RICHTSNOEREN

RICHTSNOER VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK

van 26 september 2012

inzake het beheerskader betreffende de kwaliteit van gegevens voor de gecentraliseerde effectendatabase

(ECB/2012/21)

(2012/689/EU)

DE RAAD VAN BESTUUR VAN DE EUROPESE CENTRALE BANK,

Gelet op de statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank, inzonderheid op artikel 5.1, artikel 12.1 en artikel 14.3,

Gelet op Verordening (EG) nr. 2533/98 van de Raad van 23 november 1998 met betrekking tot het verzamelen van statistische gegevens door de Europese Centrale Bank [1],

Overwegende hetgeen volgt:

(1) De gecentraliseerde effectendatabase (CSDB) is een gemeenschappelijke infrastructuur voor informatietechnologie die door de leden van het Europees Stelsel van centrale banken (ESCB) gezamenlijk wordt beheerd, zulks met inbegrip van de nationale centrale banken (NCB's) van de lidstaten buiten het eurogebied ingeval die NCB's vrijwillig deelnemen aan het CSDB-beheer. De CSDB slaat itemsgewijs gegevens op, met name betreffende effecten, hun emittenten en prijzen.

(2) Gegevens worden uit diverse bronnen verzameld, waaronder van ESCB-leden, bepaalde verstrekkers van commerciële gegevens, het publieke domein en administratieve bronnen, en verzonden naar de CSDB. Echter, er is een risico dat dergelijke inputgegevens onnauwkeurig of onvolledig zijn. Het CSDB-systeem kan deels inconsistente inputgegevens uit verschillende bronnen herleiden en onvolledige of ontbrekende gegevens detecteren. Voor zover mogelijk stelt het CSDB-systeem uit inputgegevens van verscheidene overlappende bronnen één volledig bestand van hoge kwaliteit samen.

(3) De globale kwaliteit van CSDB-gegevens kan slechts op het niveau van de outputgegevens worden beoordeeld en niet op het niveau van aparte reeksen van inputgegevens. Teneinde de volledigheid, nauwkeurigheid en consistentie van outputgegevens te verzekeren, voor zover mogelijk, is het noodzakelijk een kader op te zetten voor het beheer van gegevenskwaliteit (DQM) dat wordt toegepast op de aangeleverde outputgegevens, een subreeks van outputgegevens die onder meer statistiekenproductie kan ondersteunen. De aangeleverde outputgegevens worden niet later dan zeven werkdagen volgende op het einde van iedere kalendermaand aan NCB's verstrekt.

(4) Soms omvatten aangeleverde outputgegevens attributen zoals prijzen of aan inkomens gerelateerde informatie die naar verwachting zal fluctueren. Deze attributen worden door het CSDB-systeem middels statistische algoritmes automatisch geverifieerd. Slechts in bijlage I voor iedere DQM-doelstelling opgenomen attributen zijn onderworpen aan verificatie door de bevoegde autoriteiten, zulks overeenkomstig dit richtsnoer. De volledige in bijlage II opgenomen attributenlijst vormt de ondersteunde feeds.

(5) Het CSDB DQM-kader dient te worden toegepast op aangeleverde outputgegevens, zulks ongeacht de bron van de inputgegevens. Het kader dient de verantwoordelijkheden van de NCB's van het eurogebied voor de kwaliteit van outputgegevens in de CSDB te stipuleren en, indien toepasselijk, die van de Europese Centrale Bank (ECB).

(6) Het CSDB DQM-kader dient ten eerste gebaseerd te zijn op DQM-doelstellingen die indicatoren zijn voor de beoordeling van de kwaliteit van de aangeleverde outputgegevens en, ten tweede, op DQM-maatstaven die voor iedere betrokken DQM-doelstelling de toe te voegen en te verifiëren outputgegevens vaststellen en prioriteren. Het CSDB-kader dient tevens gebaseerd te zijn op DQM-drempels die met betrekking tot een DQM-doelstelling het minimumverificatieniveau vaststellen.

(7) Bij gebreke van benchmarkgegevens, stellen DQM-doelstellingen niet altijd afwijkingen in aangeleverde outputgegevens vast, maar kunnen slechts gevallen indiceren waarin manuele verificatie van aangeleverde outputgegevens is vereist.

(8) Aangezien de CSDB gezamenlijk door alle ESCB-leden wordt beheerd, dienen zij hantering van dezelfde DQM-normen na te streven. Bovendien kunnen de NCB's buiten het eurogebied het beste het DQM uitvoeren inzake gegevens die zijn gerelateerd aan in hun respectieve lidstaten gevestigde emittenten. Enerzijds zij erkend dat de door de ECB vastgestelde richtsnoeren geen verplichtingen kunnen opleggen aan NCB's buiten het eurogebied,

[1] PB L 318 van 27.11.1998, blz. 8.

anderzijds is artikel 5 van de Statuten van het Europees Stelsel van centrale banken en van de Europese Centrale Bank van toepassing op NCB's van het eurogebied en op NCB's buiten het eurogebied. NCB's buiten het eurogebied dienen derhalve alle maatregelen uit te werken en te implementeren die zij passend achten voor de uitvoering van het DQM overeenkomstig dit richtsnoer.

