ORIENTĂRI

ORIENTAREA BĂNCII CENTRALE EUROPENE

din 26 septembrie 2012

privind cadrul de referință pentru managementul calității datelor pentru baza de date centralizată a titlurilor de valoare

(BCE/2012/21)

(2012/689/UE)

CONSILIUL GUVERNATORILOR BĂNCII CENTRALE EUROPENE,

având în vedere Statutul Sistemului European al Băncilor Centrale și al Băncii Centrale Europene, în special articolele 5.1, 12.1 și 14.3,

având în vedere Regulamentul (CE) nr. 2533/98 al Consiliului din 23 noiembrie 1998 privind colectarea informațiilor statistice de către Banca Centrală Europeană [1],

întrucât:

(1) Baza de date centralizată a titlurilor de valoare (*Centralised Securities Database* – CSDB) este o infrastructură informatică unică, operată în comun de către membrii Sistemului European al Băncilor Centrale (SEBC), inclusiv băncile centrale naționale (BCN) ale statelor membre din afara zonei euro, atunci când aceste BCN participă în mod voluntar la funcționarea CSDB. CSDB stochează datele în regim „element cu element", în special date privind titlurile de valoare, emitenții acestora și prețurile.

(2) Datele sunt colectate din diverse surse, inclusiv de la membrii SEBC, de la anumiți furnizori de date comerciale, din domeniul public și din surse administrative, și sunt transmise către CSDB. Există totuși riscul ca aceste date introduse în CSDB (denumite în continuare „date de intrare") (*input data*) să fie inexacte sau incomplete. Sistemul CSDB poate reconcilia parțial datele de intrare inconsecvente, provenite din surse diferite, și poate detecta date incomplete sau lipsă. Acest sistem combină în mod automat, în măsura în care este posibil, date de intrare din diferite surse care se suprapun, într-o înregistrare unică, completă și de calitate ridicată.

(3) Calitatea generală a datelor din CSDB poate fi evaluată numai la nivelul datelor extrase din CSDB (denumite în continuare „date de ieșire") (*output data*), nu la nivelul seturilor individuale de date de intrare. Pentru a asigura caracterul complet, exact și consecvent al datelor de ieșire, în măsura în care este posibil, este necesar să se definească un cadru de referință pentru managementul calității datelor (*Data Quality Management* – DQM) care să fie aplicat în ceea ce privește datele de ieșire destinate procesării (*output feed data*), care reprezintă un subset de date de ieșire care poate fi folosit drept bază pentru producerea de statistici sau în alte scopuri. Datele de ieșire destinate procesării sunt transmise BCN în cel mult șapte zile lucrătoare după sfârșitul fiecărei luni calendaristice.

(4) Anumite date de ieșire destinate procesării includ și atribute precum prețurile sau informații legate de venit, care în general fluctuează în timp. Aceste atribute sunt verificate în mod automat de sistemul CSDB prin aplicarea de algoritmi statistici. Numai atributele specificate în anexa I pentru fiecare obiectiv DQM fac obiectul verificării de către autoritățile competente în conformitate cu prezenta orientare. Lista completă de atribute care constituie seturile de date acceptate este stabilită în anexa II.

(5) Cadrul DQM pentru CSDB ar trebui aplicat datelor de ieșire destinate procesării, indiferent de sursa datelor de intrare. Acesta ar trebui să stabilească pentru CSDB responsabilitățile BCN din zona euro pentru calitatea datelor de ieșire și, dacă este cazul, responsabilitățile Băncii Centrale Europene (BCE).

(6) Cadrul DQM pentru CSDB ar trebui să se bazeze, în primul rând, pe obiectivele DQM care reprezintă referințe de evaluare a calității datelor de ieșire destinate procesării și, în al doilea rând, pe indicatorii DQM care identifică și ierarhizează, pentru fiecare obiectiv DQM, datele de ieșire destinate procesării care trebuie verificate. De asemenea, ar trebui să se bazeze pe praguri DQM care definesc nivelul minim al verificărilor care trebuie efectuate în raport cu un obiectiv DQM.

(7) Dată fiind absența datelor de referință, obiectivele DQM nu identifică întotdeauna erorile din datele de ieșire destinate procesării, putând identifica numai cazurile în care este necesară verificarea manuală a datelor de ieșire destinate procesării.

(8) Întrucât CSDB este operată în comun de toți membrii SEBC, aceștia ar trebui să tindă către respectarea acelorași standarde DQM. În plus, BCN din afara zonei euro sunt cele mai în măsură să realizeze DQM asupra datelor referitoare la emitenții rezidenți în statele membre

[1] JO L 318, 27.11.1998, p. 8.

ale acestora. Deși este recunoscut faptul că orientările adoptate de către BCE nu pot impune nicio obligație BCN din afara zonei euro, articolul 5 din Statutul Sistemului European al Băncilor Centrale și al Băncii Centrale Europene se aplică atât BCN din zona euro, cât și celor din afara zonei euro. Prin urmare, BCN din afara zonei euro ar trebui să proiecteze și să pună în aplicare toate măsurile pe care le consideră adecvate pentru a realiza DQM în conformitate cu prezenta orientare.

