PAMATNOSTĀDNES

EIROPAS CENTRĀLĀS BANKAS PAMATNOSTĀDNE

(2012. gada 26. septembris)

par datu kvalitātes pārvaldības sistēmu Centralizētajai vērtspapīru datubāzei

(ECB/2012/21)

(2012/689/ES)

EIROPAS CENTRĀLĀS BANKAS PADOME,

ņemot vērā Eiropas Centrālo banku sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtus un jo īpaši to 5.1., 12.1. un 14.3. pantu,

ņemot vērā Padomes Regulu (EK) Nr. 2533/98 (1998. gada 23. novembris) par statistikas informācijas vākšanu, ko veic Eiropas Centrālā banka ([1]),

tā kā:

(1) Centralizētā vērtspapīru datubāze (CVDB) ir vienota informācijas tehnoloģiju infrastruktūra, ko kopīgi uztur Eiropas Centrālo banku sistēmas (ECBS) dalībnieces, tostarp ārpus eurozonas esošu dalībvalstu nacionālās centrālās bankas (NCB), kas brīvprātīgi piedalās CVDB uzturēšanā. CVDB tiek glabāti atsevišķu posteņu dati, jo īpaši dati par vērtspapīriem, to emitentiem un cenām.

(2) Datus vāc no dažādiem avotiem, tostarp ECBS dalībniecēm, atsevišķiem komerciālu datu sniedzējiem, publiski pieejamās informācijas un administratīviem avotiem, un sniedz CVDB. Tomēr pastāv risks, ka šādi ievaddati var būt neprecīzi vai nepilnīgi. CVDB sistēma spēj uzlabot daļēji neatbilstošus dažādu avotu ievaddatus un identificēt nepilnīgus vai trūkstošus datus. Ciktāl iespējams, tā automātiski apvieno dažādu sakrītošu avotu ievaddatus vienā pilnīgā augstas kvalitātes ierakstā.

(3) Datu kvalitāti kopumā CVDB var novērtēt tikai izvaddatu līmenī, nevis atsevišķu ievaddatu vienību līmenī. Lai nodrošinātu izvaddatu pilnīgumu, precizitāti un saskaņotību, ciktāl tas iespējams, ir jānosaka sistēma datu kvalitātes pārvaldībai (DKP), ko piemēro izvades plūsmas datiem, proti, izvaddatu apakškopai, kuru var izmantot datu ievadei statistikas veidošanas vai citām vajadzībām. Izvades plūsmas dati tiek sniegti NCB ne vēlāk kā septiņās darbdienās pēc katra kalendārā mēneša beigām.

(4) Daži izvades plūsmas dati ietver arī atribūtus, kuri laika gaitā var svārstīties, piemēram, ar cenām vai ienākumiem saistītu informāciju. CVDB sistēma šos atribūtus automātiski pārbauda, izmantojot statistikas algoritmus. Kompetentās iestādes saskaņā ar šo pamatnostādni pārbauda tikai tos atribūtus, kas attiecībā uz katru DKP mērķi ir norādīti I pielikumā. Visaptverošs to atribūtu saraksts, kuri veido izmantojamas plūsmas, ir izklāstīts II pielikumā.

(5) CVDB DKP sistēma būtu jāpiemēro izvades plūsmas datiem neatkarīgi no ievaddatu avota. Tajā būtu jāparedz eurozonas NCB kompetence CVDB izvaddatu kvalitātes jomā un attiecīgā gadījumā Eiropas Centrālās bankas (ECB) kompetence.

(6) CVDB DKP sistēmas pamatā, pirmkārt, vajadzētu būt DKP mērķiem, kuros ietverti rādītāji izvades plūsmas datu kvalitātes novērtēšanai un, otrkārt, DKP metrikai, ar ko identificē pārbaudāmos izvades plūsmas datus un sakārto tos prioritārā secībā atbilstoši katram DKP mērķim. Tās pamatā vajadzētu būt arī DKP robežvērtībām, ar ko nosaka tādas pārbaudes minimālo līmeni, kura jāveic saistībā ar DKP mērķi.

(7) Ja standarta datu nav, DKP mērķi dažreiz neidentificē kļūdas izvades plūsmas datos, bet spēj tikai identificēt gadījumus, kuros nepieciešama manuāla izvades plūsmas datu pārbaude.

(8) Tā kā visas ECBS dalībnieces kopīgi uztur CVDB, tām visām būtu jācenšas ievērot vienus un tos pašus DKP standartus. Turklāt ārpus eurozonas esošu dalībvalstu NCB ir laba iespēja veikt DKP attiecībā uz datiem par emitentiem, kas ir attiecīgo dalībvalstu rezidenti. Lai gan ECB pieņemtās pamatnostādnes neuzliek pienākumus ārpus eurozonas esošu dalībvalstu NCB, Eiropas

([1]) OV L 318, 27.11.1998., 8. lpp.

Centrālo banku sistēmas un Eiropas Centrālās bankas Statūtu 5. pantu piemēro gan eurozonā, gan ārpus eurozonas esošu dalībvalstu NCB. Ārpus eurozonas esošu dalībvalstu NCB tādēļ būtu jāizstrādā un jāīsteno visi pasākumi, ko tās uzskata par vajadzīgiem, lai veiktu DKP saskaņā ar šo pamatnostādni.

