

SUUNISED

EUROOPA KESKPANGA SUUNIS,

26. september 2012,

väärtpaberite keskandmebaasi andmekvaliteedihalduse raamistiku kohta

(EKP/2012/21)

(2012/689/EL)

EUROOPA KESKPANGA NÕUKOGU,

võttes arvesse Euroopa Keskpankade Süsteemi ja Euroopa Keskpanga põhikirja, eelkõige selle artikleid 5.1, 12.1 ja 14.3,

võttes arvesse nõukogu 23. novembri 1998. aasta määrust (EÜ) nr 2533/98 statistilise teabe kogumise kohta Euroopa Keskpanga poolt ⁽¹⁾

ning arvestades järgmist:

- (1) Väärtpaberite keskandmebaas (*Centralised Securities Database*, CSDB) on ühtne infotehnoloogia infrastruktuur, mida käitavad ühiselt Euroopa Keskpankade Süsteemi (EKPS) liikmed, sealhulgas euroalavälise liikmesriikide keskpannad (RKPd) vabatahtlikkuse alusel. CSDBs salvestatakse andmed ühikute kaupa, eelkõige väärtpaberite, nende emitentide ja hindade kohta.
- (2) Andmed kogutakse erinevatest allikatest, sealhulgas EKPSi liikmetelt, teatavatel kommertskanalitel, avalikelt ja administratiivsetest allikatest, ning edastatakse CSDB-le. Esineda võib risk, et sisendandmed võivad olla ebatäpsed või puudulikud. CSDB süsteem suudab luua kooskõla erinevatest allikatest pärinevate osaliselt vastuoluliste sisendandmete vahel ja suudab avastada ebatäpsed või puuduvaid andmeid. Ta liidab automaatselt erinevatest kattuvatest allikatest pärinevad sisendandmed võimalikuse piires üheks täielikuks ja kvaliteetseks kogumiks.
- (3) CSDB andmete üldist kvaliteeti saab hinnata ainult väljundandmete põhjal, mitte konkreetsete sisendandmete kogumite põhjal. Selleks, et tagada väljundandmete täielikkus, täpsus ja kooskõla, tuleb määratleda andmekvaliteedihalduse (*data quality management*, DQM) raamistik, mida kohaldatakse väljundi alusandmete suhtes, mis on väljundandmete alarühm, mida võib kasutada statistika

tegemisel või muudel eesmärkidel. Väljundi alusandmed tuleb esitada RKPdele mitte hiljem kui seitse tööpäeva pärast iga kalendrikuu lõppu.

- (4) Mõned väljundi alusandmed võivad hõlmata ajas muutuvaid omadusi, nagu hinnad või tuludega seotud teave. CSDB süsteem kontrollib tunnuseid automaatselt, kasutades statistilisi algoritme. Kooskõlas käesoleva suunisega kontrollivad pädevad asutused ainult tunnuseid, mis on määratletud I lisas iga DQM sihtväärtuse suhtes. Tunnuste täielik loetelu andmevoogude jaoks on sätestatud II lisas.
- (5) CSDB andmekvaliteedihalduse raamistikku tuleb kohaldada väljundi alusandmete suhtes, olenemata sisendandmete allikatest. See peab kehtestama euroala RKPde ja asjakohastel juhtudel Euroopa Keskpanga (EKP) vastutuse sisendandmete kvaliteedi eest CSDBs.
- (6) CSDB andmekvaliteedihalduse raamistik peab esiteks põhinema DQM sihtväärtustel, mis toob ära näitajad väljundi alusandmete kvaliteedi hindamiseks, ja teiseks DQM mõõdikuid, mis tuvastavad ja prioriseerivad iga DQM sihtväärtuse suhtes kontrollimist vajavad väljundi alusandmed. See peab põhinema ka DQM lävendil, mis määratleb kontrolli miinimumtaseme, mida tuleb DQM sihtväärtuse osas teostada.
- (7) Kuna võrdlusnäitajad puuduvad, ei tuvasta DQM sihtväärtused alati väljundi alusandmete vigu, kuid võivad tuvastada juhud, mil tuleks väljundi alusandmeid eraldi üle kontrollida.
- (8) Kuna CSDBd käitavad EKPS liikmed ühiselt, peaksid nad järgima samu DQM standardeid. Lisaks saavad euroalavälises liikmesriikides residentidest emitentide andmete kontrolli parimal viisil teha vastavate liikmesriikide RKPd. Kuiigi tunnustatakse, et EKP poolt vastu võetud suunised ei pane kohustusi euroalavälisele RKPdele,

⁽¹⁾ EÜT L 318, 27.11.1998, lk 8.

kohaldatakse Euroopa Keskpankade Süsteemi ja Euroopa Keskpannga põhikirja artiklit 5 nii euroala kui ka euroalavälise RKPde suhtes. Seega peaksid euroalavälised RKPd kujundama ja rakendama kõiki meetmeid, mida nad peavad kohaseks andmekvaliteedihalduse teostamisel kooskõlas käesoleva suunisega.