(9) Pentru îmbunătățirea calității datelor de ieșire, managementul surselor de date (*Data Source Management* – DSM) ar trebui realizat în scopul identificării și corectării greșelilor repetitive și structurale din datele de intrare direct la furnizorul de date,

ADOPTĂ PREZENTA ORIENTARE:

Articolul 1

Definiții

În sensul prezentei orientări:

1. „CSDB" înseamnă baza de date centralizată a titlurilor de valoare (*Centralised Securities Database*) înființată de SEBC și situată în sediul BCE;

2. „date de intrare" (*input data*) înseamnă orice date furnizate către CSDB din una sau mai multe surse de date;

3. „date de ieșire" (*output data*) înseamnă date care sunt derivate în mod automat în CSDB prin combinarea datelor de intrare într-o înregistrare unică, completă și de înaltă calitate;

4. „date de ieșire destinate procesării" (*output feed data*) înseamnă subsetul de date de ieșire și de caracteristici enumerate în anexa II care servesc drept ansamblu de date de bază pentru producerea de statistici sau în alte scopuri;

5. „managementul calității datelor" (*Data Quality Management*) sau „DQM" înseamnă asigurarea, verificarea și menținerea calității datelor de ieșire destinate procesării prin utilizarea și aplicarea obiectivelor DQM, a indicatorilor DQM, a pragurilor DQM și a procesului DQM;

6. „managementul surselor de date" (*Data Source Management*) sau „DSM" înseamnă identificarea și corectarea direct la un furnizor de date a greșelilor repetitive și/sau structurale din datele de intrare;

7. „DQM inițial" înseamnă DQM al datelor de ieșire destinate procesării, inclusiv al datelor care se referă la cea mai recentă perioadă de timp, realizat lunar de autoritățile competente pentru DQM, luând în considerare datele de ieșire destinate procesării, furnizate în situația preliminară referitoare la sfârșitul de lună;

8. „DQM regulat" înseamnă DQM al datelor de ieșire destinate procesării, realizat lunar de autoritățile competente pentru DQM, luând în considerare datele de referință non-CSDB furnizate de diverse surse de date, în vederea asigurării unei calități a datelor de ieșire din CSDB care să respecte cerințele referitoare la datele CSDB destinate procesării;

9. „obiectiv DQM" (*DQM target*) înseamnă o referință pentru evaluarea calității datelor de ieșire destinate procesării, astfel cum este prevăzut în anexa I;

10. „indicator DQM" (*DQM metric*) înseamnă un indicator statistic care măsoară nivelul la care a fost îndeplinit un anumit obiectiv DQM, astfel cum este prevăzut în anexa I;

11. „prag DQM" (*DQM threshold*) înseamnă nivelul minim al activităților de verificare care trebuie efectuate pentru a îndeplini cerințele cadrului DQM pentru un obiectiv DQM;

12. „proces DQM" (*DQM workflow*) înseamnă un proces tehnic aplicat pentru corectarea datelor de intrare, în vederea respectării unui prag DQM;

13. „situație preliminară referitoare la sfârșitul de lună" (*end-month preview*) înseamnă o actualizare lunară regulată a datelor de ieșire și a indicatorilor DQM, care efectuează aproximarea datelor de ieșire pentru următoarea situație aferentă sfârșitului de lună;

14. „zi lucrătoare" este o zi completă în care TARGET2 este deschis, așa cum este publicat pe website-ul BCE;

15. „verificare" înseamnă procesul prin care autoritățile competente pentru DQM verifică datele de ieșire destinate procesării din CSDB și, dacă este necesar, corectează datele de intrare în CSDB, aplicând astfel procesul DQM;

16. „rezident" are sensul dat de definiția de la articolul 1 din Regulamentul (CE) nr. 2533/98.

Articolul 2

Obiectul și domeniul de aplicare

(1) Prezenta orientare stabilește un cadru pentru DQM în CSDB, scopul acestuia fiind să asigure caracterul complet, exact și consecvent al datelor de ieșire din CSDB, prin aplicarea consecventă a regulilor privind standardele de calitate pentru aceste date.

(2) Cadrul DQM pentru CSDB se bazează pe DQM și DSM.

Articolul 3

Autoritățile competente pentru DQM

(1) BCN a statului membru din zona euro în care este rezident un emitent de titluri de valoare este competentă pentru DQM în ceea ce privește datele referitoare la acest emitent.

(2) BCE este competentă pentru DQM în ceea ce privește datele referitoare la emitenți rezidenți în afara zonei euro, cu excepția cazului în care o BCN din afara zonei euro a acceptat responsabilitatea de a realiza DQM pentru datele referitoare la emitenți rezidenți în statul membru al acesteia.

Articolul 4

DQM, indicatori DQM și praguri DQM

(1) Autoritățile competente pentru DQM efectuează DQM inițial și DQM regulat. În acest sens, acestea verifică datele de ieșire destinate procesării, indiferent de sursa acestora.

(2) Autoritățile competente pentru DQM aplică indicatorii DQM în conformitate cu anexa I.

(3) Pentru atributele acoperite de anexa I, autoritățile competente pentru DQM aplică pragurile DQM la un nivel care asigură calitatea datelor de ieșire destinate procesării în conformitate cu cerințele de a sprijini utilizările respectivelor atribute stabilite în anexa II.

Articolul 5

DQM inițial

(1) DQM inițial se aplică obiectivelor DQM 1, 2, 3a, 3b și 6, astfel cum este prevăzut în anexa I.

