	Koncepcija: Laikantis vertybinių popierių emisijos statistikos koncepcijos, metrika suveda nuosavybės akcijų rinkos kapitalizaciją (*market capitalisation*) pagal kiekvieno emitento rezidavimo šalį ir pagal emitento sektorių. Šie suvestiniai duomenys palyginami su atitinkamu SEC skaičiumi ir apskaičiuojamas CVPDB duomenų procentinis nuokrypis. Nepatikrinti ir nepaaiškinti skirtumai neviršija DKV ribos.	5 tikslas palygina CVPDB išvedimo duomenis su išoriniais orientaciniais duomenimis. Nepatikrinti ir nepaaiškinti skirtumai tarp suvestinės CVPDB informacijos ir atitinkamos informacijos pagal ECB SEC arba kitus patikimus orientacinius duomenis, atsižvelgiant į galimybę gauti tokius orientacinius duomenis, tą pačią ataskaitinę dieną neviršija DKV ribos nei vienam iš šių ESS emitentų sektorių: — S.11 „ne finansų bendrovės“ (S.11 pagal ESS 95) — S.121 „centrinis bankas“ (S.121 pagal ESS 95) — S.122 „indėlius priimančios bendrovės, išskyrus centrinį banką“ (S.122 pagal ESS 95) — S.123 „pinigų rinkos fondai (PRF)“ (S.122 pagal ESS 95) — S.124 „investiciniai fondai, išskyrus PRF“ (S.123 pagal ESS 95) — S.125 „kiti finansiniai tarpininkai, išskyrus draudimo bendroves ir pensijų fondus“ (S.123 pagal ESS 95) — S.126 „finansinės pagalbinės įmonės“ (S.124 pagal ESS 95) — S.127 „priklausomos finansų įstaigos ir pinigų skolintojai“ (S.123 pagal ESS 95) — S.128 „draudimo bendrovės (DB)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.129 „pensijų fondai (PF)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.13 „valdžios sektorius“ (S.13 pagal ESS 95).	Nurodyti požymiai: neapmokėta suma eurais (*amount outstanding in euro*), neapmokėtų kotiruojamų akcijų kiekis. Numanomi požymiai: nominalioji valiuta (*nominal currency*), emitento sektorius pagal ESS (*issuer ESA sector*), rezidavimo šalis, kotiruojamų akcijų kainos vertė (*price value*) (tik atmestinų rezultatų patikrinimas).	Neapmokėtos sumos (*amounts outstanding*) arba rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) eurais, išreikštos kaip skirtumas procentais tarp CVPDB ir išorinių orientacinių duomenų.

DKV tikslai	DKV metrika	Įgyvendinimas	Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai	DKV ribų pagrindas
6 tikslas: **Duomenų tikslumas – emitento klasifikacija**	Koncepcija: Atsižvelgiant į emitentų visus turimus vertybiniais popieriais pagrįstus įsipareigojimus (sudėjus nuosavybę ir skolą), metrika reitinguoja emitentus pagal kiekvienos rezidavimo šalies ir (arba) emitento sektoriaus derinį. Metrika taip pat nustato absoliučius reitingų pokyčius tarp skirtingų emitentų, kad būtų lengviau nustatyti neapmokėtų sumų (*amounts outstanding*) arba rinkos kapitalizacijos (*market capitalisation*) reikšmingus atmestinus rezultatus. Klasifikavimas pagal emitento rezidavimo šalį ir sektorių patikrinamas, kol pasiekiama DKV riba. Aprėptis: Ši metrika apima visas investicinių fondų akcijas, nuosavybės priemones ir skolos vertybinius popierius, kurių termino pabaigos diena (*maturity date*) ne vėliau kaip už trijų mėnesių.	6 tikslas įvertina statistinę emitentų klasifikaciją. Statistinė emitentų klasifikacija iki DKV ribos tikrinama kiekvienam nurodytam ESS emitentų sektoriui: — S.11 „ne finansų bendrovės“ (S.11 pagal ESS 95) — S.121 „centrinis bankas“ (S.121 pagal ESS 95) — S.122 „indėlius priimančios bendrovės, išskyrus centrinį banką“ (S.122 pagal ESS 95)) — S.123 „pinigų rinkos fondai (PRF)“ (S.122 pagal ESS 95) — S.124 „investiciniai fondai, išskyrus PRF“ (S.123 pagal ESS 95) — S.125 „kiti finansiniai tarpininkai, išskyrus draudimo bendroves ir pensijų fondus“ (S.123 pagal ESS 95) — S.126 „finansinės pagalbinės įmonės“ (S.124 pagal ESS 95) — S.127 „priklausomos finansų įstaigos ir pinigų skolintojai“ (S.123 pagal ESS 95) — S.128 „draudimo bendrovės (DB)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.129 „pensijų fondai (PF)“ (S.125 pagal ESS 95) — S.13 „valdžios sektorius“ (S.13 pagal ESS 95).	Emitento sektorius pagal ESS (*issuer ESA sector*), rezidavimo šalis.	Neapmokėtos sumos (*amounts outstanding*) arba rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) eurais, išreikštos kaip „kapitalizacija“, t. y. kiekvienam emitentui tenkančios neapmokėtos sumos (*amounts outstanding*) ir rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*).