(9) Nolūkā uzlabot izvaddatu kvalitāti būtu jāveic datu avotu pārvaldība (DAP), lai identificētu atkārtotas un strukturālas kļūdas ievaddatos, ka arī labotu tās tiešā sadarbībā ar datu sniedzēju,

IR PIEŅĒMUSI ŠO PAMATNOSTĀDNI.

1. pants

Definīcijas

Šajā pamatnostādnē piemēro šādas definīcijas:

1) "CVDB" ("*CSDB*") ir Centralizētā vērtspapīru datubāze, kuru izveido ECBS un kura atrodas ECB telpās;

2) "ievaddati" ("*input data*") ir visi dati, ko CVDB saņem no viena vai vairākiem datu avotiem;

3) "izvaddati" ("*output data*") ir dati, ko CVDB automātiski atvasina, apvienojot ievaddatus vienā pilnīgā augstas kvalitātes ierakstā;

4) "izvades plūsmas dati" ("*output feed data*") ir izvaddatu un II pielikumā izklāstīto raksturlielumu apakškopa, ko izmanto datu ievadei statistikas veidošanas vai citām vajadzībām;

5) "datu kvalitātes pārvaldība" jeb "DKP" ("*Data Quality Management*" jeb "*DQM*") ir izvades plūsmas datu kvalitātes nodrošināšana, pārbaude un saglabāšana, izmantojot un piemērojot DKP mērķus, DKP metriku, DKP robežvērtības un DKP darbplūsmu;

6) "datu avotu pārvaldība" jeb "DAP" ("*Data Source Management*" jeb "*DSM*") ir atkārtotu un/vai strukturālu kļūdu identificēšana ievaddatos, kā arī šādu kļūdu labošana tiešā sadarbībā ar datu sniedzēju;

7) "sākotnējā DKP" ("*initial DQM*") ir izvades plūsmas datu, tostarp nesenākā laikposma datu, DKP, ko ik mēnesi veic DKP kompetentās iestādes, ievērojot mēneša beigu pārskatā sniegtos izvades plūsmas datus;

8) "regulārā DKP" ("*regular DQM*") ir izvades plūsmas datu DKP, ko ik mēnesi veic DKP kompetentās iestādes, ievērojot dažādu datu avotu sniegtus standarta datus, kuri neattiecas uz CVDB, lai nodrošinātu to, ka CVDB izvaddatu kvalitāte atbilst prasībām, kas noteiktas attiecībā uz CVDB plūsmas datiem;

9) "DKP mērķis" ("*DQM target*") ir standarts izvades plūsmas datu kvalitātes novērtēšanai, kā norādīts I pielikumā;

10) "DKP metrika" ("*DQM metric*") ir statistikas rādītājs, kas atspoguļo, cik lielā mērā ir izpildīts konkrēts DKP mērķis, kā norādīts I pielikumā;

11) "DKP robežvērtība" ("*DQM threshold*") ir tādu pārbaudes darbu minimālais līmenis, kuri jāveic, lai nodrošinātu atbilstību DKP sistēmas prasībām attiecībā uz DKP mērķi;

12) "DKP darbplūsma" ("*DQM workflow*") ir tehnisks process, ko izmanto ievaddatu labošanai, lai nodrošinātu atbilstību DKP robežvērtībai;

13) "mēneša beigu pārskats" ("*end-month preview*") ir regulāra izvaddatu un DKP metrikas ikmēneša atjaunināšana, tuvinot izvaddatus gaidāmo mēneša beigu stāvoklim;

14) "darbdiena" ("*working day*") ir pilna diena, kurā ir pieejama *TARGET2*, kā norādīts ECB interneta lapā;

15) "pārbaude" ("*verification*") ir process, kurā DKP kompetentās iestādes pārbauda CVDB izvades plūsmas datus un vajadzības gadījumā labo CVDB ievaddatus, izmantojot DKP darbplūsmu;

16) "rezidents" ("*resident*") atbilst definīcijai Regulas (EK) Nr. 2533/98 1. pantā.

2. pants

Priekšmets un piemērošanas joma

1. Ar šo pamatnostādni izveido DKP, kuru piemēro CVDB un kuras mērķis ir nodrošināt izvaddatu pilnīgumu, precizitāti un saskaņotību CVDB, konsekventi piemērojot noteikumus par šādu datu kvalitātes standartiem.

2. CVDB DKP sistēmas pamatā ir DKP un DAP.

3. pants

DKP kompetentās iestādes

1. Tās eurozonas dalībvalsts NCB, kuras rezidents ir vērtspapīra emitents, atbild par to datu DKP, kuri attiecas uz šo emitentu.

2. ECB atbild par to datu DKP, kuri attiecas uz emitentiem, kas ir rezidenti ārpus eurozonas, izņemot, ja ārpus eurozonas NCB ir uzņēmusies atbildību par tādu datu DKP, kuri attiecas uz emitentiem, kas ir attiecīgās dalībvalsts rezidenti.

4. pants

DKP, DKP metrika un DKP robežvērtības

1. DKP kompetentās iestādes veic sākotnējo DKP un regulāro DKP. Šajā procesā tās pārbauda izvades plūsmas datus neatkarīgi no to avota.

2. DKP kompetentās iestādes piemēro DKP metriku atbilstīgi I pielikumam.

3. DKP kompetentās iestādes I pielikumā iekļautajiem atribūtiem piemēro DKP robežvērtības tādā mērā, lai nodrošinātu izvades plūsmas datu kvalitāti atbilstīgi prasībām, ar ko nodrošina attiecīgo atribūtu izmantošanu, kā izklāstīts II pielikumā.