(2) BCE pune la dispoziție situația preliminară referitoare la sfârșitul de lună cu șapte zile lucrătoare înainte de sfârșitul fiecărei luni calendaristice.

(3) Când realizează DQM inițial, autoritățile competente pentru DQM verifică valorile extreme statistice semnificative pentru a se asigura că, după ce a avut loc DQM inițial, datele de ieșire destinate procesării, în măsura în care este posibil, reflectă cele mai recente evoluții.

(4) Autoritățile competente pentru DQM verifică datele din situația preliminară referitoare la sfârșitul de lună până la sfârșitul celei de a doua zile lucrătoare a următoarei luni calendaristice, în măsura în care, în conformitate cu indicatorii DQM, pragurile DQM nu au fost atinse.

(5) Acolo unde nu sunt disponibile date de referință în afara CSDB, DQM inițial se bazează numai pe informații care sunt deja disponibile autorității competente pentru DQM sau care pot fi obținute cu ușurință fără instituirea unor mecanisme de raportare noi.

(6) Autoritățile competente pentru DQM corectează datele de intrare în conformitate cu procesul DQM, prin utilizarea sistemului CSDB sau prin transmiterea către BCE a fișierelor cu date de intrare în CSDB, după caz.

Articolul 6

DQM regulat

(1) DQM regulat se aplică obiectivelor DQM 3a, 3b, 4, 5 și 6, astfel cum este prevăzut în anexa I.

(2) Autoritățile competente pentru DQM efectuează DQM regulat în termen de o lună de la sfârșitul fiecărei luni calendaristice. Acestea verifică datele de ieșire destinate procesării, ținând seama de toate informațiile disponibile la momentul respectiv, cel mai târziu în a doua zi lucrătoare a lunii calendaristice care urmează lunii în care este efectuat DQM regulat.

(3) Autoritățile competente pentru DQM corectează datele de intrare în conformitate cu procesul DQM convenit, prin utilizarea sistemului CSDB sau prin transmiterea către BCE a fișierelor cu date de intrare, după caz.

Articolul 7

Sarcini legate de DSM

(1) Autoritățile competente pentru DQM identifică orice probleme legate de DSM și le raportează către BCE.

(2) BCE abordează erorile repetitive prioritare legate de DSM în colaborare cu autoritățile competente pentru DQM relevante, în termen de o lună de la data la care o problemă referitoare la DSM este raportată la BCE.

Articolul 8

Corecții ale datelor de intrare

O autoritate competentă pentru DQM, cu condiția îmbunătățirii datelor de intrare, utilizează sistemul CSDB pentru a corecta orice erori și omisiuni în datele sale de intrare care nu au fost corectate în cursul verificării prevăzute la articolul 5 alineatul (4).

Articolul 9

Raportul anual privind calitatea datelor

Ținând seama de punctele de vedere ale Comitetului de statistică al SEBC, Comitetul executiv al BCE prezintă anual Consiliului guvernatorilor rapoarte cu privire la calitatea datelor de ieșire destinate procesării.

Articolul 10

Procedura simplificată de modificare

Ținând seama de punctele de vedere ale Comitetului de statistică al SEBC, Comitetul executiv al BCE are dreptul de a aduce amendamente tehnice anexelor la prezenta orientare, cu condiția ca modificările respective să nu schimbe cadrul conceptual de bază al orientării, inclusiv împărțirea responsabilităților între BCE și BCN, și să nu afecteze semnificativ sarcina de raportare a autorităților competente pentru DQM. Comitetul executiv informează Consiliul guvernatorilor cu privire la orice asemenea modificare fără întârzieri nejustificate.

Articolul 11

Intrarea în vigoare

(1) Prezenta orientare intră în vigoare la 1 noiembrie 2012.

(2) Prezenta orientare se aplică de la 1 iulie 2013.

Articolul 12

Destinatari

Prezenta orientare se adresează tuturor băncilor centrale din Eurosistem.

Adoptată la Frankfurt pe Main, 26 septembrie 2012.