(9) Ter verbetering van de kwaliteit van outputgegevens dient het beheer van gegevensbronnen (DSM) de vaststelling en correctie van zich herhalende en structurele afwijkingen van inputgegevens te beogen, zulks rechtstreeks met de gegevensverstrekker,

HEEFT HET VOLGENDE RICHTSNOER VASTGESTELD:

Artikel 1

Definities

In dit Richtsnoer wordt verstaan onder:

1. „CSDB": de door het ESCB opgezette en de in de ECB gevestigde gecentraliseerde effectendatabase;

2. „inputgegevens": uit één of meerdere gegevensbronnen aan het CSDB verstrekte gegevens;

3. „outputgegevens": automatisch in het CSDB afgeleide gegevens door uit invoergegevens één volledig bestand van hoge kwaliteit samen te stellen;

4. „aangeleverde outputgegevens": een subreeks van outputgegevens en kenmerken opgesomd in bijlage II die dient tot ondersteuning van statistiekenproductie of andere doeleinden;

5. „Beheer gegevenskwaliteit" of „DQM": waarborging, verificatie en handhaving van de kwaliteit van aangeleverde outputgegevens middels het gebruik en de toepassing van DQM-doelstellingen, DQM-maatstaven, DQM-drempels en de DQM-werkzaamheden;

6. „Beheer gegevensbronnen" of „DSM": de vaststelling en correctie van zich herhalende en/of structurele afwijkingen van inputgegevens, zulks rechtstreeks met de gegevensverstrekker,

7. „initiële DQM": een DQM van aangeleverde outputgegevens, waaronder gegevens die de meest recente periode bestrijken, maandelijks uitgevoerd door de inzake DQM bevoegde autoriteiten rekening houdend met de per maandultimoprognose aangeleverde outputgegevens;

8. „reguliere DQM": DQM van aangeleverde outputgegevens, maandelijks uitgevoerd door inzake DQM bevoegde autoriteiten, rekening houdend met niet-CSDB benchmarkgegevens, verstrekt uit diverse gegevensbronnen teneinde te verzekeren dat de kwaliteit van CSDB-outputgegevens voldoet aan de vereisten voor CSDB-invoergegevens;

9. „DQM-doelstelling": een in bijlage I opgenomen benchmark voor de beoordeling van de kwaliteit van de aangeleverde outputgegevens;

10. „DQM-maatstaf": een statistische indicator die conform bijlage I het niveau meet waarin een bepaalde DQM-doelstelling is behaald;

11. „DQM-drempel": het minimumniveau van uit te voeren verificaties opdat wordt voldaan aan de vereisten van het DQM-kader voor een DQM-doelstelling;

12. „DQM-werkzaamheden": een technisch proces voor de correctie van inputgegevens om te voldoen aan een DQM-drempel;

13. „maandultimoprognose": een reguliere maandelijkse bijwerking van outputgegevens en DQM-maatstaven met als resultaat een inschatting van outputgegevens voor de aanstaande maandultimostatus;

14. „werkdag": is een volledige dag waarop TARGET2 is geopend, zoals bekendgemaakt op de ECB-website;

15. „verificatie": het proces inhoudende de controle van CSDB-aangeleverde outputgegevens door de inzake DQM bevoegde autoriteiten en, indien noodzakelijk, de correctie van CSDB-inputgegevens aldus toepassing gevend aan de DQM-werkzaamheden;

16. „ingezetene": zoals gedefinieerd in artikel 1 van Verordening (EG) nr. 2533/98.

Artikel 2

Onderwerp en werkingssfeer

1. Dit richtsnoer voert in de CSDB een DQM-kader in, teneinde de volledigheid, nauwkeurigheid en consistentie van outputgegevens in de CSDB te verzekeren door de consistente toepassing van regels inzake kwaliteitsnormen voor dergelijke gegevens.

2. Het CSDB DQM-kader berust op het DQM en het DSM.

Artikel 3

Inzake DQM bevoegde autoriteiten

1. De NCB van een lidstaat van het eurogebied waarvan een effectenemittent ingezetene is, is bevoegd voor het DQM van de met die emittent verband houdende gegevens.

2. De ECB is bevoegd voor het DQM van gegevens die verband houden met buiten het eurogebied ingezetene emittenten, tenzij een NCB buiten het eurogebied aanvaard heeft het DQM voor gegevens uit te voeren welke verband houden met in zijn lidstaat ingezetene emittenten.

Artikel 4

DQM, DQM-maatstaven en DQM-drempels

1. Inzake DQM bevoegde autoriteiten voeren initiële en reguliere DQM's uit. Zulks behelst de verificatie van aangeleverde outputgegevens, ongeacht de bron ervan.

2. Inzake DQM bevoegde autoriteiten passen DQM-maatstaven overeenkomstig bijlage I toe.

3. Voor de door bijlage I bestreken attributen passen inzake DQM bevoegde autoriteiten DQM-drempels toe op een niveau dat de kwaliteit waarborgt van aangeleverde outputgegevens overeenkomstig de vereisten om het in bijlage II vastgelegde gebruik voor deze respectieve attributen te ondersteunen.