5. pants

Sākotnējā DKP

1. Sākotnējo DKP piemēro DKP 1., 2., 3.a, 3.b un 6. mērķim, kā izklāstīts I pielikumā.

2. ECB publicē mēneša beigu pārskatu septiņas darbdienas pirms katra kalendārā mēneša beigām.

3. DKP kompetentās iestādes sākotnējās DKP gaitā pārbauda, vai statistikā nav rupju kļūdu, lai nodrošinātu, ka izvades plūsmas dati pēc sākotnējās DKP atspoguļo pēc iespējas jaunākus notikumus.

4. DKP kompetentās iestādes līdz nākamā kalendārā mēneša otrās darbdienas beigām pārbauda mēneša beigu pārskata datus, lai pārliecinātos par DKP robežvērtībām, ievērojot DKP metriku.

5. Ja ārpus CVDB nav standarta datu, sākotnējās DKP gaitā paļaujas tikai uz informāciju, kas jau ir pieejama DKP kompetentajai iestādei vai kas ir viegli iegūstama, neizveidojot jaunu ziņošanas struktūru.

6. DKP kompetentās iestādes vajadzības gadījumā labo ievaddatus saskaņā ar DKP darbplūsmu, izmantojot CVDB sistēmu vai iesniedzot ievaddatu failus ECB.

6. pants

Regulārā DKP

1. Regulāro DKP piemēro DKP 3.a, 3.b, 4., 5. un 6. mērķim, kā izklāstīts I pielikumā.

2. DKP kompetentās iestādes veic regulāro DKP viena mēneša laikā pēc katra kalendārā mēneša beigām. Ņemot vērā visu tobrīd pieejamo informāciju, tās pārbauda izvades plūsmas datus vēlākais tā kalendārā mēneša otrajā darbdienā, kurš ir nākamais pēc regulārās DKP veikšanas mēneša.

3. DKP kompetentās iestādes vajadzības gadījumā labo ievaddatus saskaņā ar pieņemto darbplūsmu, izmantojot CVDB sistēmu vai iesniedzot ievaddatu failus ECB.

7. pants

Uzdevumi saistībā ar DAP

1. DKP kompetentās iestādes identificē visas problēmas saistībā ar DAP un ziņo par tām ECB.

2. ECB sadarbībā ar DKP kompetentajām iestādēm viena mēneša laikā pēc dienas, kurā par DAP problēmu paziņots ECB, veic pasākumus, lai ļoti nopietnas kļūdas saistībā ar DAP neatkārtotos.

8. pants

Labojumi ievaddatos

Ja DKP kompetentā iestāde ir uzlabojusi ievaddatus, tā izmanto CVDB sistēmu, lai savos ievaddatos labotu visas kļūdas un izlaidumus, kas netika izlaboti pārbaudes laikā, kā norādīts 5. panta 4. punktā.

9. pants

Gada kvalitātes ziņojums

Ņemot vērā ECBS Statistikas komitejas viedokļus, ECB Valde katru gadu ziņo ECB Padomei par izvades plūsmas datu kvalitāti.

10. pants

Vienkāršotā grozījumu procedūra

Ņemot vērā ECBS Statistikas komitejas viedokļus, ECB Valde ir tiesīga veikt tehniskus grozījumus šīs pamatnostādnes pielikumos ar nosacījumu, ka šādi grozījumi nemaina šīs pamatnostādnes konceptuālo pamatsistēmu, tostarp ECB un NCB kompetenču sadalījumu, un būtiski neietekmē DKP kompetento iestāžu pienākumus attiecībā uz datu sniegšanu. ECB Valde nekavējoties paziņo ECB Padomei par visiem šādiem grozījumiem.

11. pants

Stāšanās spēkā

1. Šī pamatnostādne stājas spēkā 2012. gada 1. novembrī.

2. Šo pamatnostādni piemēro no 2013. gada 1. jūlija.

12. pants

Adresāti

Šī pamatnostādne ir adresēta visām Eurosistēmas centrālajām bankām.