Pentru Consiliul guvernatorilor BCE
Președintele BCE
Mario DRAGHI

ANEXA I

OBIECTIVE DQM, PUNERE ÎN APLICARE, ATRIBUTE ȘI BAZA PRAGULUI DQM

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
Obiectivul 1: **Stabilitatea datelor – date privind stocurile**	Concept: Indicatorul este definit pentru fiecare combinație țară de reședință/sector ca un indice de volum ponderat, respectiv „indicele de modificare" ponderat cu valorile monetare. O valoare de 1 a indicelui indică faptul că atributul respectiv nu s-a modificat pentru niciunul dintre titlurile de valoare suport, în timp ce o valoare de 0 a indicelui indică faptul că respectivul atribut s-a modificat pentru toate titlurile de valoare. În cazul în care un indice scade sub 1, titlurile de valoare individuale sunt identificate cu atributul modificat care a produs scăderea indicelui, în vederea verificării modificării până la atingerea pragului. Evenimente care determină o modificare a indicelui: Pentru atributele care pot avea doar anumite valori (*discrete attribute*), se consideră că orice modificare de la lună la lună a atributului determină o modificare a indicelui. Pentru atributele continue, se consideră că orice modificare de la lună la lună mai mare de 25 % determină o modificare a indicelui. Acoperire: Acest indicator DQM acoperă toate acțiunile/unitățile de fond ale fondurilor de investiții, acțiuni și alte participații și titlurile de natura datoriei, inclusiv certificatele care nu au scadența mai mare de trei luni.	Obiectivul 1 evaluează stabilitatea datelor privind stocurile. Modificările neverificate ale atributelor CSDB trebuie să nu scadă ponderea datelor stabile dincolo de pragul DQM pentru fiecare dintre următoarele sectoare emitente din Sistemul European de Conturi (SEC) [1]: — S.11 „societăți nefinanciare" (S.11 în conformitate cu SEC 95) — S.121 „banca centrală" (S.121 în conformitate cu SEC 95) — S.122 „societăți care acceptă depozite, exclusiv banca centrală" (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.123 „fonduri de piață monetară (FPM)" (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.124 „fonduri de investiții, altele decât FPM" (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.125 „alți intermediari financiari, exclusiv societățile de asigurare și fondurile de pensii" (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.126 „auxiliari financiari" (S.124 în conformitate cu SEC 95) — S.127 „instituții financiare captive și alte entități creditoare" (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.128 „societăți de asigurare (SA)" (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.129 „fonduri de pensii (FP)" (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.13 „administrații publice" (S.13 în conformitate cu SEC 95).	Atribute explicite: data emisiunii pentru titluri de valoare de natura datoriei (*issue date for debt*), data scadenței pentru titluri de valoare de natura datoriei (*maturity date for debt*), moneda nominală (*nominal currency*), baza de cotare (*quotation basis*), clasa SEC a instrumentului (*instrument ESA class*), țara de reședință a emitentului (*issuer country of residence*), sectorul SEC al emitentului (*issuer ESA sector*), clasificarea emitentului în nomenclatorul statistic al activităților economice din Uniunea Europeană (CAEN) [*issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification*], soldul emisiunii (*amount outstanding*), numărul de acțiuni în circulație pentru acțiunile cotate (*number of shares outstanding for quoted shares*).	Soldurile emisiunii sau capitalizarea de piață (*market capitalisation*) în euro, exprimate ca pondere în datele privind stocurile.

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
Obiectivul 2: **Exactitatea datelor – emisiuni noi și răscumpărări; emisiuni nete**	Concept: Indicatorul este definit pentru fiecare combinație țară de reședință/sector și acoperă emisiunile noi, răscumpărările și soldul emisiunii aferente titlurilor de valoare de natura datoriei, cotate în procente. Indicatorul leagă activitatea de emisiune netă din cursul lunii cu soldul emisiunii la sfârșitul lunii precedente (modificare procentuală) și monitorizează evoluția relativă a soldului datoriei. Va fi posibil să se acceseze datele detaliate până la nivelul emisiunilor noi și al răscumpărărilor individuale care au produs modificarea soldurilor emisiunilor. Aceste evoluții sunt verificate până la atingerea pragului.	Obiectivul 2 evaluează emisiunile noi și răscumpărările în comparație cu datele respective privind stocurile. Datele neverificate privind soldurile noilor emisiuni și răscumpărările de titluri de valoare de natura datoriei cotate în procente trebuie să nu depășească, pe bază netă, pragul DQM pentru fiecare dintre următoarele sectoare SEC ale emitenților: — S.11 „societăți nefinanciare” (S.11 în conformitate cu SEC 95) — S.121 „banca centrală” (S.121 în conformitate cu SEC 95) — S.122 „societăți care acceptă depozite, exclusiv banca centrală” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.123 „fonduri de piață monetară (FPM)” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.124 „fonduri de investiții, altele decât FPM” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.125 „alți intermediari financiari, exclusiv societățile de asigurare și fondurile de pensii” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.126 „auxiliari financiari” (S.124 în conformitate cu SEC 95) — S.127 „instituții financiare captive și alte entități creditoare” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.128 „societăți de asigurare (SA)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.129 „fonduri de pensii (FP)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.13 „administrații publice” (S.13 în conformitate cu SEC 95).	Atribute explicite: soldul emisiunii. Atribute implicite: data emisiunii, data scadenței, monedă nominală, baza de cotare, clasificarea SEC a instrumentului, țara de reședință a emitentului, sectorul SEC al emitentului.	Soldul emisiunii în euro, exprimat ca evoluție relativă, în comparație cu datele respective privind stocurile.