- (9) Selleks et parandada väljundandmete kvaliteeti, tuleb andmeallikate haldust (*data source management*, DSM) teostada eesmärgiga tuvastada ja parandada korduvaid ja struktuurseid sisendandmete vigu koostöös andmeesitajaga,

ON VASTU VÕTNUD KÄESOLEVA SUUNISE:

Artikkel 1

Mõisted

Käesolevas suunises kasutatakse järgmisi mõisteid:

- 1) „CSDB” – EKPSi poolt loodud väärtpaberite keskandmebaas asukohaga EKP ruumides;
- 2) „sisendandmed” – mis tahes andmed, mis on esitatud CSDB-le ühest või mitmest andmeallikast;
- 3) „väljundandmed” – andmed, mis CSDB poolt automaatselt tuletatakse sisendandmete sidumisel üheks täielikuks ja kvaliteetseks kogumiks;
- 4) „väljundi alusandmed” – II lisas toodud väljundandmete ja tunnuste alamhulk, mida kasutatakse sisendina statistika tegemisel või muudel eesmärkidel;
- 5) „andmekvaliteedihaldus” või „DQM” – väljundi alusandmete kvaliteedi tagamine, kontrollimine ja säilitamine, kasutades ja kohaldades DQM sihtväärtusi, DQM mõõdikuid, DQM lävendit ja DQM töökorraldust;
- 6) „andmeallikate haldus” või „DSM” – sisendandmete korduvate ja/või struktuursete vigade tuvastamine ja parandamine koostöös andmeesitajaga;
- 7) „esialgne DQM” – väljundi alusandmete andmekvaliteedihaldus, sh kõige viimase perioodi andmed, mida teostavad DQM pädevad asutused kord kuus, võttes arvesse kuulõpu eelläbivaatuseks esitatud väljundi alusandmeid;
- 8) „korraline DQM” – väljundi alusandmete andmekvaliteedihaldus, mida teostavad DQM pädevad asutused kord kuus, võttes arvesse CSDB-väliseid võrdlusnäitajaid, mis

on saadud erinevatest andmeallikatest eesmärgiga tagada, et CSDB väljundandmete kvaliteet vastab CSDB andmevoo nõuetele;

- 9) „DQM sihtväärtus” – I lisas määratletud võrdlusnäitaja väljundi alusandmete kvaliteedi hindamiseks;
- 10) „DQM mõõdik” – I lisas määratletud statistiline näitaja, et mõõta konkreetse DQM sihtväärtuse tasemele jõudmist;
- 11) „DQM lävend” – sellise kontrolli miinimumtase, mis tuleb teostada DQM raamistiku nõuete täitmiseks DQM sihtväärtuse osas;
- 12) „DQM töökorraldus” – tehniline protsess, mida kohaldatakse sisendandmete parandamisel DQM lävendi järgimiseks;
- 13) „kuulõpu eelläbivaatus” – igakuine väljundandmete ja DQM mõõdikute ajakohastamine, mille tulemusel esitatakse vastava kuulõpu kohandatud väljundandmed;
- 14) „tööpäev” – EKP veebilehel avaldatud täistööpäev, mil TARGET2 on avatud;
- 15) „kontrollimine” – protsess, mille puhul DQM pädevad asutused kontrollivad CSDB väljundi alusandmeid ja vajaduse korral parandavad CSDB sisendandmeid, järgides DQM töökorraldust;
- 16) „resident” – tähendus kattub määruse (EÜ) nr 2533/98 artiklis 1 määratletuga.

Artikkel 2

Reguleerimise ja -ala

1. Käesolev suunis kehtestab andmekvaliteedihalduse raamistiku CSDBs, mille eesmärk on tagada CSDB väljundandmete täielikkus, täpsus ja kooskõla, kohaldades nende andmete suhtes ühetaolisi kvaliteedistandardite reegleid.
2. CSDB andmekvaliteedihalduse raamistik põhineb andmekvaliteedihaldusel ja andmeallikate haldusel.

Artikkel 3

DQM pädevad asutused

1. Euroala liikmesriigi RKP on pädev tema riigi residentidest väärtpaberi emitentidega seotud andmete andmekvaliteedihalduse osas.

2. EKP on pädev andmekvaliteedihalduse andmete osas, mis on seotud euroalavälise emitentidega, v.a juhul, kui euroalavälise RKP on võtnud vastutuse teostada andmekvaliteedihaldust tema liikmesriigis resideerivate emitentidega seotud andmete osas.

Artikkel 4

DQM, DQM mõõdikud ja DQM lävendid

1. DQM pädevad asutused teostavad esialgset DQM-i ja korralist DQM-i. Seda tehes kontrollivad nad väljundi alusandmeid, olenemata nende allikatest.

2. DQM pädevad asutused kohaldavad DQM mõõdikuid kooskõlas I lisaga.

3. I lisas hõlmatud tunnuste osas kohaldavad DQM pädevad asutused DQM lävendit tasemel, mis tagab väljundi alusandmete kvaliteedi kooskõlas nõuetega, mis toetavad nende tunnuste kasutajaid kooskõlas II lisaga.