Frankfurtē pie Mainas, 2012. gada 26. septembrī

ECB Padomes vārdā –
ECB priekšsēdētājs
Mario DRAGHI

I PIELIKUMS

DKP MĒRĶI, ĪSTENOŠANA, ATRIBŪTI UN DKP ROBEŽVĒRTĪBAS BĀZE

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
1. mērķis: **Datu stabilitāte – krājumu dati**	Būtība: Metriku nosaka katrai rezidences valsts/sektora kombinācijai pēc monetāras summas svērtā "izmaiņu indeksa" veidā. Indeksa vērtība "1" norāda, ka attiecīgais atribūts nav mainījies nevienam no tā pamatā esošajiem vērtspapīriem, savukārt indeksa vērtība "0" norāda, ka attiecīgais atribūts ir mainījies visiem vērtspapīriem. Ja indekss samazinās zem vērtības "1", identificē tos atsevišķos vērtspapīrus, kuru indekss ir mainījies, izraisot indeksa samazināšanos, lai pārbaudītu izmaiņas, līdz tiek panākta atbilstība robežvērtībai. Notikumi, kas izraisa indeksa izmaiņas: Diskrētu atribūtu gadījumā indeksa izmaiņu izraisītājs ir atšķirība attiecībā pret iepriekšējo mēnesi. Nepārtrauktu atribūtu gadījumā indeksa izmaiņu izraisītājs ir tāda atšķirība attiecībā pret iepriekšējo mēnesi, kas pārsniedz 25 %. Aptvērums: DKP metrika aptver ieguldījumu fondu akcijas, kapitāla vērtspapīrus un parāda vērtspapīrus, tostarp sertifikātus, ar dzēšanas termiņu, kas nepārsniedz trīs mēnešus.	1. mērķis paredzēts krājumu datu stabilitātes novērtēšanai. Attiecībā uz katru no tālāk minētajiem emitentu sektoriem Eiropas kontu sistēmā (EKS) [1] nepārbaudīti CVDB atribūti nemazina stabilu datu īpatsvaru virs DKP robežvērtības: — S.11 "nefinanšu sabiedrības" (S.11 saskaņā ar EKS 95), — S.121 "centrālā banka" (S.121 saskaņā ar EKS 95), — S.122 "noguldījumus pieņemošas sabiedrības, izņemot centrālo banku" (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.123 "naudas tirgus fondi" (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.124 "ieguldījumu fondi, izņemot naudas tirgus fondus" (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.125 "citi finanšu starpnieki, izņemot apdrošināšanas sabiedrības un pensiju fondus" (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.126 "finanšu palīgsabiedrības" (S.124 saskaņā ar EKS 95), — S.127 "piesaistītās finanšu iestādes un naudas aizdevēji" (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.128 "apdrošināšanas sabiedrības (AS)" (S.125 saskaņā ar EKS 95); — S.129 "pensiju fondi (PF)" (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.13 "valdība" (S.13 saskaņā ar EKS 95).	Tiešie atribūti: parāda emisijas diena, parāda dzēšanas termiņš, nomināla valūta, kotēšanas pamats, instrumenta klase EKS, emitenta rezidences valsts, emitenta sektors EKS, emitenta klasifikācija atbilstīgi Eiropas ekonomiskās darbības klasifikācijai (*NACE*), atlikumu summa, akciju atlikuma skaits attiecībā uz kotētajām akcijām.	Atlikuma summa vai tirgus kapitalizācija euro, kas izteikti kā krājumu datu daļa.

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
2. mērķis: **Datu precizitāte – jaunas emisijas un dzēšana; neto emisiju apjoms**	Būtība: Metriku nosaka katrai rezidences valsts/sektora kombinācijai, un tā aptver jaunas parāda vērtspapīru emisijas, dzēšanu un atlikuma summu, ko izsaka procentos. Metrika saista neto emisijas apjomu mēneša laikā ar atlikuma summu iepriekšējā mēneša beigās (izmaiņas procentu izteiksmē) un uzrauga parāda atlikuma relatīvās izmaiņas. Izmanto iespēju piekļūt neapkopotiem datiem par atsevišķām jaunām emisijām un dzēšanu, kas izraisījuši atlikuma summas izmaiņas. Tos pārbauda, līdz tiek panākta atbilstība robežvērtībai.	2. mērķis paredzēts jaunu emisiju un dzēšanas novērtēšanai, ievērojot attiecīgos krājumu datus. Attiecībā uz katru no tālāk minētajiem emitentu sektoriem EKS, nepārbaudīti dati par atlikuma summu tādu jaunu emisiju un dzēšanas gadījumā, kas attiecas uz parāda vērtspapīriem, procentu izteiksmē nepārsniedz DKP robežvērtību: — S.11 “nefinanšu sabiedrības” (S.11 saskaņā ar EKS 95), — S.121 “centrālā banka” (S.121 saskaņā ar EKS 95), — S.122 “noguldījumus pieņemošas sabiedrības, izņemot centrālo banku” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.123 “naudas tirgus fondi” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.124 “ieguldījumu fondi, izņemot naudas tirgus fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.125 “citi finanšu starpnieki, izņemot apdrošināšanas sabiedrības un pensiju fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.126 “finanšu palīgsabiedrības” (S.124 saskaņā ar EKS 95), — S.127 “piesaistītās finanšu iestādes un naudas aizdevēji” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.128 “apdrošināšanas sabiedrības (AS)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.129 “pensiju fondi (PF)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.13 “valdība” (S.13 saskaņā ar EKS 95).	Tiešie atribūti: atlikuma summa. Netiešie atribūti: emisijas diena, dzēšanas termiņš, nomināla valūta, kotēšanas pamats, instrumenta klasifikācija EKS, emitenta rezidences valsts, emitenta sektors EKS.	Atlikuma summa euro, kas izteikta kā relatīvā izmaiņa, salīdzinot ar krājumu datiem.