Artikel 5

Initiële DQM

1. De initiële DQM wordt toegepast op de in bijlage I vastgelegde DQM-doelstellingen 1, 2, 3a, 3b en 6.

2. Zeven werkdagen voor het einde van elke kalendermaand stelt de ECB de maandultimoprognose beschikbaar.

3. De initiële DQM behelst dat de inzake DQM bevoegde autoriteiten substantiële statistische uitschieters verifiëren opdat na de initiële DQM voor zover mogelijk verzekerd is dat de aangeleverde outputgegevens de meest recente ontwikkelingen weergeven.

4. Inzake DQM bevoegde autoriteiten verifiëren de maandultimoprognosegegevens voor het einde van de tweede werkdag van de volgende kalendermaand voor zover luidens de DQM-maatstaven niet aan de DQM-drempels is voldaan.

5. Zonder buiten de CSDB beschikbare benchmarkgegevens gaat de initiële DQM slechts uit van informatie die voor de inzake DQM bevoegde autoriteit direct beschikbaar is, dan wel van direct beschikbare informatie die geen nieuwe verslagleggingsstructuur behoeft.

6. De inzake DQM bevoegde autoriteiten corrigeren inputgegevens overeenkomstig de DQM-werkzaamheden middels het CSDB-systeem dan wel door de ECB bestanden met inputgegevens te verstrekken, al naargelang.

Artikel 6

Reguliere DQM

1. Het reguliere DQM wordt toegepast op de in bijlage I vastgelegde DQM-doelstellingen 3a, 3b, 4, 5 en 6.

2. De inzake DQM bevoegde autoriteiten voeren binnen één maand volgende op het einde van iedere kalendermaand een reguliere DQM uit. Rekening houdend met alle doorgaans beschikbare informatie verifiëren zij aangeleverde outputgegevens, zulks niet later dan de tweede werkdag van de kalendermaand volgende op de maand waarin de reguliere DQM werd uitgevoerd.

3. De inzake DQM bevoegde autoriteiten corrigeren inputgegevens overeenkomstig de overeengekomen DQM-werkzaamheden middels het CSDB-systeem dan wel door de ECB bestanden met inputgegevens te verstrekken, al naargelang.

Artikel 7

Met DSM verband houdende taken

1. De inzake DQM bevoegde autoriteiten stellen DSM-kwesties vast die zij aan de ECB rapporteren.

2. Binnen één maand na de datum waarop een DSM-kwestie aan de ECB werd gerapporteerd, adresseert de ECB in samenwerking met de betrokken inzake DQM bevoegde autoriteiten zich herhalende met het DSM verband houdende hogeprioriteitsfouten.

Artikel 8

Correcties van invoergegevens

Op voorwaarde dat een inzake DQM bevoegde autoriteit verbeterde invoergegevens heeft, gebruikt zij het CSDB-systeem om tijdens de verificatie van artikel 5, lid 4, niet-gecorrigeerde afwijkingen en omissies in haar inputgegevens te corrigeren.

Artikel 9

Jaarlijks kwaliteitsverslag

Rekening houdend met het standpunt van het ESCB-Comité Statistieken rapporteert de ECB-directie jaarlijks aan de Raad van bestuur inzake de kwaliteit van de aangeleverde outputgegevens.

Artikel 10

Vereenvoudigde wijzigingsprocedure

Rekening houdend met het standpunt van het ESCB-Comité Statistieken is de ECB-directie bevoegd technische wijzigingen in de bijlagen bij dit richtsnoer door te voeren, mits dergelijke wijzigingen het onderliggende conceptuele kader van het richtsnoer niet veranderen, waaronder de verdeling van verantwoordelijkheden tussen de ECB en de NCB's, noch een wezenlijk effect hebben op de rapportagelast van de inzake DQM bevoegde autoriteiten. De directie stelt de Raad van bestuur onverwijld in kennis van een dergelijke wijziging.

Artikel 11

Inwerkingtreding

1. Dit richtsnoer treedt op 1 november 2012 in werking.

2. Dit richtsnoer is van toepassing met ingang van 1 juli 2013.

Artikel 12

Geadresseerden

Dit richtsnoer is gericht tot alle centrale banken van het Eurosysteem.

Gedaan te Frankfurt am Main, 26 september 2012.