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
Obiectivul 3a: **Exactitatea datelor – sprijină alocarea corectă a sectorului și extragerea datelor în funcție de emitent**	Cadru conceptual: CSDB leagă informațiile despre emitent și instrument printr-o relație ce poate fi descrisă ca fiind de tip „unul pentru mai mulți” (*one to many*), respectiv un emitent poate fi legat de mai multe instrumente, în timp ce fiecare instrument este legat de un singur emitent. Această legătură instrument-emitent se face prin intermediul unor identificatori individuali ai emitenților, furnizați de diferiți furnizori de date de intrare. Acești identificatori diferă între furnizorii de date, neexistând în prezent un standard comun, dar aceștia ar trebui să fie consecvenți. În cazul în care furnizorii de date oferă identificatori inconsecvenți (contradictorii) ai emitenților pentru același instrument, respectiv dacă nu se pun de acord asupra emitentului, instrumentul nu poate fi alocat unui anumit emitent și ajunge într-un grup conflictual, denumit grup „clash”. Grupurile „clash” pot fi totuși clasificate corect pe țări și pe sectoare, dar nu există o legătură consecventă cu emitentul relevant al instrumentului. Instrumentele din grupurile „clash” împiedică extragerea consecventă și fiabilă a tuturor instrumentelor emise de un anumit emitent. Instrumentele din grupurile „clash” cresc riscul clasificării eronate pe țări de reședință sau pe sectoare. Concept: Pentru fiecare țară de reședință, indicatorul identifică instrumentele din grupurile „clash” și le pune în legătură cu emisiunile țării respective, printr-o cotă procentuală, stabilită ca număr sau valori monetare în totalul instrumentelor emise de acea țară. Acoperire: Indicatorul acoperă toate instrumentele din CSDB.	Obiectivul 3a evaluează identificarea corectă a populației de emitenți. Atunci când există un dezacord cu privire la emitentul unui instrument, respectiv instrumente din grupurile „clash”, aceste instrumente nu trebuie să depășească pragul DQM.	Atribute explicite: identificatorul emitentului utilizat pentru grupare (*issuer identifier used for grouping*).	Soldurile emisiunilor în euro referitoare la instrumentele din grupurile „clash”, exprimate ca o cotă procentuală din totalul instrumentelor.

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
Obiectivul 3b: **Exactitatea datelor – sprijină alocarea corectă a sectorului și extragerea datelor în funcție de emitent**	Cadru conceptual: CSDB leagă informațiile despre emitent și instrument printr-o relație ce poate fi descrisă ca fiind de tip „unul pentru mai mulți” (*one to many*), respectiv un emitent poate fi legat de mai multe instrumente, în timp ce fiecare instrument este legat de un singur emitent. Această legătură instrument-emitent se face prin intermediul unor identificatori individuali ai emitenților, care sunt furnizați de diferiți furnizori de date de intrare. Acești identificatori diferă între furnizorii de date, neexistând în prezent un standard comun, dar aceștia ar trebui să fie consecvenți. Dacă niciun furnizor de date nu oferă un identificator al emitentului pentru un anumit instrument, există riscul ca acest instrument să nu fie alocat unui anumit emitent și să ajungă într-un grup independent, denumit grup „stand-alone”, alcătuit doar din acest instrument. Grupurile independente pot fi totuși clasificate corect în funcție de țară și sector, dar nu există o legătură consecventă cu emitentul relevant al instrumentului. Instrumentele din grupurile „stand-alone” împiedică extragerea consecventă și fiabilă a tuturor instrumentelor emise de un anumit emitent. Instrumentele din grupurile „stand-alone” măresc riscul de clasificare eronată pe țări de reședință sau pe sectoare, dat fiind că adesea sunt furnizate cu informații incomplete. Concept: Pentru fiecare țară de reședință, indicatorul identifică instrumentele din grupurile „stand-alone” și le pune în legătură cu emisiunile țării respective printr-o cotă procentuală stabilită ca număr de instrumente sau ca valori monetare în totalul instrumentelor emise de acea țară.	Obiectivul 3b evaluează identificarea corectă a populației de emitenți. Atunci când nu există informații fiabile cu privire la emitentul unui instrument, respectiv instrumente din grupurile „stand-alone”, aceste instrumente nu trebuie să depășească pragul DQM.	Atribute explicite: identificatorul emitentului utilizat pentru grupare.	Soldurile emisiunilor în euro referitoare la instrumentele din grupurile „stand-alone”, exprimate ca o cotă procentuală din totalul instrumentelor.

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
	Acoperire: Indicatorul acoperă toate instrumentele din CSDB.			
Obiectivul 4: **Exactitatea datelor – soldul emisiunii aferent titlurilor de valoare de natura datoriei, inclusiv certificate**	Concept: Indicatorul agregă soldurile emisiunilor aferente titlurilor de valoare de natura datoriei, inclusiv certificate, în funcție de țara de reședință a fiecărui emitent și de sectorul emitentului, în conformitate cu conceptul statisticilor privind emisiunile de titluri de valoare (SET). Acest agregat este comparat cu cifra SET respectivă, calculându-se devierea procentuală a datelor CSDB. Diferențele neverificate și neexplicate nu trebuie să depășească pragul DQM.	Obiectivul 4 compară datele de ieșire din CSDB cu datele de referință externe. Diferențele neverificate și neexplicate dintre datele CSDB agregate și informațiile respective din SET ale BCE sau alte referințe fiabile, sub rezerva disponibilității acestor date de referință, nu trebuie să depășească pragul DQM pentru aceeași dată de referință pentru fiecare dintre următoarele sectoare SEC ale emitenților: — S.11 „societăți nefinanciare” (S.11 în conformitate cu SEC 95) — S.121 „banca centrală” (S.121 în conformitate cu SEC 95) — S.122 „societăți care acceptă depozite, exclusiv banca centrală” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.123 „fonduri de piață monetară (FPM)” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.124 „fonduri de investiții, altele decât FPM” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.125 „alți intermediari financiari, exclusiv societățile de asigurare și fondurile de pensii” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.126 „auxiliari financiari” (S.124 în conformitate cu SEC 95) — S.127 „instituții financiare captive și alte entități creditoare” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.128 „societăți de asigurare (SA)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.129 „fonduri de pensii (FP)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.13 „administrații publice” (S.13 în conformitate cu SEC 95).	Atribute explicite: soldul emisiunilor în euro, capitalizare de piață în euro. Atribute implicite: data emisiunii, data scadenței, moneda, sectorul SEC al emitentului, țara de reședință.	Soldurile emisiunilor sau capitalizarea de piață în euro, exprimate ca diferență procentuală între CSDB și referința externă.