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
3.a mērķis: **Datu precizitāte – izmantojams iekļaušanai pareizā sektorā un datu nodalīšanai pēc emitenta**	Koncepcijas pamats: CVDB sasaista informāciju par emitentu un instrumentu pēc tāda saistības modeļa, ko var raksturot kā "viens daudziem", proti, viens emitents var būt saistīts ar daudziem instrumentiem, savukārt katrs instruments ir saistīts tikai ar vienu emitentu. Šo instrumenta-emitenta saiti rada atsevišķi emitenta identifikatori, kuru avots ir dažādi ievaddatu sniedzēji. Dažādu datu sniedzēju pielietotie identifikatori atšķiras, jo vienots standarts līdz šim nav ieviests, tomēr identifikatoriem vajadzētu būt saskaņotiem. Ja ievaddatu sniedzēji pielieto nesaskaņotus (konfliktējošus) emitenta identifikatorus, proti, ja to dēļ rodas pretrunas attiecībā uz emitentu, instrumentu nevar pievienot nevienam emitentam un tas nokļūst "konfliktgrupā". Konfliktgrupas tomēr ir iespējams pareizi klasificēt pēc piederības valstij un sektoram, taču tām nav saskaņotu saišu ar attiecīgajiem emitentiem. Instrumentu nokļūšana konfliktgrupās liedz saskaņotu un uzticamu piekļuvi visiem attiecīgo emitentu emitētajiem instrumentiem. Instrumentu nokļūšana konfliktgrupās palielina nepareizas klasifikācijas risku, klasificējot pēc rezidences valsts vai sektora. Būtība: Metrika identificē instrumentus konfliktgrupās katrai rezidences valstij un saista tās procentuālas daļas izteiksmē no skaita vai monetārās summas attiecīgajā valstī. Aptvērums: Metrika aptver visus CVDB iekļautos instrumentus.	3.a mērķis paredzēts pareizai emitentu grupas identificēšanai. Ja rodas pretrunas attiecībā uz instrumenta emitentu, proti, "konfliktgrupas" instrumenta emitentu, šādu instrumentu dati nepārsniedz DKP robežvērtību.	Tiešie atribūti: grupēšanā pielietotais emitenta identifikators.	"Konfliktgrupas" instrumentu atlikuma summa euro, ko izsaka kā procentuālu daļu no visiem instrumentiem.

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
3.b mērķis: **Datu precizitāte – izmantojams iekļaušanai pareizā sektorā un datu nodalīšanai pēc emitenta**	Koncepcijas pamats: CVDB sasaista informāciju par emitentu un instrumentu pēc tāda saistības modeļa, ko var raksturot kā "viens daudziem", proti, viens emitents var būt saistīts ar daudziem instrumentiem, savukārt katrs instruments ir saistīts tikai ar vienu emitentu. Šo instrumenta-emitenta saiti rada atsevišķi emitenta identifikatori, kuru avots ir dažādi ievaddatu sniedzēji. Dažādu datu sniedzēju pielietotie identifikatori atšķiras, jo vienots standarts līdz šim nav ieviests, tomēr identifikatoriem vajadzētu būt saskaņotiem. Ja neviens ievaddatu sniedzējs nepiešķir instrumentam emitenta identifikatoru, pastāv risks, ka instruments netiks pievienots nevienam emitentam un tas nokļūs "savrupā grupā", kurā ir iekļauts tikai šis instruments. Savrupās grupas tomēr ir iespējams pareizi klasificēt pēc piederības valstij un sektoram, taču tām nav saskaņotu saišu ar attiecīgajiem emitentiem. Instrumentu nokļūšana savrupās grupās liedz saskaņotu un uzticamu piekļuvi visiem attiecīgo emitentu emitētajiem instrumentiem. Tā kā informācija par instrumentiem savrupās grupās nereti ir nepilnīga, tie palielina nepareizas klasifikācijas risku, klasificējot pēc rezidences valsts vai sektora. Būtība: Metrika identificē instrumentus savrupās grupās katrai rezidences valstij un saista tās procentuālas daļas izteiksmē no skaita vai monetārās summas attiecīgajā valstī.	3.b mērķis paredzēts pareizai emitentu grupas identificēšanai. Ja nav uzticamas informācijas par instrumenta emitentu, proti, "savrupas grupas" instrumenta emitentu, šādu instrumentu dati nepārsniedz DKP robežvērtību.	Tiešie atribūti: grupēšanā pielietotais emitenta identifikators.	"Savrupas grupas" instrumentu atlikuma summa euro, ko izsaka kā procentuālu daļu no visiem instrumentiem.

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
	Aptvērums: Metrika aptver visus CVDB iekļautos instrumentus.			
4. mērķis: **Datu precizitāte – parāda vērtspapīru, tostarp sertifikātu, atlikumu summas**	Būtība: Metrika summē parāda vērtspapīru, tostarp sertifikātu, atlikuma summu, klasificējot pēc katra emitenta rezidences valsts un emitenta sektora atbilstīgi vērtspapīru emisiju statistikas (*SEC*) koncepcijai. Iegūto lielumu salīdzina ar attiecīgo *SEC* lielumu, aprēķinos konstatējot CVDB datu procentuālo atšķirību. Nepārbaudītas vai neizskaidrotas atšķirības nepārsniedz DKP robežvērtību.	4. mērķis paredz salīdzināt CVDB izvaddatus ar ārēja standarta datiem. Attiecībā uz katru no tālāk minētajiem emitentu sektoriem EKS – nepārbaudītas un neizskaidrotas atšķirības starp iegūtajiem CVDB datiem un attiecīgo informāciju, kas iegūta no ECB *SEC* vai citiem uzticamiem standartiem, nepārsniedz DKP robežvērtību tam pašam atsauces datumam, ar nosacījumu, ka ir pieejami standartu dati: — S.11 “nefinanšu sabiedrības” (S.11 saskaņā ar EKS 95), — S.121 “centrālā banka” (S.121 saskaņā ar EKS 95), — S.122 “noguldījumus pieņemošas sabiedrības, izņemot centrālo banku” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.123 “naudas tirgus fondi” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.124 “ieguldījumu fondi, izņemot naudas tirgus fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.125 “citi finanšu starpnieki, izņemot apdrošināšanas sabiedrības un pensiju fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.126 “finanšu palīgsabiedrības” (S.124 saskaņā ar EKS 95), — S.127 “piesaistītās finanšu iestādes un naudas aizdevēji” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.128 “apdrošināšanas sabiedrības (AS)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.129 “pensiju fondi (PF)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.13 “valdība” (S.13 saskaņā ar EKS 95).	Tiešie atribūti: atlikuma summa euro, tirgus kapitalizācija euro. Netiešie atribūti: emisijas diena, dzēšanas termiņš, valūta, emitenta sektors EKS, rezidences valsts.	Atlikuma summa vai tirgus kapitalizācija euro, ko izsaka kā CVDB datu un ārēja standarta atšķirību procentu izteiksmē.