Namens de Raad van bestuur van de ECB
De president van de ECB
Mario DRAGHI

BIJLAGE I

DQM-DOELSTELLINGEN, IMPLEMENTATIE, ATTRIBUTEN EN GRONDSLAG DQM-DREMPEL

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
Doelstelling 1: **Gegevensstabiliteit — standengegevens**	Concept: De maatstaf wordt voor elke combinatie land van ingezetene/sector gedefinieerd als een volumegewogen „mutatie-index", gewogen met monetaire bedragen. Een indexwaarde 1 betekent dat het respectieve attribuut voor geen van de onderliggende effecten is veranderd, terwijl een indexwaarde van 0 betekent dat het respectieve attribuut voor alle effecten is veranderd. Bij een index lager dan 1 worden afzonderlijke effecten middels het veranderde attribuut, dat de indexdaling heeft veroorzaakt, geïdentificeerd, teneinde de verandering te verifiëren tot de drempel wordt gehaald. Oorzaken van een indexmutatie: Voor discrete attributen geldt dat enig verschil van maand tot maand in het attribuut geacht wordt een indexmutatie te veroorzaken. Voor continue attributen geldt dat enig verschil van maand tot maand groter dan 25 % geacht wordt een indexmutatie te veroorzaken. Bereik: Deze DQM-maatstaf bestrijkt alle aandelen of rechten van deelneming in beleggingsfondsen, aandelen en schuldbewijzen, waaronder certificaten met een looptijd van hoogstens drie maanden.	Doelstelling 1 beoordeelt de stabiliteit van standengegevens. Niet-geverifieerde veranderingen van CSDB-attributen verlagen het aandeel van stabiele gegevens niet verder dan de DQM-drempel voor elk van de volgende emittentensectoren van het Europees Stelsel van rekeningen (ESR) ([1]): — S.11 „niet-financiële vennootschappen" (S.11 volgens ESR 95) — S.121 „de centrale bank" (S.121 volgens ESR 95) — S.122 „deposito-instellingen met uitzondering van de centrale bank" (S.122 volgens ESR 95) — S.123 „geldmarktfondsen (MMF)" (S.122 volgens ESR 95) — S.124 „beleggingsfondsen m.u.v. geldmarktfondsen" (S.123 volgens ESR 95) — S.125 „overige financiële intermediairs m.u.v. verzekeringsinstellingen en pensioenfondsen" (S.123 volgens ESR 95) — S.126 „financiële hulpbedrijven" (S.124 volgens ESR 95) — S.127 „financiële instellingen en kredietverstrekkers binnen concernverband" (S.123 volgens ESR 95) — S.128 „verzekeringsinstellingen (IC)" (S.125 volgens ESR 95) — S.129 „pensioenfondsen (PF)" (S.125 volgens ESR 95) — S.13 „overheid" (S.13 volgens ESR 95)	Expliciete attributen: emissiedatum voor schuld, looptijd voor schuld, nominale valuta, noteringsgrondslag, instrument ESR-categorie, emittent land van ingezetene, ESR-emittentensector, emittentclassificatie in Europese Classificatie van economische activiteiten (NACE), uitstaande bedragen, aantal uitstaande aandelen voor beursgenoteerde aandelen.	Uitstaande bedragen of marktkapitalisatie in euro, als deel van standengegevens.

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
Doelstelling 2: **Nauwkeurigheid gegevens — nieuwe emissies en aflossingen; netto-emissies**	Concept: De maatstaf wordt vastgesteld voor elke combinatie land van ingezetene/sector en bestrijkt nieuwe emissies, aflossingen en uitstaande bedragen van schuldbewijzen uitgedrukt in percentages. De maatstaf verbindt de netto-emissiesactiviteit in de loop van de maand met het uitstaande bedrag aan het einde van de vorige maand (mutatie in procenten) en monitort de relatieve ontwikkeling van uitstaande schuld. Toegang tot uitgesplitste gegevens wordt mogelijk tot het niveau van afzonderlijke nieuwe emissies en aflossingen die de mutatie in uitstaande bedragen hebben veroorzaakt. Deze ontwikkeling wordt geverifieerd tot de drempel wordt gehaald.	Doelstelling 2 beoordeelt nieuwe emissies en aflossingen tegenover de respectieve standengegevens. Niet-geverifieerde gegevens inzake uitstaande bedragen van nieuwe emissies en aflossingen van schuldbewijzen uitgedrukt als percentage, overschrijdt in nettotermen voor elk van de volgende ESR-emittentensectoren de DQM-drempel niet: — S.11 „niet-financiële vennootschappen” (S.11 volgens ESR 95) — S.121 „de centrale bank” (S.121 volgens ESR 95) — S.122 „deposito-instellingen met uitzondering van de centrale bank” (S.122 volgens ESR 95) — S.123 „geldmarktfondsen (MMF)” (S.122 volgens ESR 95) — S.124 „beleggingsfondsen m.u.v. geldmarktfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.125 „overige financiële intermediairs m.u.v. verzekeringsinstellingen en pensioenfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.126 „financiële hulpbedrijven” (S.124 volgens ESR 95) — S.127 „financiële instellingen en kredietverstrekkers binnen concernverband” (S.123 volgens ESR 95) — S.128 „verzekeringsinstellingen (IC)” (S.125 volgens ESR 95) — S.129 „pensioenfondsen (PF)” (S.125 volgens ESR 95) — S.13 „overheid” (S.13 volgens ESR 95)	Expliciete attributen: uitstaand bedrag. Impliciete attributen: emissiedatum, looptijd, nominale valuta, noteringsgrondslag, instrument ESR-indeling, emittent land van ingezetene, ESR-emittentensector.	In euro luidende uitstaande bedragen, uitgedrukt als relatieve ontwikkeling vergeleken met respectieve standengegevens.