Artikkel 5

Esialgne DQM

1. Esialgset DQM-i kohaldatakse DQM sihtväärtustele 1, 2, 3a, 3b ja 6 kooskõlas I lisaga.

2. EKP teeb kuulõpu eelläbivaatuse kättesaadavaks seitse päeva enne iga kalendrikuu lõppu.

3. Esialgse DQM teostamisel kontrollivad DQM pädevad asutused olulisi statistilisi erindeid, et tagada pärast esialgse DQM teostamist hilisemate muutuste võimalikult suures ulatuses kajastamist väljundi alusandmetes.

4. DQM pädevad asutused kontrollivad kuulõpu eelläbivaatuse andmeid järgmise kalendrikuu teise tööpäeva lõpuks selles osas, milles DQM lävendid on DQM mõõdikute kohaselt ületatud.

5. Kui CSDB-väliseid võrdlusnäitajad ei ole kättesaadavad, tugineb esialgne DQM pädevale asutusele teadaolevale teabele või teabele, mida saab koguda uut aruandlusstruktuuri loomata.

6. DQM pädevad asutused parandavad sisendandmeid kooskõlas DQM töökorraldusega, kasutades CSDB süsteemi või edastades sisendandmed failina EKP-le.

Artikkel 6

Korraline DQM

1. Korralist DQM-i kohaldatakse DQM sihtväärtustele 3a, 3b, 4, 5 ja 6 kooskõlas I lisaga.

2. DQM pädevad asutused teostavad korralist DQM-i iga kalendrikuu lõpu seisuga sellele järgneva kuu jooksul. Nad kontrollivad väljundi alusandmeid, võttes arvesse kogu hetkel kättesaadavat teavet, hiljemalt korralise DQM teostamisele järgneva kalendrikuu teiseks tööpäevaks.

3. DQM pädevad asutused parandavad sisendandmeid kooskõlas kokkulepitud DQM töökorraldusega, kasutades CSDB süsteemi või edastades sisendandmed failina EKP-le.

Artikkel 7

DSMiga seotud ülesanded

1. DQM pädevad asutused tuvastavad mis tahes DSM probleemid ja teatavad nendest EKP-le.

2. EKP käsitleb korduvaid prioriteetseid DSMiga seotud vigu koostöös asjaomaste DQM pädevate asutustega ühe kuu jooksul alates DSM probleemi EKP-le teatamisest.

Artikkel 8

Sisendandmete parandamine

DQM pädev asutus peab parandatud sisendandmete olemasolu korral kasutama CSDB süsteemi mis tahes vigade parandamiseks ja andmelünkade täitmiseks sisendandmetes, mida ei parandatud kontrollimise käigus artikli 5 lõike 4 kohaselt.

Artikkel 9

Kvaliteedi aastaaruanne

EKP juhatus esitab EKP nõukogule väljundi alusandmete kvaliteedi aastaaruande, võttes arvesse EKPSi statistikakomitee seisukohti.

Artikkel 10

Muudatuste tegemise lihtsustatud kord

Võttes arvesse EKPSi statistikakomitee seisukohti, on EKP juhatusel õigus teha käesoleva suunise lisades tehnilisi muudatusi, kui need ei muuda suunise aluspõhimõtteid, sh EKP ja RKPde vahelist vastutuse jaotust, ega mõjuta oluliselt DQM pädevate asutuste aruandluskoormust. EKP juhatus teatab EKP nõukogule mis tahes sellisest muudatusest põhjendamatult viivitusega.

Artikkel 11

Jõustumine

1. Käesolev suunis jõustub 1. novembril 2012.

2. Käesolevat suunist kohaldatakse alates 1. juulist 2013.

*Artikkel 12***Adressaadid**

Käesolev suunis on adresseeritud kõikidele eurosüsteemi keskpankadele.