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
5. mērķis: **Datu precizitāte – kapitāla vērtspapīru tirgus kapitalizācija**	Būtība: Metrika summē kapitāla vērtspapīru tirgus kapitalizāciju, klasificējot pēc katra emitenta rezidences valsts un emitenta sektora atbilstīgi vērtspapīru emisijas statistikas koncepcijai. Iegūto lielumu salīdzina ar attiecīgo *SEC* lielumu, aprēķinos konstatējot CVDB datu procentuālo atšķirību. Nepārbaudītas vai neizskaidrotas atšķirības nepārsniedz DKP robežvērtību.	5. mērķis paredz salīdzināt CVDB izvaddatus ar ārēja standarta datiem. Attiecībā uz katru no tālāk minētajiem emitentu sektoriem EKS – nepārbaudītas un neizskaidrotas atšķirības starp iegūto CVDB informāciju un attiecīgo informāciju, kas iegūta no ECB *SEC* vai citiem uzticamiem standartiem, nepārsniedz DKP robežvērtību tam pašam atsauces datumam, ar nosacījumu, ka ir pieejami standartu dati: — S.11 “nefinanšu sabiedrības” (S.11 saskaņā ar EKS 95), — S.121 “centrālā banka” (S.121 saskaņā ar EKS 95), — S.122 “noguldījumus pieņemošas sabiedrības, izņemot centrālo banku” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.123 “naudas tirgus fondi” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.124 “ieguldījumu fondi, izņemot naudas tirgus fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.125 “citi finanšu starpnieki, izņemot apdrošināšanas sabiedrības un pensiju fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.126 “finanšu palīgsabiedrības” (S.124 saskaņā ar EKS 95), — S.127 “piesaistītās finanšu iestādes un naudas aizdevēji” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.128 “apdrošināšanas sabiedrības (AS)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.129 “pensiju fondi (PF)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.13 “valdība” (S.13 saskaņā ar EKS 95).	Tiešie atribūti: atlikuma summa euro, akciju atlikuma skaits attiecībā uz kotētajām akcijām. Netiešie atribūti: nomināla valūta, emitenta sektors EKS, rezidences valsts, kotēto akciju cenas vērtība (tikai rupju kļūdu pārbaude).	Atlikuma summa vai tirgus kapitalizācija euro, ko izsaka kā CVDB datu un ārēja standarta atšķirību procentu izteiksmē.

DKP mērķis	DKP metrika	Īstenošana	Izvades plūsmas datu atribūti	DKP robežvērtības bāze
6. mērķis: **Datu precizitāte – emitentu klasifikācija**	Būtība: Metrika klasificē emitentus katrā rezidences valsts/sektora kombinācijā atbilstīgi to kopējam pasīvu apjomam vērtspapīros (kapitāla un parāda vērtspapīrus skaitot kopā). Metrika arī salīdzinoši parāda dažādu emitentu klasifikācijas absolūtās izmaiņas, ļaujot atklāt rupjas kļūdas attiecībā uz atlikuma summu vai tirgus kapitalizāciju. Emitenta klasifikāciju pēc rezidences valsts un sektora pārbauda atbilstīgi DKP robežvērtībai. Aptvērums: Metrika aptver ieguldījumu fondu akcijas, kapitāla vērtspapīrus un parāda vērtspapīrus ar dzēšanas termiņu, kas nepārsniedz trīs mēnešus.	6. mērķis paredz salīdzināt emitentu statistikas klasifikāciju. Katrā no tālāk minētajiem emitentu sektoriem EKS tiek pārbaudīta emitentu statistikas klasifikācija līdz DKP robežvērtībai: — S.11 “nefinanšu sabiedrības” (S.11 saskaņā ar EKS 95), — S.121 “centrālā banka” (S.121 saskaņā ar EKS 95), — S.122 “noguldījumus pieņemošas sabiedrības, izņemot centrālo banku” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.123 “naudas tirgus fondi” (S.122 saskaņā ar EKS 95), — S.124 “ieguldījumu fondi, izņemot naudas tirgus fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.125 “citi finanšu starpnieki, izņemot apdrošināšanas sabiedrības un pensiju fondus” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.126 “finanšu palīgsabiedrības” (S.124 saskaņā ar EKS 95), — S.127 “piesaistītās finanšu iestādes un naudas aizdevēji” (S.123 saskaņā ar EKS 95), — S.128 “apdrošināšanas sabiedrības (AS)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.129 “pensiju fondi (PF)” (S.125 saskaņā ar EKS 95), — S.13 “valdība” (S.13 saskaņā ar EKS 95).	Emitenta sektors EKS, rezidences valsts.	Atlikuma summa vai tirgus kapitalizācija euro, kas izteikta kā “kapitalizācija”, proti, atlikuma un tirgus kapitalizācijas kopsumma katram emitentam.