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
Doelstelling 3a: **Nauwkeurigheid gegevens — ondersteuning juiste sectortoedeling en data-extractie door emittent**	Conceptuele achtergrond: De CSDB koppelt relationele informatie inzake emittenten en instrumenten, typeerbaar als „één tot meerdere", d.w.z. één emittent kan gerelateerd zijn aan meerdere instrumenten, terwijl ieder instrument gerelateerd is aan slechts één emittent. Deze instrument-emittentlink komt tot stand middels afzonderlijke emittentidentificatiecodes die verstrekkers van inputgegevens verstrekken. Deze identificatiecodes van de gegevensverstrekkers verschillen onderling bij gebreke van een gemeenschappelijke norm, zij dienen evenwel consistent te zijn. Indien verstrekkers van inputgegevens voor hetzelfde instrument inconsistente (conflicterende) emittentenidentificatiecodes verstrekken, d.w.z. zij verschillen van mening over de emittent, kan het instrument niet aan een specifieke emittent worden toegedeeld en belandt in een „conflictgroep". Conflictgroepen kunnen per land en sector wel correct geclassificeerd worden, maar de consistente link met de betrokken emittent van het instrument ontbreekt. Instrumenten in conflictgroepen verhinderen consistente en betrouwbare extractie van alle door een bepaalde emittent uitgegeven instrumenten. Instrumenten in conflictgroepen verhogen het risico van een foutieve indeling per land van ingezetene of sector. Concept: Voor elk land van ingezetene stelt de maatstaf de instrumenten in conflictgroepen vast en koppelt die aan alle instrumenten voor dat land als een procentueel aandeel van aantallen of monetaire bedragen. Bereik: De maatstaf bestrijkt alle instrumenten in de CSDB.	Doelstelling 3a beoordeelt de correcte identificatie van de emittentenpopulatie. Is er geen overeenstemming inzake de emittent van een instrument, d.w.z. instrumenten in „conflictgroepen", dan gaan die instrumenten de DQM-drempel niet te boven.	Expliciete attributen: emittentenidentificatiecode voor groepering.	In euro luidende uitstaande bedragen die verwijzen naar instrumenten in conflictgroepen, als een percentage van alle instrumenten.

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
Doelstelling 3b: **Nauwkeurigheid gegevens — ondersteuning juiste sectortoedeling en data-extractie door emittent**	Conceptuele achtergrond: De CSDB koppelt relationele informatie inzake emittenten en instrumenten, typeerbaar als „één tot meerdere", d.w.z. één emittent kan gerelateerd zijn aan meerdere instrumenten, terwijl ieder instrument gerelateerd is aan slechts één emittent. Deze instrument-emittentlink komt tot stand middels afzonderlijke emittentidentificatiecodes die verstrekkers van inputgegevens verstrekken. Deze identificatiecodes van de gegevensverstrekkers verschillen onderling bij gebreke van een gemeenschappelijke norm, zij dienen evenwel consistent te zijn. Indien voor een bepaald instrument geen van de gegevensverstrekkers een emittentidentificatiecode verstrekt, kan dit instrument wellicht niet aan een bepaalde emittent worden toegedeeld en belandt in een „„op zich staande" groep", slechts bestaande uit dit instrument. „Op zich staande" groepen kunnen per land en sector wel correct geclassificeerd worden, maar de consistente link met de betrokken emittent van het instrument ontbreekt. Instrumenten in „op zich staande" groepen verhinderen consistente en betrouwbare extractie van alle door een bepaalde emittent uitgegeven instrumenten. Instrumenten in „op zich staande" groepen verhogen het risico van een foutieve indeling per land van ingezetene of sector aangezien hun vaak onvolledige informatie verstrekt wordt. Concept: Voor elk land van ingezetene stelt de maatstaf de instrumenten in „op zich staande" groepen vast en koppelt die aan alle instrumenten voor dat land als een procentueel aandeel van aantallen of monetaire bedragen.	Doelstelling 3b beoordeelt de correcte identificatie van de emittentenpopulatie. Is er geen betrouwbare informatie inzake de emittent van een instrument, d.w.z. instrumenten in „op zich staande" groepen, dan gaan die instrumenten de DQM-drempel niet te boven.	Expliciete attributen: emittentenidentificatiecode voor groepering.	In euro luidende uitstaande bedragen die verwijzen naar instrumenten in „op zich staande" groepen, als een percentage van alle instrumenten.

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
	Bereik: De maatstaf bestrijkt alle instrumenten in de CSDB.			
Doelstelling 4: **Nauwkeurigheid van gegevens — bedrag aan uitstaande schuldbewijzen, waaronder certificaten**	Concept: De maatstaf aggregeert uitstaande bedragen voor schuldbewijzen, waaronder certificaten, per land van ingezetene van iedere emittent en per emittentensector conform het concept van emissiesstatistiek (SEC). Dit totaal wordt vergeleken met het respectieve SEC-cijfer en de procentuele afwijking van de CSDB-gegevens wordt berekend. Niet-geverifieerde en niet-toegelichte verschillen gaan de DQM-drempel niet te boven.	Doelstelling 4 vergelijkt CSDB-outputgegevens met externe benchmarkgegevens. Niet-geverifieerde en niet-toegelichte verschillen tussen geaggregeerde CSDB-gegevens en de respectieve informatie van de ECB, SEC of andere betrouwbare benchmarks gaan de DQM-drempel voor dezelfde referentiedatum voor ieder van de volgende ESR-emittentensectoren niet te boven, zulks onderworpen aan de beschikbaarheid van dergelijke benchmarkgegevens: — S.11 „niet-financiële vennootschappen” (S.11 volgens ESR 95) — S.121 „de centrale bank” (S.121 volgens ESR 95) — S.122 „deposito-instellingen met uitzondering van de centrale bank” (S.122 volgens ESR 95) — S.123 „geldmarktfondsen (MMF)” (S.122 volgens ESR 95) — S.124 „beleggingsfondsen m.u.v. geldmarktfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.125 „overige financiële intermediairs m.u.v. verzekeringsinstellingen en pensioenfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.126 „financiële hulpbedrijven” (S.124 volgens ESR 95) — S.127 „financiële instellingen en kredietverstrekkers binnen concernverband” (S.123 volgens ESR 95) — S.128 „verzekeringsinstellingen (IC)” (S.125 volgens ESR 95) — S.129 „pensioenfondsen (PF)” (S.125 volgens ESR 95) — S.13 „overheid” (S.13 volgens ESR 95)	Expliciete attributen: in euro luidend uitstaand bedrag, marktkapitalisatie in euro. Impliciete attributen: emissiedatum, vervaldag, valuta, ESR-emittentensector, land van ingezetene.	Uitstaande bedragen of marktkapitalisatie in euro, uitgedrukt als een procentueel verschil tussen CSDB en externe benchmark.