Frankfurt Maini ääres, 26. september 2012

EKP nõukogu nimel

EKP president

Mario DRAGHI

DQM SIHTVÄÄRTUSED, KASUTUSALA, TUNNUSED JA DQM LÄVENDI ALUS

DQM sihtvärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
Sihtvärtus 1: andmete stabiilsus – positsioonide andmed	<p>Mõiste</p> <p>See mõõdik määratletakse iga residentsuse riigi / sektori kombinatsiooni kohta kaalutud indeksi muutuse mahuna rahalises väärtuses. Indeksi väärtus 1 näitab, et vastav tunnus ei ole muutunud ühegi hõlmatud väärtpaberi osas; indeksi väärtus 0 näitab, et tunnus on muutunud kõikide väärtpaberite osas.</p> <p>Kui indeks langeb alla 1, tuvastatakse konkreetset väärtpaberid, mille muutunud tunnused põhjustasid indeksi languse, eesmärgiga kontrollida muutusi, kuni saavutatakse lävend.</p> <p>Sündmused, mis tingivad indeksi muutuse</p> <p>Eeldatavalt muutumatute tunnuste osas tekitab indeksimuutuse mis tahes kuudevaheline erinevus.</p> <p>Muutuda võivate tunnuste osas tekitab indeksimuutuse kuudevaheline erinevus, mis on suurem kui 25 %.</p> <p>Kaetus</p> <p>See DQM mõõdik hõlmab kõiki investeerimisfondide osakuid, omandi- ja võlaväärtpabereid, sh sertifikaate, mille tähtaeg ei ole üle kolme kuu.</p>	<p>Sihtvärtus 1 hindab positsioonide andmete stabiilsust.</p> <p>Kontrollimata muutused CSDB tunnustes ei või vähendada stabiilsete andmete osakaalu alla DQM lävendi järgmiste emitendi sektorite osas vastavalt Euroopa arvepidamissüsteemile (ESA) (1) sektorite osas:</p> <ul style="list-style-type: none"> — S.11: mittefinantsettevõtted (S.11 ESA 95s) — S.121: keskpang (S.121 ESA 95s) — S.122: hoiustavad ettevõtted, v.a keskpang (S.122 ESA 95s) — S.123: rahaturufondid (S.122 ESA 95s) — S.124: investeerimisfondid, mis ei ole rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.125: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide (S.123 ESA 95s) — S.126: finantsvahenduse abiettevõtted (S.124 ESA 95s) — S.127: varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad (S.123 ESA 95s) — S.128: kindlustusseltsid (S.125 ESA 95s) — S.129: pensionifondid (S.125 ESA 95s) — S.13: valitsemissektor (S.13 ESA 95s) 	<p>Otsesed tunnused: võlainstrumenti emissiooni kuupäev, võlainstrumenti lunastamise kuupäev, nimivaluuta, hinna esitamise viis, ESA instrumenti klassifikaator, emitendi residentsuse riik, emitendi ESA sektor, emitendi Euroopa majanduse tegevusalade statistiline klassifikaator (NACE), jääkväärtus, kaubeldavate aktsiate arv noteeritud aktsiate puhul.</p>	<p>Jääkväärtused või turukapitalisatsioon eurodes, mida väljendatakse osakaaluna positsioonidest.</p>

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
<p>Sihtväärtus 2:</p> <p>andmete täpsus – uued emissioonid ja lunastused; netoemissioonid</p>	<p>Mõiste</p> <p>Mõõdik määratletakse iga riigi residentsuse / sektori kombinatsioonis ning see hõlmab uusi emissioone, lunastusi ja võlaväärtpaberite protsendina väljendatud jääkväärtusi.</p> <p>Mõõdik seob netoemissioone kuus eelmise kuu lõpu jääkväärtusega võrreldes (muutus protsentides) ja jälgib võla jääkväärtuste muutusi.</p> <p>Andmeid peab saama disagregeerida, et kindlaks teha konkreetset uued emissioonid ja lunastused, millest tulenes jääkväärtuse muutus. Neid liikumisi tuleb kontrollida, kuni lävend on saavutatud.</p>	<p>Sihtväärtus 2 hindab uusi emissioone ja lunastusi jääkväärtuste suhtes.</p> <p>Protsendina väljendatud võlaväärtpaberite uute emissioonide ja lunastuste kontrollimata jääkväärtused ei või ületada DQM lävendit järgmiste ESA emitendi sektorite osas:</p> <ul style="list-style-type: none"> — S.11: mittefinantsettevõtted (S.11 ESA 95s) — S.121: keskpang (S.121 ESA 95s) — S.122: hoiustavad ettevõtted, v.a keskpang (S.122 ESA 95s) — S.123: rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.124: investeerimisfondid, mis ei ole rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.125: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide (S.123 ESA 95s) — S.126: finantsvahenduse abiettevõtted (S.124 ESA 95s) — S.127: varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad (S.123 ESA 95s) — S.128: kindlustusseltsid (S.125 ESA 95s) — S.129: pensionifondid (S.125 ESA 95s) — S.13: valitsemissektor (S.13 ESA 95s) 	<p>Otsesed tunnused: jääkväärtused.</p> <p>Kaudsed tunnused: emissiooni kuupäev, lunastamise päev, nimivaluuta, hinna esitamise viis, instrumendi ESA klassifikaator, emitendi residentsuse riik, emitendi ESA sektor.</p>	<p>Jääkväärtused eurodes, mida väljendatakse suhtelise muutusena vastavate positsioonide suhtes.</p>