([1]) Kategoriju numerācija atbilst numerācijai, kas ieviesta ar priekšlikumu Eiropas Parlamenta un Padomes regulai par Eiropas nacionālo un reģionālo kontu sistēmu Eiropas Savienībā (COM(2010) 774 galīgā redakcija).

II PIELIKUMS

DKP SISTĒMĀ IETVERTĀS PLŪSMAS UN IZVADES PLŪSMAS DATU ATRIBŪTI

DKP sistēma aptver šādas plūsmas, kas izmantojamas dažādām vajadzībām:

— plūsma, kas izmantojama ārējai statistikai (EXT 1.0),

— finanšu instrumentsabiedrību plūsma, kas izmantojama statistikai par finanšu instrumentsabiedrībām (FVC 1.0),

— ieguldījumu fondu plūsma, kas izmantojama statistikai par ieguldījumu fondiem (IF 1.0),

— vērtspapīru turējumu plūsma, kas izmantojama statistikai par vērtspapīru turējumiem (SHS 1.0),

— valdības vērtspapīru plūsma, kas izmantojama statistikai par valdības vērtspapīru finansēšanu (GSF 1.0).

Izvades plūsmas datu atribūti, kas veido izmantojamas plūsmas:

Izvades plūsmas datu atribūta nosaukums	Apraksts	Piemērojamā plūsma				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (Starptautiskais vērtspapīru identifikācijas numurs (*ISIN*))	*ISIN* vērtspapīru identifikators.	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (Instrumenta klase Eiropas kontu sistēmā (EKS))	Vērtspapīra klasifikācija saskaņā ar EKS.	√	√	√	√	√
Debt type (Parāda veids)	Parāda instrumenta veids.				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Atribūts, kuru var izmantot tādu vērtspapīru identificēšanai, kas būtu jāiekļauj "tekošā atlikuma summas" kategorijā atbilstīgi ECB SEC definīcijām.					√
Instrument supplementary class (Instrumenta papildu klase)	Papildatribūts, kas ļauj identificēt to, vai vērtspapīrs ir iekļaujams *SEC*. Atribūtam var būt tādas vērtības kā "1" = sadalīta vērtspapīra kupons, "2" = sadalīta vērtspapīra pamatdaļa utt.					√
Security status (Vērtspapīra statuss)	Papildatribūts, kas ļauj identificēt to, vai vērtspapīrs ir iekļaujams *SEC*. Šis atribūts var norādīt, vai instruments ir aktīvs.					√
Asset securitisation type (Veids aktīvu pārvēršanai vērtspapīros)	Veids, kādā aktīvus pārvērš vērtspapīros.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Atribūts parāda, vai instrumentu drīkst izmantot kā nodrošinājumu Eurosistēmas kredītoperācijās.				√	
Nominal currency (Nomināla valūta)	Instrumenta nominālā valūta (Starptautiskā Standartu organizācija (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Izvades plūsmas datu atribūta nosaukums	Apraksts	Piemērojamā plūsma				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (Emisijas diena)	Diena, kurā emitents vērtspapīrus pret atlīdzību nodod emisijas izplatītājam. Šajā dienā vērtspapīri ir pieejami ieguldītājiem pirmo reizi. Piezīme: sadalīta vērtspapīra gadījumā šajā ailē norāda dienu, kad kupons/pamatdaļa tiek sadalīti.	√	√	√	√	√
Maturity date (Dzēšanas termiņš)	Diena, kurā parāda instruments tiek faktiski dzēsts.	√	√	√	√	√
Residual maturity (Atlikušais termiņš)	Atlikušais termiņš, ko nosaka dienā, kad tiek turpināta tā apgrozība.					√
Issuer domicile country (Emitenta domicila valsts)	Valsts, kurā atrodas vērtspapīra emitenta juridiskā atrašanās vieta (domicils) (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (Emitenta sektors EKS)	Emitenta institucionālais sektors atbilstīgi EKS.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (Emitenta klasifikācija atbilstīgi Eiropas ekonomiskās darbības klasifikācijai (*NACE*))	Galvenā saimnieciskā darbība atbilstīgi *NACE* klasifikācijai.	√				
Amount issued (Emisijas summa)	Parāda instrumenta summa emitēšanas brīdī (pēc nominālvērtības). Sadalīta vērtspapīra gadījumā šajā ailē norāda kupona/pamatdaļas sadalījuma summu. Tāda vērtspapīra gadījumā, kura emisija ir kvotēta, šajā ailē ar vienu *ISIN* norāda līdz attiecīgajam brīdim emitēto vērtspapīru kopsummu. Emisijas summu norāda nominālajā valūtā.					√
Amount outstanding (Atlikuma summa)	Atlikuma summa ir nominālvērtība. Tāda vērtspapīra gadījumā, kura emisija ir kvotēta, šajā ailē ar vienu *ISIN* norāda līdz attiecīgajam brīdim emitēto vērtspapīru kopsummu, atskaitot dzēsto daļu. Atlikuma summu norāda nominālajā valūtā. Ja nominālā valūta nav pieejama, atlikuma summu norāda euro.	√			√	√
Amount outstanding in euro (Atlikuma summa euro)	Atlikuma summa, kas konvertēta euro pēc tās dienas euro un nominālās valūtas maiņas kursa, kad tiek turpināta vērtspapīra apgrozība.				√	√
Market capitalisation (Tirgus kapitalizācija)	Jaunākā pieejamā tirgus kapitalizācija. Tirgus kapitalizāciju norāda nominālajā valūtā. Ja nominālā valūta nav pieejama, tirgus kapitalizāciju norāda euro.				√	