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
Doelstelling 5: **Nauwkeurigheid van gegevens — marktkapitalisatie aandelen**	Concept: De maatstaf aggregeert marktkapitalisatie voor gewone aandelen per land van ingezetene van iedere emittent en iedere emittentensector conform het concept van emissiesstatistiek. Dit totaal wordt vergeleken met het respectieve SEC-cijfer en de procentuele afwijking van de CSDB-gegevens wordt berekend. Niet-geverifieerde en niet-toegelichte verschillen gaan de DQM-drempel niet te boven.	Doelstelling 5 vergelijkt CSDB-outputgegevens met externe benchmarkgegevens. Niet-geverifieerde en niet-toegelichte verschillen tussen geaggregeerde CSDB-gegevens en de respectieve informatie van de ECB, SEC of andere betrouwbare benchmarks gaan de DQM-drempel voor dezelfde referentiedatum voor ieder van de volgende ESR-emittentensectoren niet te boven, zulks onderworpen aan de beschikbaarheid van benchmarkgegevens: — S.11 „niet-financiële vennootschappen” (S.11 volgens ESR 95) — S.121 „de centrale bank” (S.121 volgens ESR 95) — S.122 „deposito-instellingen met uitzondering van de centrale bank” (S.122 volgens ESR 95) — S.123 „geldmarktfondsen (MMF)” (S.122 volgens ESR 95) — S.124 „beleggingsfondsen m.u.v. geldmarktfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.125 „overige financiële intermediairs m.u.v. verzekeringsinstellingen en pensioenfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.126 „financiële hulpbedrijven” (S.124 volgens ESR 95) — S.127 „financiële instellingen en kredietverstrekkers binnen concernverband” (S.123 volgens ESR 95) — S.128 „verzekeringsinstellingen (IC)” (S.125 volgens ESR 95) — S.129 „pensioenfondsen (PF)” (S.125 volgens ESR 95) — S.13 „overheid” (S.13 volgens ESR 95)	Expliciete attributen: in euro luidende uitstaande bedragen, aantal uitstaande beursgenoteerde aandelen. Impliciete attributen: nominale valuta, ESR-emittentensector, land van ingezetene, waarde uitgedrukt in prijs voor beursgenoteerde aandelen (slechts uitschieters checken).	Uitstaande bedragen of marktkapitalisatie in euro, uitgedrukt als een procentueel verschil tussen CSDB en externe benchmark.

DQM-doelstelling	DQM-maatstaf	Implementatie	Attributen aangeleverde outputgegevens	Grondslag DQM-drempel
Doelstelling 6: **Nauwkeurigheid van gegevens — emittentenindeling**	Concept: De maatstaf rangschikt emittenten voor elk land van ingezetene/emittentensectorcombinatie conform het totaal van hun passiva op effectenbasis (aandelen en schuld in combinatie). De maatstaf vermeldt tevens absolute rangschikkingswijzigingen tussen de verschillende emittenten om de vaststelling van aanzienlijke uitschieters in uitstaande bedragen of marktkapitalisatie te vergemakkelijken. Het land van ingezetene en de sectorindeling van de emittent worden tot de DQM-drempel geverifieerd. Bereik: De maatstaf bestrijkt alle aandelen of rechten van deelneming in beleggingsfondsen, aandelen en schuldbewijzen met een looptijd van hoogstens drie maanden.	Doelstelling 6 beoordeelt de statistische indeling van emittenten. De statistische indeling van emittenten tot de DQM-drempel wordt voor ieder van de volgende ESR-emittentensectoren geverifieerd: — S.11 „niet-financiële vennootschappen” (S.11 volgens ESR 95) — S.121 „de centrale bank” (S.121 volgens ESR 95) — S.122 „deposito-instellingen met uitzondering van de centrale bank” (S.122 volgens ESR 95) — S.123 „geldmarktfondsen (MMF)” (S.122 volgens ESR 95) — S.124 „beleggingsfondsen m.u.v. geldmarktfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.125 „overige financiële intermediairs m.u.v. verzekeringsinstellingen en pensioenfondsen” (S.123 volgens ESR 95) — S.126 „financiële hulpbedrijven” (S.124 volgens ESR 95) — S.127 „financiële instellingen en kredietverstrekkers binnen concernverband” (S.123 volgens ESR 95) — S.128 „verzekeringsinstellingen (IC)” (S.125 volgens ESR 95) — S.129 „pensioenfondsen (PF)” (S.125 volgens ESR 95) — S.13 „overheid” (S.13 volgens ESR 95)	ESR-emittentensector, land van ingezetene.	Uitstaande bedragen of marktkapitalisatie in euro, vermeld als „kapitalisatie”, d.w.z. uitstaande bedragen plus marktkapitalisatie per emittent.