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
<p>Sihtväärtus 3a:</p> <p>andmete täpsus – toetab emitendi sektori õiget määratlust ja andmete tuletamist emitentide kaupa</p>	<p>Mõiste taust</p> <p>CSDB ühendab emitendi ja instrumendi teabe suhte baasil, mis on nn üks mitmega, st üks emitent võib olla seotud mitme instrumendiga, kuid iga instrument saab olla seotud vaid ühe emitendiga. Instrumendi-emitendi seos toimib konkreetsele emitendile erinevate sisendandmete esitajate poolt omistatud identifitseerimisandmete alusel. Erinevate andmeesitajate identifitseerimisandmed ei lange kokku, kuna siiani puudub ühtne standard, kuid need peaksid olema kooskõlas.</p> <p>Kui sisendandmete esitajad esitavad sama instrumendi osas ebakõlalisi (vastuolulisi) emitendi identifitseerimise andmeid, st nad on emitendi osas eri arvamusel, ei saa instrumenti määrata konkreetsele emitendile ja ta suunatakse „vastuoludega kogumisse”. Vastuoludega kogumit saab sellegipoolest liigitada riigi ja sektori järgi, kuigi puudub kooskõlaline seos instrumendi ja emitendi vahel.</p> <p>Vastuoludega kogumi instrumendid takistavad konkreetse emitendi poolt emiteeritud instrumentide andmete kooskõlalist ja usaldusväärset tuletamist.</p> <p>Vastuoludega kogumi instrumendid suurendavad valesti liigitamise riski residentsuse või sektori lõikes.</p> <p>Mõiste</p> <p>Iga residentsuse riigi kohta määrab mõõdik vastuoludega kogumis olevad instrumendid ja seostab need koguse või summa põhjal protsendina kõigi selle riigi kõikidest instrumentidest.</p> <p>Kaetus</p> <p>Mõõdik hõlmab kõiki CSDBs olevaid instrumente.</p>	<p>Sihtväärtus 3a hindab emitentide kogumi õiget identifitseerimist.</p> <p>Kui instrumendi emitendi osas esineb ebakõla, st instrument on vastuoludega kogumis, ei tohi need instrumendid ületada DQM lävendit.</p>	<p>Otsesed tunnused: identifitseerimisandmed, mille alusel jaotatakse kogumitesse.</p>	<p>Vastuoludega kogumi instrumentide jääkväärtused eurodes, mida väljendatakse protsendina kõikide instrumentide jääkväärtustest.</p>

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
<p>Sihtväärtus 3b:</p> <p>andmete täpsus – toetab emitendi sektori õiget määratlust ja andmete tuletamist emitentide kaupa</p>	<p>Mõiste taust</p> <p>CSDB ühendab emitendi ja instrumendi teabe suhte baasil, mis on nn üks mitmega, st üks emitent võib olla seotud mitme instrumendiga, kuid iga instrument saab olla seotud vaid ühe emitendiga. Instrumendi-emitendi seos toimib konkreetsele emitendile erinevate sisendandmete esitajate poolt omistatud identifitseerimisandmete alusel. Erinevate andmeesitajate identifitseerimisandmed ei lange kokku, kuna siiani puudub ühtne standard, kuid need peaksid olema kooskõlas.</p> <p>Kui konkreetse instrumendi osas ei esita ükski andmeesitaja emitendi identifitseerimise andmeid, on risk, et instrumenti ei määrata konkreetsele emitendile ja ta jääb „autonoomsesse kogumisse”, mis koosneb ainult sellest instrumendist. Autonoomseid kogumeid saab sellegipoolest liigitada riigi ja sektori järgi, kuigi puudub kooskõlaline seos instrumenti emitendiga.</p> <p>Autonoomsete kogumite instrumendid takistavad konkreetse emitendi poolt emiteeritud instrumentide andmete kooskõlalist ja usaldusväärset tuletamist.</p> <p>Instrumendid autonoomsetes kogumites suurendavad valesti liigitamise riski residentsuse riigi või sektori lõikes, kuna nende kohta esitatakse mittetäielik teave.</p> <p>Mõiste</p> <p>Iga residentsuse riigi kohta määrab mõõdik autonoomsetes kogumites olevad instrumendid ja seostab need koguse või summa põhjal protsendina selle riigi kõikidest instrumentidest.</p>	<p>Sihtväärtus 3b hindab emitentide kogumi õiget identifitseerimist.</p> <p>Kui instrumendi emitendi kohta puudub usaldusväärne teave, st instrument on autonoomses kogumis, ei tohi need instrumendid ületada DQM lävendit.</p>	<p>Otsesed tunnused: emitendi identifitseerimise andmed, mille alusel jaotatakse kogumitesse.</p>	<p>Autonoomse kogumi instrumentide jääkväärtused eurodes, protsendina kõikide instrumentide jääkväärtustest.</p>