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
Obiectivul 5: **Exactitatea datelor – capitalizare de piață a acțiunilor și a altor participații de capital**	Concept: Indicatorul agregă capitalizarea de piață aferentă acțiunilor și altor participații de capital în funcție de țara de reședință a fiecărui emitent și de sectorul emitentului, în conformitate cu conceptul statisticilor privind emisiunile de titluri de valoare. Acest agregat este comparat cu cifra SET respectivă, calculându-se devierea procentuală a datelor CSDB. Diferențele neverificate și neexplicate nu trebuie să depășească pragul DQM.	Obiectivul 5 compară datele de ieșire din CSDB cu datele de referință externe. Diferențele neverificate și neexplicate dintre informațiile CSDB agregate și informațiile respective din SET ale BCE sau alte referințe fiabile, sub rezerva disponibilității datelor de referință, nu trebuie să depășească pragul DQM pentru aceeași dată de referință pentru fiecare dintre următoarele sectoare SEC ale emitenților: — S.11 „societăți nefinanciare” (S.11 în conformitate cu SEC 95) — S.121 „banca centrală” (S.121 în conformitate cu SEC 95) — S.122 „societăți care acceptă depozite, exclusiv banca centrală” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.123 „fonduri de piață monetară (FPM)” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.124 „fonduri de investiții, altele decât FPM” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.125 „alți intermediari financiari, exclusiv societățile de asigurare și fondurile de pensii” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.126 „auxiliari financiari” (S.124 în conformitate cu SEC 95) — S.127 „instituții financiare captive și alte entități creditoare” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.128 „societăți de asigurare (SA)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.129 „fonduri de pensii (FP)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.13 „administrații publice” (S.13 în conformitate cu SEC 95).	Atribute explicite: soldul emisiunii în euro, număr de acțiuni în circulație pentru acțiunile cotate (*number of shares outstanding for quoted shares*). Atribute implicite: monedă nominală, sector SEC al emitentului, țară de reședință, ultimul preț valabil pentru acțiunile cotate (verificare doar a valorilor extreme) [*price value for quoted shares (outlier check only)*].	Soldurile emisiunilor sau capitalizarea de piață în euro, exprimate ca diferență procentuală între CSDB și referința externă.

Obiectiv DQM	Indicatori DQM	Punere în aplicare	Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării	Baza pragului DQM
Obiectivul 6: **Exactitatea datelor – clasificarea emitenților**	Concept: Indicatorul clasifică emitenții pentru fiecare combinație țară de reședință/emitent în conformitate cu obligațiile totale asumate prin titluri de valoare (acțiuni, alte participații de capital și titluri de valoare de natura datoriei combinate). De asemenea, indicatorul prezintă schimbările absolute de ierarhie între diferiți emitenți, pentru a facilita identificarea valorilor extreme semnificative ale soldurilor emisiunilor sau ale capitalizării de piață. Clasificarea în funcție de țara de reședință și sectorul emitentului trebuie verificate până la pragul DQM. Acoperire: Indicatorul trebuie să acopere toate acțiunile fondurilor de investiții, acțiunile și alte participații de capital și titlurile de valoare de natura datoriei, care nu au scadența mai mare de trei luni.	Obiectivul 6 evaluează clasificarea statistică a emitenților. Clasificarea statistică a emitenților trebuie verificată până la pragul DQM pentru fiecare dintre următoarele sectoare SEC ale emitenților: — S.11 „societăți nefinanciare” (S.11 în conformitate cu SEC 95) — S.121 „banca centrală” (S.121 în conformitate cu SEC 95) — S.122 „societăți care acceptă depozite, exclusiv banca centrală” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.123 „fonduri de piață monetară (FPM)” (S.122 în conformitate cu SEC 95) — S.124 „fonduri de investiții, altele decât FPM” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.125 „alți intermediari financiari, exclusiv societățile de asigurare și fondurile de pensii” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.126 „auxiliari financiari” (S.124 în conformitate cu SEC 95) — S.127 „instituții financiare captive și alte entități creditoare” (S.123 în conformitate cu SEC 95) — S.128 „societăți de asigurare (SA)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.129 „fonduri de pensii (FP)” (S.125 în conformitate cu SEC 95) — S.13 „administrații publice” (S.13 în conformitate cu SEC 95).	Sector SEC al emitentului, țară de reședință.	Soldurile emisiunilor sau capitalizarea de piață în euro, exprimate sub formă de „capitalizare”, respectiv soldul emisiunii plus capitalizare de piață pe emitent.

([1]) Numerotarea categoriilor reflectă numerotarea introdusă în Propunerea de regulament al Parlamentului European și al Consiliului privind Sistemul european de conturi naționale și regionale din Uniunea Europeană COM(2010) 774 final.