([1]) De nummering van categorieën volgt de in het voorstel voor een verordening van het Europees Parlement en de Raad betreffende het Europees systeem van nationale en regionale rekeningen in de Europese Unie (COM(2010) 774 final) ingevoerde nummering.

BIJLAGE II

DOOR HET DQM-KADER BESTREKEN FEEDS EN AANGELEVERDE OUTPUTGEGEVENS

Het DQM-kader bestrijkt de volgende feeds die zich lenen voor verschillende doeleinden:

— Feed die externe statistieken ondersteunt (EXT 1.0)

— Feed inzake lege financiële instellingen die statistieken inzake lege financiële instellingen ondersteunt (FVC 1.0)

— Feed inzake beleggingsfondsen die statistieken inzake beleggingsfondsen ondersteunt (IF 1.0)

— Feed inzake aangehouden effecten die statistieken inzake aangehouden effecten ondersteunt (SHS 1.0)

— Feed inzake de financiering door middel van staatsobligaties die statistieken inzake de financiering door middel van staatsobligaties ondersteunt (GSF 1.0).

Attributen inzake aangeleverde outputgegevens die de ondersteunde feeds vormen:

Output feed data attribute name (Naam van aangeleverde outputgegevens attribuut)	Beschrijving	Toepasselijke feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (Internationaal effectenidentificatienummer (ISIN))	ISIN-effectenidentificatiecode	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (Klasse instrument Europees Stelsel van rekeningen (ESR))	ESR-conforme effectenindeling	√	√	√	√	√
Debt type (Schuldsoort)	Soort schuldinstrument				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Een attribuut dat kan dienen tot identificatie van effecten die dienen te worden opgenomen onder „actuele uitstaande bedragen", zulks overeenkomstig de definities van de ECB en SEC.					√
Instrument supplementary class (Instrument aanvullende categorie)	Aanvullend attribuut waardoor al dan niet opname van een instrument onder SEC beoordeeld kan worden. Dit attribuut heeft waarden zoals 1 = „couponstrip", 2 = „hoofdsomstrip" enz.					√
Security status (Effectenstatus)	Aanvullend attribuut waardoor al dan niet opname van een instrument onder SEC beoordeeld kan worden. Dit attribuut vermeldt of een instrument al dan niet vervallen is.					√
Asset securitisation type (Activa securitisatiesoort)	Soort securitisatieactiva.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Attribuut dat aangeeft of een instrument beleenbaar is als onderpand voor kredietransacties van het Eurosysteem.				√	
Nominal currency (Nominale valuta)	Nominale valuta van het instrument (International Standards Organization (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Output feed data attribute name (Naam van aangeleverde outputgegevens attribuut)	Beschrijving	Toepasselijke feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (Uitgiftedatum)	De datum waarop de emittent de effecten tegen betaling aan de intekenaar levert. Dit is de datum waarop de effecten voor de eerste keer beschikbaar zijn voor levering aan beleggers. *NB:* Voor een strip vermeldt deze kolom de datum waarop de coupon/hoofdsom wordt gestript.	√	√	√	√	√
Maturity date (Vervaldatum)	Datum waarop het schuldbewijs werkelijk wordt afgelost.	√	√	√	√	√
Residual maturity (Resterende looptijd)	De resterende looptijd van een instrument berekend op de datum waarnaar de aangeleverde outputgegevens verwijzen (date of population).					√
Issuer domicile country (Land van domicilie emittent)	Land van juridische oprichting (domicilie) van de effectenemittent (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (ESR-emittentensector)	Institutionele sector van de emittent conform ESR.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (indeling emittent in Europese Classificatie van economische activiteiten (NACE))	Economische hoofdactiviteit conform NACE.	√				
Amount issued (Emissiebedrag)	Bedrag van het schuldinstrument dat de uitgifte heeft opgebracht (nominale waarde). Voor een strip vermeldt deze kolom het bedrag waarvoor de coupon/hoofdsom is gestript. Voor een in tranches uitgegeven effect, onder één ISIN, vermeldt deze kolom het tot dusverre uitgegeven cumulatieve bedrag. Uitgegeven bedrag luidt in nominale valuta.					√
Amount outstanding (Uitstaand bedrag)	Uitstaand bedrag in nominale waarde. Voor een in tranches uitgegeven effect, onder één ISIN, vermeldt deze kolom het tot dusverre geëmitteerde cumulatieve bedrag, minus aflossingen. Waarde wordt in nominale valuta opgevoerd. Uitstaand bedrag luidt in nominale valuta. Indien nominale valuta ontbreekt, luidt het uitstaande bedrag in euro.	√			√	√
Amount outstanding in euro (In euro luidende uitstaande bedragen)	In euro geconverteerde uitstaande bedragen tegen de wisselkoers tussen de euro en de nominale valuta geldend op de datum waarnaar de aangeleverde outputgegevens verwijzen (date of population).				√	√
Market capitalisation (Marktkapitalisatie)	Meest recente beschikbare marktkapitalisatie. Marktkapitalisatie luidt in nominale valuta. Indien nominale valuta ontbreekt, luidt marktkapitalisatie in euro.				√	