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
	<p>Kaetus</p> <p>Mõõdik hõlmab kõiki CSDBs olevaid instrumente.</p>			
<p>Sihtväärtus 4:</p> <p>andmete täpsus – võlaväärtpaberite, sh sertifikaatide jääkväärtused</p>	<p>Mõiste</p> <p>Mõõdik agregeerib võlaväärtpaberite, sh sertifikaatide seisud iga emitendi residentsuse riigi ja sektori kaupa, võttes arvesse väärtpaberite emissioonide statistika (<i>securities issues statistics, SEC</i>) mõistet.</p> <p>Agregaati võrreldakse vastava SEC näitajaga ja arvutatakse CSDB andmete kõrvalekalle protsentides.</p> <p>Kontrollimata ja selgituseta erinevused ei või ületada DQM lävendit.</p>	<p>Sihtväärtus 4 võrdleb CSDB väljundandmeid väliste võrdlusandmetega.</p> <p>Kontrollimata ja selgituseta erinevused sama kuupäeva agregeeritud CSDB andmete ja vastava EKP SECi teabe või muude usaldusväärsete võrdlusandmete vahel, kui need võrdlusandmed on kättesaadavad, ei või ületada DQM lävendit emitendi järgmiste ESA sektorite osas:</p> <ul style="list-style-type: none"> — S.11: mittefinantsettevõtted (S.11 ESA 95s) — S.121: keskpang (S.121 ESA 95s) — S.122: hoiustavad ettevõtted, v.a keskpang (S.122 ESA 95s) — S.123: rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.124: investeerimisfondid, mis ei ole rahaturufondid (S.124 ESA 95s) — S.125: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide (S.125 ESA 95s) — S.126: finantsvahenduse abiettevõtted (S.126 ESA 95s) — S.127: varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad (S.127 ESA 95s) — S.128: kindlustusseltsid (S.128 ESA 95s) — S.129: pensionifondid (S.129 ESA 95s) — S.13: valitsemissektor (S.13 ESA 95s) 	<p>Otsesed tunnused: jääkväärtused eurodes, turukapitalisatsioon eurodes.</p> <p>Kaudsed tunnused: emissiooni kuupäev, lunastamispäev, valuuta, emitendi ESA sektor, residentsuse riik.</p>	<p>Jääkväärtused eurodes või turukapitalisatsioon eurodes, mida väljendatakse protsendilise erinevusega CSDB ja väliste võrdlusandmete vahel.</p>

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
Sihtväärtus 5: andmete täpsus – aktsiate turukapitalisatsioon	<p>Mõiste</p> <p>Mõõdik agregeerib omandiväärtpaperite turukapitalisatsiooni iga emitendi residentsuse riigi ja sektori kaupa, võttes arvesse SEC mõistet.</p> <p>Agregaati võrreldakse vastava SEC näitajaga ja arvutatakse CSDB andmete kõrvalekalle protsentides.</p> <p>Kontrollimata ja selgituseta erinevused ei või ületada DQM lävendit.</p>	<p>Mõõdik 5 võrdleb CSDB väljundandmeid väliste võrdlusandmetega.</p> <p>Kontrollimata ja selgituseta erinevused sama kuupäeva agregeeritud CSDB teabe ja vastavate EKP SECi andmete või muude usaldusväärsete võrdlusandmete vahel, kui need võrdlusandmed on kättesaadavad, ei või ületada DQM lävendit järgmiste emitendi ESA sektorite osas:</p> <ul style="list-style-type: none"> — S.11: mittefinantsettevõtted (S.11 ESA 95s) — S.121: keskpank (S.121 ESA 95s) — S.122: hoiustavad ettevõtted, v.a keskpank (S.122 ESA 95s) — S.123: rahaturufondid (S.122 ESA 95s) — S.124: investeerimisfondid, mis ei ole rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.125: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide (S.123 ESA 95s) — S.126: finantsvahenduse abiettevõtted (S.124 ESA 95s) — S.127: varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad (S.123 ESA 95s) — S.128: kindlustusseltsid (S.125 ESA 95s) — S.129: pensionifondid (S.125 ESA 95s) — S.13: valitsemissektor (S.13 ESA 95s) 	<p>Otsesed tunnused: jääkväärtused eurodes, noteeritud aktsiate arv.</p> <p>Kaudsed tunnused: nimivaluuta, emitendi ESA sektor, residentsuse riik, noteeritud aktsiate hind (ainult erindite kontroll).</p>	<p>Jääkväärtused eurodes või turukapitalisatsioon eurodes, mida väljendatakse protsendilise erinevusena CSDB ja väliste võrdlusandmete vahel.</p>

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	Kasutusala	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
Sihtväärtus 6: andmete täpsus – emitendi liigitus	<p>Mõiste</p> <p>Mõõdik jagab emitendid residentsuse riigi / ESA sektori alusel, võttes arvesse nende väärtpaperitest tulenevaid kohustusi kokku (aktsiad ja võlainstrumendid kokku). Mõõdik osutab ka absoluutvahedele erinevate emitentide vahel, et lihtsustada oluliste erindite tuvastamist jääkväärtustes või turukapitalisatsioonis. Emitendi residentsuse riigi ja sektori liigitust kontrollitakse DQM lävendini.</p> <p>Kaetus</p> <p>See mõõdik hõlmab kõiki investeerimisfondide osakuid, omandi- ja võlaväärtpabeleid, mille lunastamise tähtaeg ei ole üle kolme kuu.</p>	<p>Sihtväärtus 6 hindab emitentide statistilist liigitust.</p> <p>Emitentide statistilist liigitust kuni DQM lävendini kontrollitakse järgmiste ESA emitentide sektorite osas:</p> <ul style="list-style-type: none"> — S.11: mittefinantsettevõtted (S.11 ESA 95s) — S.121: keskpang (S.121 ESA 95s) — S.122: hoiustavad ettevõtted, v.a keskpang (S.122 ESA 95s) — S.123: rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.124: investeerimisfondid, mis ei ole rahaturufondid (S.123 ESA 95s) — S.125: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide (S.123 ESA 95s) — S.126: finantsvahenduse abiettevõtted (S.124 ESA 95s) — S.127: varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad (S.123 ESA 95s) — S.128: kindlustusseltsid (S.125 ESA 95s) — S.129: pensionifondid (S.125 ESA 95s) — S.13: valitsemissektor (S.13 ESA 95s) 	<p>Emitendi ESA sektor, residentsuse riik.</p>	<p>Jääkväärtused või turukapitalisatsioon eurodes, väljendatud kui „kapitalisatsioon”, st jääkväärtused pluss turukapitalisatsioon emitendi kohta.</p>