Izvades plūsmas datu atribūta nosaukums	Apraksts	Piemērojamā plūsma				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Peļņa līdz dzēšanai)	Gaidāmā peļņa līdz dzēšanai, kas attiecas uz vērtspapīriem un ko izsaka procentos.				√	√
Short name (Īsais nosaukums)	Īss nosaukums, kuru piešķīris emitents un kura pamatā ir emisijas īpatnības un visa pieejamā informācija.					√
Pool factor (Ieguldījumu rādītājs)	Attiecībā uz vērtspapīriem, kas nodrošināti ar hipotēkām, ieguldījumu rādītāju jeb galvenās bilances rādītāju iegūst, vērtspapīra nodrošinājuma hipotēkas galvenās bilances atlikumu dalot ar sākotnējo galveno bilanci.	√	√	√	√	√
Quotation basis (Kotēšanas bāze)	Instrumenta kotēšanas bāze, piem., procenti no nomināla (procentos) vai valūtas daudzums par vienu akciju/vienību (vienībās).	√	√	√	√	√
Price value (Cenas vērtība)	Pēdējā pieejamā raksturīgā instrumenta kotēšanas cena atsauces dienā, kas attiecīgā gadījumā izteikta nominālajā valūtā. Procentu vērtspapīru gadījumā šī ir "tīra cena", proti, bez uzkrātajiem procentiem.	√	√	√	√	√
Price value type (Cenas vērtības veids)	Cenas vērtības pazīmes, proti, vai tās pamatā ir tirgus, prognozētā vai sākotnējā vērtība.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Mēneša vidējā cena)	Vidējais lielums no instrumenta parastajām kotēšanas cenām pēdējās 30 kalendārajās dienās pirms atsauces dienas, kas izteikts nominālajā valūtā.	√			√	
Redemption type (Dzēšanas veids)	Dzēšanas veids, piem., dzēšana vienā summā termiņa beigās, vairākkārtīga dzēšana, strukturēta dzēšana, dzēšana gada rentes veidā, atkārtota dzēšana, neregulāra dzēšana, dzēšana spēkā neesamības dēļ, dzēšana ar fiksēti-mainīgo likmi.					√
Redemption frequency (Dzēšanas biežums)	Parāda instrumenta dzēšanas biežums gadā.					√
Redemption price (Dzēšanas cena)	Galīgā dzēšanas cena.					√
Accrued interest (Uzkrātie procenti)	Procenti, kas uzkrāti kopš pēdējā kuponu maksājuma vai procentu uzkrāšanas sākuma dienas. Ja procentu vērtspapīriem šo vērtību summē ar cenas vērtību, iegūst tā saucamo "netīro vērtību".	√	√	√		√
Accrued income factor (Uzkrāto procentu ienākumu rādītājs)	Ar vērtspapīriem saistītu dienas ienākumu rādītājs procentos, ko aprēķina, skatot no debitora skatu punkta. Rādītāja pamatā ir uzkrātie maksājumi, proti, tiek apvienoti uzkrātie procenti un ienākumi, kas rodas emisijas un dzēšanas cenu starpības rezultātā.	√	√	√	√	

Izvades plūsmas datu atribūta nosaukums	Apraksts	Piemērojamā plūsma				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Kupona veids)	Kupona veids, piem., ar fiksēto likmi, ar mainīgo limi, ar fiksēti-mainīgo likmi utt.				√	√
Last coupon rate (Pēdējā kupona likme)	Pēdējā faktiski izmaksātā kupona likme procentos gadā (gada likme).	√	√	√	√	
Last coupon date (Pēdējā kupona diena)	Diena, kurā pēdējo reizi faktiski izmaksāta kupona likme. Atribūts ļauj identificēt, vai samaksātā kupona likmes summa iekļaujama ziņošanas periodā.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Pēdējais kupona biežums)	Pēdējās kupona likmes izmaksas biežums gadā: "vienu reizi gadā" tiek pārveidots par "*AN*", "vairākas reizes gadā" tiek pārveidots par "*SA*" utt.	√	√	√	√	
Dividend amount (Dividenžu summa)	Pēdējā dividenžu maksājuma summa vienai akcijai (norādot dividenžu summas veidu) pirms nodokļu piemērošanas (bruto dividende).	√		√	√	
Dividend amount type (Dividenžu summas veids)	Dividenžu maksājuma summu vienai akcijai var noteikt dividenžu valūtā vai noteikta skaitā akciju.	√		√	√	
Dividend currency (Dividenžu valūta)	Pēdējā dividenžu maksājuma norēķinu valūtas ISO 4217 kods.	√		√	√	
Dividend Settlement date (Dividenžu maksājuma norēķinu diena)	Pēdējā dividenžu maksājuma norēķinu diena. Atribūts ļauj identificēt, vai samaksātā dividenžu summa iekļaujama ziņošanas periodā.	√		√	√	
Last split factor (Pēdējās dalīšanas rādītājs)	Akciju dalīšana un reversā akciju dalīšana.	√		√	√	
Last split date (Pēdējās dalīšanas diena)	Diena, kurā notikusi pēdējā akciju dalīšanas operācija.	√		√	√	