ANEXA II

SETURI DE DATE DE IEȘIRE ȘI ATRIBUTE ALE DATELOR DE IEȘIRE DESTINATE PROCESĂRII ACOPERITE DE CADRUL DQM

Cadrul DQM acoperă următoarele seturi de date de ieșire care pot avea diferite utilizări:

— seturi de date de ieșire care pot fi utilizate pentru elaborarea statisticilor externe (EXT 1.0);

— seturi de date de ieșire privind societățile vehicul investițional care pot fi utilizate pentru elaborarea statisticilor societăților vehicul investițional (FVC 1.0);

— seturi de date de ieșire privind fondurile de investiții care pot fi utilizate pentru elaborarea statisticilor fondurilor de investiții (IF 1.0);

— seturi de date de ieșire privind deținerile de instrumente financiare care pot fi utilizate pentru elaborarea statisticilor deținerilor de instrumente financiare (SHS 1.0);

— seturi de date de ieșire privind finanțarea guvernelor prin titluri de stat care pot fi utilizate pentru elaborarea statisticilor referitoare la finanțarea guvernelor prin titluri de stat (GSF 1.0).

Atribute ale datelor de ieșire destinate procesării care constituie seturile de date acceptate:

Denumirea atributului datelor de ieșire destinate procesării	Descriere	Seturi de date de ieșire aplicabile				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Codul internațional de identificare a valorilor mobiliare (ISIN) [*International Security Identification Number (ISIN) code*]	Identificator ISIN pentru valori mobiliare.	√	√	√	√	√
Clasă a instrumentului din Sistemul European de Conturi (SEC) [*Instrument European System of Accounts (ESA) class*]	Clasificarea instrumentului financiar în conformitate cu SEC.	√	√	√	√	√
Tipul de datorie (*debt type*)	Tipul titlului de valoare de natura datoriei.				√	√
Este inclus în *securities issues statistics* (SET) (statisticile privind emisiunile de titluri de valoare)	Un atribut care poate fi utilizat pentru a identifica titlurile de valoare care ar trebui incluse în „soldurile emisiunilor curente”, în conformitate cu definițiile SET ale BCE.					√
Clasă suplimentară a instrumentului (*instrument supplementary class*)	Atribut suplimentar prin care se poate stabili dacă un titlu de valoare ar trebui inclus în SET sau nu. Acest atribut poate lua valori precum 1 = cupon aferent titlului de valoare de tip strip (*strip cupon*), 2 = principal aferent titlului de valoare de tip strip (*strip principal*) etc.					√
Statutul titlului de valoare (*security status*)	Atribut suplimentar prin care se poate stabili dacă un titlu de valoare ar trebui inclus în SET sau nu. Acest atribut poate indica dacă un titlu de valoare este expirat sau nu.					√
Tip de securitizare a activelor (*asset securitisation type*)	Tipul activului folosit pentru securitizare.		√		√	
Este inclus în baza de date a activelor eligibile (*Eligible Assets Database*)	Atribut care indică dacă un titlu de valoare este eligibil pentru a fi constituit ca garanție pentru operațiunile de credit din Eurosistem.				√	
Monedă nominală (*nominal currency*)	Moneda nominală a instrumentului [Organizația Internațională de Standardizare (ISO) 4217].	√	√	√	√	√

Denumirea atributului datelor de ieșire destinate procesării	Descriere	Seturi de date de ieșire aplicabile				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Data emisiunii (*issue date*)	Data la care titlurile de valoare sunt transmise subscriitorului de către emitent în schimbul plății. Aceasta este data la care titlurile de valoare sunt disponibile pentru a fi transmise investitorilor pentru prima dată. Notă: Pentru un strip, această coloană indică data la care este detașat cuponul/principalul.	√	√	√	√	√
Data scadenței (*maturity date*)	Data la care un instrument de natura datoriei este răscumpărat efectiv.	√	√	√	√	√
Scadență reziduală (*residual maturity*)	Scadența reziduală a unui instrument, calculată la o anumită dată.					√
Țara de domiciliu a emitentului (*issuer domicile country*)	Țara de constituire legală (domiciliu) a emitentului instrumentului financiar (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Sector SEC al emitentului (*issuer ESA sector*)	Sectorul instituțional al emitentului în conformitate cu SEC.	√	√	√	√	√
Clasificarea emitentului în nomenclatorul statistic al activităților economice din Uniunea Europeană (CAEN) [*Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification*]	Activitatea economică principală în conformitate cu CAEN.	√				
Valoarea emisiunii (*amount issued*)	Valoarea unui instrument de natura datoriei care a fost atrasă la emisiune (valoare nominală). Pentru un strip, această coloană indică valoarea la care a fost detașat cuponul/principalul. Pentru un titlu de valoare emis în tranșe, cu un singur ISIN, această coloană indică valoarea cumulată emisă până în prezent. Valoarea emisiunii este exprimată în moneda nominală.					√
Soldul emisiunii (*amount outstanding*)	Soldul emisiunii la valoare nominală. Pentru un titlu de valoare emis în tranșe, cu un singur ISIN, această coloană indică valoarea cumulată emisă până în prezent, din care s-a scăzut valoarea răscumpărărilor. Valorile sunt date în moneda nominală. Soldul emisiunii este exprimat în moneda nominală. Dacă moneda nominală lipsește, soldul emisiunii este exprimat în euro.	√			√	√
Soldul emisiunii în euro (*amount outstanding in euro*)	Soldul emisiunii convertit în euro utilizând cursul de schimb al euro față de moneda nominală valabil la data respectivă.				√	√
Capitalizare de piață (*market capitalisation*)	Cea mai recentă capitalizare de piață disponibilă. Capitalizarea de piață este exprimată în moneda nominală. Dacă moneda nominală lipsește, capitalizarea de piață este exprimată în euro.				√	