Output feed data attribute name (Naam van aangeleverde outputgegevens attribuut)	Beschrijving	Toepasselijke feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Rendement op de vervaldatum)	Aan het effect eigen rendement op de vervaldatum uitgedrukt in percentage.				√	√
Short name (Afgekorte naam)	Door de emittent opgestelde afgekorte naam, opgesteld op basis van de emissiekenmerken en enige beschikbare informatie.					√
Pool factor (Poolfactor)	Voor hypotheken met effecten als onderpand, poolfactor of resterendehoofdsomsaldo-factor is het uitstaande hoofdsomsaldo van de aan het effect onderliggende hypotheekpool gedeeld door het oorspronkelijke hoofdsomsaldo.	√	√	√	√	√
Quotation basis (Noteringsgrondslag)	Noteringsgrondslag van het instrument, bv. percentage van nominaal (procent) of valuta per aandeel/deelneming (deelnemingen).	√	√	√	√	√
Price value (Koerswaarde)	Laatst beschikbare representatieve prijs van het instrument op de referentiedatum op noteringsgrondslag en nominale valuta, indien toepasselijk, van het instrument. Voor rentedragende effecten wordt de zuivere prijs verstrekt, d.w.z. exclusief overlopende rente.	√	√	√	√	√
Price value type (Koerswaarde soort)	Aard van de koerswaarde, d.w.z. betreft het marktwaardering, geraamde waarde of een standaardwaarde.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Gemiddelde maandkoers)	Gemiddelde van genormaliseerde koersen van het instrumenten beschikbaar op de laatste 30 kalenderdagen tot de referentiedatum op noteringsgrondslag en nominale waarde, indien toepasselijk, van het instrument.	√			√	
Redemption type (Aflossingssoort)	Aflossingssoort bv. aflossing ineens, eeuwigdurend, gestructureerd, annuïteit, serieel, onregelmatig, nihil, gefaseerd.					√
Redemption frequency (Aflossingsfrequentie)	Aantal aflossingen per jaar voor een schuldbewijs.					√
Redemption price (Aflossingskoers)	Finale aflossingskoers.					√
Overlopende rente	Overlopende rente sedert de vorige couponbetaling of sedert de aanvangsdatum van opgebouwde rente. Voor rentedragende effecten resulteert toevoeging van deze waarde aan de koers in de zogenoemde „niet-zuivere prijs”.	√	√	√		√
Accrued income factor (Factor gecumuleerde inkomsten)	Dagelijkse het effect eigen inkomensfactor uitgedrukt in procenten berekend volgens de debiteurenmethode. De factor is gebaseerd op gecumuleerde inkomsten, d.w.z. resulterend in een gecombineerd effect van overlopende rente en gecumuleerde inkomsten vanwege het verschil tussen de uitgifte en de aflossingsprijs.	√	√	√	√	

Output feed data attribute name (Naam van aangeleverde outputgegevens attribuut)	Beschrijving	Toepasselijke feed				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Couponsoort)	Soort coupon, bv. vast, variabel, gefaseerd enz.				√	√
Last coupon rate (Meest recente couponermijn)	Meest recente couponermijn als jaarpercentage van het reeds betaalde (geannualiseerde termijn).	√	√	√	√	
Last coupon date (Meest recente coupondatum)	Datum van meest recente reeds betaalde couponermijn. Middels het attribuut kan worden bepaald of de meest recente reeds betaalde couponprijs al dan niet binnen de rapportageperiode valt.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Meest recente couponfrequentie)	Frequentie per jaar waarin de meest recente couponprijs werd uitbetaald: „jaarlijks" wordt AN, „halfjaarlijks" SA enz.	√	√	√	√	
Dividend amount (Dividendbedrag)	Bedrag van de meest recente dividendbetaling per aandeel (per soort dividendbedrag) voor belastingen (brutodividend).	√		√	√	
Dividend amount type (Soort dividendbedrag)	Dividendbedrag per aandeel kan luiden in dividendvaluta of in aantal aandelen.	√		√	√	
Dividend currency (Dividendvaluta)	ISO 4217-code van de valuta van de meest recente dividendbetaling.	√		√	√	
Dividend Settlement date (Dividendafwikkelingsdatum)	Afwikkelingsdatum van de meest recente dividendbetaling. Het attribuut waarmee bepaald kan worden of het betaalde dividendbedrag al dan niet in de rapportageperiode valt.	√		√	√	
Last split factor (Meest recente splitfactor)	Standensplits en samenvoeging van aandelen.	√		√	√	
Last split date (Datum meest recente split)	Datum waarop de standensplit effectief wordt.	√		√	√	