([1]) Kategorijų numeravimas atspindi pasiūlyme dėl Europos Parlamento ir Tarybos reglamento dėl Europos nacionalinių ir regioninių sąskaitų sistemos Europos Sąjungoje (KOM(2010) 774 galutinis) nustatytą numeravimą.

II PRIEDAS

DKV SISTEMOJE TAIKOMI SRAUTAI IR ATNAUJINTŲ IŠVEDIMO DUOMENŲ POŽYMIAI

DKV sistemoje taikomi šie skirtingus vartojimo tikslus palaikantys srautai:

— Išorės statistiką palaikantis srautas (EXT 1.0),

— Finansinių priemonių bendrovių srautas, palaikantis finansinių priemonių bendrovių statistiką (FVC 1.0)

— Investicinių fondų srautas, palaikantis investicinių fondų statistiką (IF 1.0)

— Turimų vertybinių popierių srautas, palaikantis turimų vertybinių popierių statistiką (SHS 1.0)

— Vyriausybės vertybinių popierių finansavimo srautas, palaikantis Vyriausybės vertybinių popierių finansavimo statistiką (GSF 1.0)

Atnaujintų išvedimo duomenų požymiai, kurie yra palaikomi srautai:

Atnaujintų išvedimo duomenų požymio pavadinimas	Apibūdinimas	Taikomas srautas				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (Tarptautinio vertybinių popierių identifikavimo numerio (ISIN) kodas)	ISIN vertybinių popierių identifikatorius.	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (Priemonės klasė pagal Europos sąskaitų sistemą (ESS))	Vertybinių popierių klasifikavimas pagal ESS.	√	√	√	√	√
Debt type (Skolos rūšis)	Skolos priemonės rūšis.				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Požymis, kurį galima naudoti identifikuojant vertybinius popierius, kurie pagal ECB SEC turėtų būti įtraukti į „einamąsias neapmokėtas sumas“.					√
Instrument supplementary class (Papildoma priemonės klasė)	Papildomas požymis, leidžiantis nustatyti, ar priemonė turėtų būti įtraukta į SEC. Šio požymio vertės gali būti: 1 = „atkarpos dalis“, 2 = „pagrindinės sumos dalis“, ir t. t.					√
Security status (Vertybinių popierių statusas)	Papildomas požymis, leidžiantis nustatyti, ar priemonė turėtų būti įtraukta į SEC. Šis požymis gali nurodyti, ar priemonės terminas dar nesuėjęs.					√
Asset securitisation type (Turto pakeitimo vertybiniais popieriais rūšis)	Turto pakeitimo vertybiniais popieriais rūšis.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Požymis, parodantis, ar priemonė tinkama pateikti įkaitu Eurosistemos kredito operacijoms.				√	