Denumirea atributului datelor de ieșire destinate procesării	Descriere	Seturi de date de ieșire aplicabile				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Randament la scadență (*yield to maturity*)	Randament la scadență specific titlului de valoare, în termeni procentuali.				√	√
Denumire scurtă (*short name*)	Denumire scurtă dată de emitent, definită în baza caracteristicilor emisiunilor și a oricăror informații disponibile.					√
Factorul soldului principalului rămas (*pool factor*)	Pentru titlurile de valoare garantate cu ipoteci, factorul soldului principalului rămas este soldul curent al principalului ansamblului de ipoteci care garantează titlul de valoare, împărțit la soldul inițial al principalului.	√	√	√	√	√
Baza de cotare (*quotation basis*)	Baza de cotare a instrumentului, de exemplu, procentajul din valoarea nominală (procent) sau valoarea exprimată în moneda efectivă pe acțiune/unitate (unități).	√	√	√	√	√
Ultimul preț valabil (*price value*)	Cel mai recent preț reprezentativ disponibil al instrumentului la data de referință în funcție de baza de cotare și moneda nominală a instrumentului, dacă este cazul. Pentru titlurile de valoare purtătoare de dobânzi, este furnizat prețul curățat (*clean price*), respectiv excluzând dobânda acumulată.	√	√	√	√	√
Tipul ultimului preț valabil (*price value type*)	Natura ultimului preț valabil, respectiv dacă reprezintă o evaluare de piață, o valoare estimată sau o valoare implicită.	√	√	√	√	√
Preț mediu lunar (*monthly average price*)	Media prețurilor normalizate ale instrumentului, disponibile în ultimele 30 de zile calendaristice până la data de referință în funcție de baza de cotare și moneda nominală a instrumentului, dacă este cazul.	√			√	
Tip de răscumpărare (*redemption type*)	Tip de răscumpărare, de exemplu, de tip *bullet* (cu o unică răscumpărare), perpetuă, structurată, anuitate, în serie, neregulată, nulă, în trepte.					√
Frecvența de răscumpărare (*redemption frequency*)	Număr de răscumpărări pe an pentru titlul de valoare de natura datoriei.					√
Preț de răscumpărare (*redemption price*)	Preț final de răscumpărare.					√
Dobândă acumulată (*accrued interest*)	Dobândă acumulată de la ultima plată a cuponului sau de la data de începere a calculării dobânzii. Pentru titluri de valoare purtătoare de dobânzi, adăugarea acestei valori la valoarea prețului conduce la așa-numitul „preț necurățat” (*dirty price*).	√	√	√		√
Factorul venitului acumulat (*accrued income factor*)	Factor zilnic al venitului specific titlului de valoare, exprimat în procente și calculat urmând așa-numita abordare a debitorului (*debtor approach*). Factorul se bazează pe angajamente, respectiv ținând cont atât de dobânzile acumulate, cât și de venitul datorat diferenței dintre prețul de emisiune și prețul de răscumpărare.	√	√	√	√	

Denumirea atributului datelor de ieșire destinate procesării	Descriere	Seturi de date de ieșire aplicabile				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Tip de cupon (*coupon type*)	Tip de cupon, de exemplu, fix, variabil, în trepte etc.				√	√
Ultima rată de cupon (*last coupon rate*)	Cea mai recentă rată a cuponului în procente pe an, plătită efectiv (rată anualizată).	√	√	√	√	
Ultima dată de cupon (*last coupon date*)	Data celei mai recente rate a cuponului efectiv plătite. Atributul permite identificarea măsurii în care cea mai recentă rată a cuponului efectiv plătită se încadrează sau nu în perioada de raportare.	√	√	√	√	
Ultima frecvență a cuponului (*last coupon frequency*)	Frecvența pentru anul în care este plătită cea mai recentă rată a cuponului: „anual” devine AN, „semestrial” devine SA etc.	√	√	√	√	
Valoarea dividendului (*dividend amount*)	Valoarea celei mai recente plăți de dividende pe acțiune (pe tipuri de valoare a dividendului) înainte de impozitare (dividend brut).	√		√	√	
Tip de valoare a dividendului (*dividend amount type*)	Valoarea dividendului pe acțiune poate fi exprimată ca valoare a dividendului în moneda efectivă sau ca număr de acțiuni.	√		√	√	
Moneda dividendului (*dividend currency*)	Codul ISO 4217 al monedei ultimei plăți a dividendului.	√		√	√	
Data de decontare a dividendului (*dividend settlement date*)	Data de decontare a ultimei plăți a dividendului. Atributul permite identificarea măsurii în care plata dividendului se încadrează sau nu în perioada de raportare.	√		√	√	
Ultimul factor de divizare (*last split factor*)	Divizări de acțiuni și multiplicări de acțiuni.	√		√	√	
Ultima data de divizare (*last split date*)	Data de la care se aplică divizarea acțiunilor.	√		√	√	