(¹) Kategooriate nummerdus kajastab nummerdust ettepanekus, mis käsitleb määrust Euroopa Liidus kasutatava Euroopa rahvamajanduse ja regionaalse arvepidamise süsteemi kohta, KOM(2010) 774 (lõplik).

II LISA

ANDMEVOOD JA VÄLJUNDI ALUSANDMETE TUNNUSED DQM RAAMISTIKUS

DQM raamistik hõlmab järgmisi andmevooge, millel on erinevad kasutused.

- Välisstatistikas kasutatav andmevoog (EXT 1.0)
- Väärtpaberistamistingutesse kaasatud finantsvahendusevõtete statistikas kasutatav andmevoog (FVC 1.0)
- Investeeringufondide statistikas kasutatav andmevoog (IF 1.0)
- Väärtpaberiosaluste statistikas kasutatav andmevoog (SHS 1.0)
- Valitsemissektori väärtpaberite rahastamise statistikas kasutatav andmevoog (GSF 1.0)

Väljundi alusandmete tunnused toetatud andmevoos jaoks:

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber, ISIN kood)	Väärtpaberi ISIN kood	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (instrumendi liik Euroopa arvepidamissüsteemis)	Väärtpaberi liigitus ESAs.	√	√	√	√	√
Debt type (võla liik)	Võlainstrumendi liik.				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Tunnus, mida saab kasutada selliste väärtpaberite tuvastamiseks, mis on hõlmatud hetkeseisudes kooskõlas EKP SECi mõistetega.					√
Instrument supplementary class (instrumendi täiendav liik)	Täiendav tunnus, millega saab tuvastada, kas instrument peaks olema SECiga hõlmatud või mitte. Tunnuse väärtused võivad olla näiteks 1 = „coupon strip”, 2 = „principal strip” jne.					√
Security status (väärtpaberi staatus)	Täiendav tunnus, millega saab tuvastada, kas instrument peaks olema SECiga hõlmatud või mitte. Tunnusega saab tuvastada, kas instrument eksisteerib või mitte.					√
Asset securitisation type (vara väärtpaberistamise liik)	Tagatisvara liik.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Tunnus, mis näitab, kas instrumenti saab kasutada eurosüsteemi krediidiope ratsioonide tagatisena.				√	
Nominal currency (nimivaluuta)	Instrumendi nimivaluuta (Rahvusvaheline Standardiorganisatsioon (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (emissiooni kuupäev)	Kuupäev, mil emitent annab väärtpaperid makse vastu korraldajale üle. Sellel kuupäeval on väärtpaperid esimest korda kättesaadavad investoritele. Märkus: põhiosast eraldatud kupongiga võlakirja (strip) osas osutab see veerg kuupäevale, mil kupong/põhiosa eraldatakse.	√	√	√	√	√
Maturity date (lunastuspäev)	Kuupäev, mil võlainstrument tagasi ostetakse.	√	√	√	√	√
Residual maturity (järelejäänud tähtaeg)	Instrumenti järelejäänud tähtaeg instrumenti lunastuspäevani.					√
Issuer domicile country (emitendi asukohariik)	Väärtpaperi emitendi juriidilise registreerimise koht riik (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (emitendi ESA sektor)	Emitendi institutsionaalne sektor ESA kohaselt.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification (emitendi Euroopa majandustegevuste klassifikaator, NACE)	Peamine majandustegevuse liik NACE kohaselt.	√				
Amount issued (emiteeritud summa)	Summa, mis saadi võlainstrumenti emiteerimisel (nimiväärtus). Stripi osas näitab see veerg väärtust, millest kupong põhisummast eraldatakse. Sama ISIN koodiga, kuid osadena emiteeritud väärtpaperite puhul osutab see veerg emissiooni kogusummat. Emiteeritud summa on väljendatud nimivaluutas.					√
Amount outstanding (jäakväärtus)	Jäakväärtus nimiväärtuses. Sama ISIN koodiga, kuid osadena emiteeritud väärtpaperite puhul osutab see veerg emissiooni kogusummale miinus tagasiostud. Väärtused näidatakse nimivaluutas. Jäakväärtused näidatakse nimivaluutas. Kui nimivaluuta puudub, näidatakse jäakväärtus eurodes.	√			√	√
Amount outstanding in euro (jäakväärtus eurodes)	Jäakväärtused konverteeritud eurodesse, kasutades euro vaatluskuupäeval kehtivat vahetuskursi nimivaluuta suhtes.				√	√
Market capitalisation (turukapitalisatsioon)	Viimane kättesaadav turukapitalisatsioon. Turukapitalisatsioon on väljendatud nimivaluutas. Kui nimivaluuta puudub, esitatakse turukapitalisatsioon eurodes.				√	