Nominal currency (Nominalioji valiuta)	Priemonės nominalioji valiuta (Tarptautinė standartizacijos organizacija (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Atnaujintų išvedimo duomenų požymio pavadinimas	Apibūdinimas	Taikomas srautas				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (Emisijos diena)	Diena, kurią emitentas platintojui už užmokestį pateikia vertybinius popierius. Tai yra diena, kai investuotojai pirmą kartą gali įsigyti konkrečių vertybinių popierių. Pastaba: suskaidytosios obligacijos atveju šis stulpelis nurodo dieną, kai prekiaujama atkarpa ir (arba) pagrindinė suma.	√	√	√	√	√
Maturity date (Termino pabaigos diena)	Diena, kai skolos priemonė faktiškai išperkama.	√	√	√	√	√
Residual maturity (Likęs terminas)	Likęs priemonės terminas, apskaičiuotas dieną, kurią rodo atnaujinti išvedimo duomenys.					√
Issuer domicile country (Šalis, kurioje yra emitento adresas)	Šalis, kurioje vertybinių popierių emitentas teisiškai įregistruotas (adresas) (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (Emitento sektorius pagal ESS)	Institucinis emitento sektorius pagal ESS.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (Emitento klasė pagal Europos ekonominės veiklos rūšių klasifikaciją (NACE))	Pagrindinė ekonominė veikla pagal NACE.	√				
Amount issued (Emisijos vertė)	Skolos priemonės vertė emisijos metu (nominalioji vertė). Suskaidytosios obligacijos atveju šis stulpelis nurodo prekybai pateiktos atkarpos ir (arba) pagrindinės sumos vertę. Dalimis išleistų su tuo pačiu ISIN vertybinių popierių atveju šis stulpelis nurodo bendrą iki šiol išleistų vertybinių popierių vertę. Emisijos vertė išreiškiama nominaliąja valiuta (*nominal currency*).					√
Amount outstanding (Neapmokėta suma)	Neapmokėta suma nominaliąja verte. Dalimis išleistų su tuo pačiu ISIN vertybinių popierių atveju šis stulpelis nurodo bendrą iki šiol išleistų vertybinių popierių vertę atėmus išpardavimus. Vertės nurodomos nominaliąja valiuta (*nominal currency*). Neapmokėta suma išreiškiama nominaliąja valiuta (*nominal currency*). Jei nėra nominaliosios valiutos (*nominal currency*), neapmokėta suma išreiškiama eurais.	√			√	√
Amount outstanding in euro (Neapmokėta suma eurais)	Pagal visumos dieną nustatytą euro ir nominaliosios valiutos (*nominal currency*) kursą konvertuota eurais neapmokėta suma.				√	√
Market capitalisation (Rinkos kapitalizacija)	Vėliausia žinoma rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*). Rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) išreiškiama nominaliąja valiuta (*nominal currency*). Jei nėra nominaliosios valiutos (*nominal currency*), rinkos kapitalizacija (*market capitalisation*) išreiškiama eurais.				√	