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (lunastuspäevani jäänud tootlus)	Väärtpaberi konkreetne tootlus lunastuspäevani protsentides.				√	√
Short name (lühinimetus)	Emitendi poolt antud lühinimetus, mis määratakse emissiooni tunnuste ja kättesaadava teabe põhjal.					√
Pool factor (varutegur)	Hüpoteegiga tagatud väärtpaberite osas on varutegur ehk järelejäänud põhisumma seis näitaja väärtpaberi aluseks oleva hüpoteegivaru põhisumma järelejäänud seis jagatuna algse põhisumma seisuga.	√	√	√	√	√
Quotation basis (hinna esitamise viis)	Instrumendi hinna esitamise viis, näiteks protsent nimiväärtusest (protsent) või aktsia/osa valuutas (ühikud).	√	√	√	√	√
Price value (hind)	Instrumendi viimane kättesaadav esinduslik hind vaatluskuupäeval vastavalt instrumendi hinna esitamise viisile, võimaluse korral nimivaluutas. Intressi tootvate väärtpaberite puhul esitatakse „puhashind“ (<i>clean price</i>), st kogunenud intress jäetakse välja.	√	√	√	√	√
Price value type (hinna liik)	Hinna olemus, st kas see näitab turuhinda, on prognoos- või vaikeväärtus.	√	√	√	√	√
Monthly average price (kuu keskmine hind)	Instrumendi normaliseeritud hindade viimase 30 kalendripäeva keskmine vastavalt instrumendi hinna esitamise viisile, võimaluse korral nimivaluutas.	√			√	
Redemption type (lunastamise liik)	Lunastamise liik, näiteks täismakse, tähtajatu, struktureeritud, aasta-, seeria-, ebaregulaarne, null- või astmeline makse.					√
Redemption frequency (lunastamise sagedus)	Tagasimaksete arv aastas võlainstrumendi kohta.					√
Redemption price (lunastamise hind)	Lõplik lunastamise hind.					√
Accrued interest (kogunenud intress)	Viimasest kupongimaksest või arvutamise algusest kogunenud intress. Intressi tootvate väärtpaberite osas saadakse selle väärtuse lisamisel hinnale nn musthind (<i>dirty price</i>).	√	√	√		√
Accrued income factor (tekkepõhise tulu näitaja)	Konkreetses väärtpaberi tootluse näitaja päeva kohta protsentides, mis arvutatakse laenusaaaja meetodil. Näitaja on tekkepõhine, tulemus ühendab nii kogunenud intressi kui ka tekkepõhise tulu, mis kujuneb erinevuse vahena emissiooni- ja lunastamise hinnas.	√	√	√	√	

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (kupongi liik)	Kupongi liik, näiteks fikseeritud, ujuva või astmelise intressimääraga.				√	√
Last coupon rate (viimane kupongi intressimäär)	Viimase tegelikult makstud kupongimakse määr protsentides aasta kohta (aastapõhine).	√	√	√	√	
Last coupon date (viimase kupongimakse kuupäev)	Viimase tegelikult makstud kupongimakse kuupäev. Tunnus võimaldab tuvastada, kas viimane tegelikult tehtud kupongimakse langeb aruandlusperioodi või mitte.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (viimase kupongimakse sagedus)	Viimase kupongimakse sagedus aasta kohta: kupongimakse sagedus aastas: aastamakse AN, poolaastamakse SA jne.	√	√	√	√	
Dividend amount (dividendi suurus)	Viimane dividendi suurus aktsia kohta (dividendi summa liigi alusel) enne maksustamist (brutodividend).	√		√	√	
Dividend amount type (dividendi summa liik)	Dividendi suurus aktsia kohta võib olla esitatud dividendina valuutas või aktsiate arvus.	√		√	√	
Dividend currency (dividendi valuuta)	Viimase dividendimakse valuuta ISO 4217 kood.	√		√	√	
Dividend Settlement date (dividendimakse arvelduskuupäev)	Viimase dividendimakse arvelduskuupäev. Tunnus võimaldab tuvastada, kas dividendimakse langeb aruandlusperioodi või mitte.	√		√	√	
Last split factor (viimase spliti näitaja)	Aktsia splitid ja pöördsplitid.	√		√	√	
Last split date (viimase spliti kuupäev)	Kuupäev, mil aktsiasplit jõustub.	√		√	√	