Atnaujintų išvedimo duomenų požymio pavadinimas	Apibūdinimas	Taikomas srautas				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Pelningumas iki termino pabaigos)	Vertybiniams popieriams būdingas pelningumas iki termino pabaigos (*yield to maturity*) procentais.				√	√
Short name (Trumpasis pavadinimas)	Emitento suteiktas trumpasis pavadinimas, sudaromas pagal emisijai būdingas savybes ir kitą gautą informaciją.					√
Pool factor (Fondo faktorius)	Hipoteka užtikrintų vertybinių popierių fondo faktorius arba likusio pagrindinio balanso faktorius yra iš pirminio pagrindinio balanso padalintas neapmokėtas su vertybiniais popieriais susieto hipotekos fondo pagrindinis balansas.	√	√	√	√	√
Quotation basis (Kotiravimo pagrindas)	Priemonės kotiravimo pagrindas (*quotation basis*), pavyzdžiui, nominalo procentinė dalis (procentai) arba valiuta už akciją ir (arba) vienetą (vienetus).	√	√	√	√	√
Price value (Kainos vertė)	Ataskaitinę dieną paskutinė žinoma tipiškiausia priemonės kaina kotiravimo pagrindu (*quotation basis*) ir, jei yra, priemonės nominaliąja valiuta (*nominal currency*). Už vertybinius popierius, už kuriuos mokamos palūkanos, nurodoma švari kaina, t. y. atėmus sukauptas palūkanas.	√	√	√	√	√
Price value type (Kainos vertės rūšis)	Kainos vertės (*price value*) pobūdis, t. y. ar ji atspindi rinkos vertinimą, numanomą ar nustatytą vertę.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Vidutinė mėnesio kaina)	Priemonės normalizuotų kainų, gaunamų per paskutines 30 kalendorinių dienų iki ataskaitinės dienos, vidurkis kotiravimo pagrindu (*quotation basis*) ir, jei yra, priemonės nominaliąja valiuta (*nominal currency*).	√			√	
Redemption type (Išpirkimo rūšis)	Išpirkimo rūšis (*redemption type*), pvz., pabaigoje, nuolatinis, struktūruotas, anuitetas, serijinis, nereguliarus, nulinis, išskaidytas.					√
Redemption frequency (Išpirkimo dažnumas)	Skolos priemonės išpirkimų skaičius per metus.					√
Redemption price (Išpirkimo kaina)	Galutinė išpirkimo kaina (*redemption price*).					√
Accrued interest (Sukauptos palūkanos)	Nuo paskutinės atkarpos išmokos arba nuo kaupimo pradžios sukauptos palūkanos. Prie vertybinių popierių, už kuriuos mokamos palūkanos, kainos vertės (*price value*) pridėjus šią vertę gaunama taip vadinamoji „purvina kaina“.	√	√	√		√
Accrued income factor (Sukauptų pajamų faktorius)	Pagal skolininko metodą apskaičiuojamas vertybiniams popieriams būdingas kiekvienos dienos pajamų faktorius procentais. Faktorius grindžiamas sukauptomis sumomis, t. y. atsižvelgiant į sudėtinį sukauptų palūkanų (*accrued interest*) ir pajamų poveikį dėl emisijos ir išpirkimo kainų skirtumo.	√	√	√	√	

Atnaujintų išvedimo duomenų požymio pavadinimas	Apibūdinimas	Taikomas srautas				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Atkarpos rūšis)	Atkarpos rūšis, pavyzdžiui, fiksuotoji, kintamoji, išskaidytoji atkarpa ir t. t..				√	√
Last coupon rate (Paskutinės atkarpos palūkanos)	Per metus faktiškai išmokamos paskutinės atkarpos palūkanos (*last coupon rate*) procentais (per metus gautinos palūkanos).	√	√	√	√	
Last coupon date (Paskutinė atkarpos diena)	Diena, kai faktiškai išmokamos paskutinės atkarpos palūkanos (*last coupon rate*). Šis požymis leidžia nustatyti, ar faktiškai išmokėtos paskutinės atkarpos palūkanos (*last coupon rate*) įeina į ataskaitinį laikotarpį.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Paskutinės atkarpos dažnumas)	Dažnumas per metus, per kuriuos išmokamos paskutinės atkarpos palūkanos (*last coupon rate*): „metinės“ – AN, „pusmečio“ – SA ir t. t.	√	√	√	√	
Dividend amount (Dividendų suma)	Paskutinės dividendų išmokos suma už vieną akciją (pagal dividendų sumos rūšį (*dividend amount type*) iki mokesčių (bendrieji dividendai).	√		√	√	
Dividend amount type (Dividendų sumos rūšis)	Dividendų suma (dividend amount) už vieną akciją gali būti išreikšta dividendų valiuta (*dividend currency*) arba akcijų skaičiumi.	√		√	√	
Dividend currency (Dividendų valiuta)	Paskutinės dividendų išmokos valiutos ISO 4217 kodas.	√		√	√	
Dividend Settlement date (Dividendų sumokėjimo diena)	Paskutinės dividendų išmokos sumokėjimo diena. Šis požymis leidžia nustatyti, ar sumokėta dividendų suma (*dividend amount*) įeina į ataskaitinį laikotarpį.	√		√	√	
Last split factor (Paskutinio pergrupavimo faktorius)	Akcijų sujungimas ir išskaidymas.	√		√	√	
Last split date (Paskutinio pergrupavimo diena)	Diena, kai įvykdomas pergrupavimas.	√		√	√	