

RIKTLINJER

EUROPEISKA CENTRALBANKENS RIKTLINJE

av den 26 september 2012

om regler för kvalitetssäkringen av uppgifter i den centraliserade värdepappersdatabasen

(ECB/2012/21)

(2012/689/EU)

ECB-RÅDET HAR ANTAGIT DENNA RIKTLINJE

med beaktande av stadgan för Europeiska centralbankssystemet och Europeiska centralbanken, särskilt artiklarna 5.1, 12.1 och 14.3,

med beaktande av rådets förordning (EG) nr 2533/98 av den 23 november 1998 om Europeiska centralbankens insamling av statistiska uppgifter⁽¹⁾, och

av följande skäl:

- (1) Den centraliserade värdepappersdatabasen (*Centralised Securities Database (CSDB)*) utgörs av en gemensam it-infrastruktur som bedrivs gemensamt av Europeiska centralbankssystemet (ECBS) och nationella centralbanker i medlemsstater utanför euroområdet som frivilligt deltar i driften av CSDB. CSDB innehåller uppgifter post för post, särskilt uppgifter om värdepapper, emittenter och priser.
- (2) Uppgifterna samlas in från olika källor bl.a. ECBS-medlemmar, kommersiella leverantörer, den offentliga sektorn samt administrativa källor och sänds sedan över till CSDB. Det finns en risk för att sådana uppgifter är felaktiga eller ofullständiga. CSDB-systemet kan jämka samman delvis inkonsistenta uppgifter från olika källor och upptäcka uppgifter som är ofullständiga eller saknas. Systemet sammanställer uppgifter från olika överlappande källor och skapar en komplett databaspost av hög kvalitet av dessa om detta är möjligt.
- (3) Den samlade kvaliteten på uppgifterna i CSDB kan bara garanteras i de utgående uppgifterna, inte genom att granska individuella uppsättningar ingående uppgifter. För att säkerställa att de utgående uppgifterna så långt möjligt är fullständiga, korrekta och konsistenta är det nödvändigt att skapa regler för kvalitetssäkringen (DQM)

av uppgifterna som tillämpas på produktionsdata som är en delmängd av de utgående uppgifterna som kan användas för statistikproduktion eller andra ändamål. Produktionsdata tillhandahålls de nationella centralbankerna senast sju arbetsdagar efter varje kalendermånads utgång.

- (4) Vissa produktionsdata innehåller även attribut som priser eller avkastningsrelaterad information som fluktuerar över tiden. Dessa attribut verifieras automatiskt av CSDB-systemet med hjälp av statistiska algoritmer. Endast attribut som anges i bilaga I för varje DQM-mål behöver verifieras av behöriga myndigheter i enlighet med denna riktlinje. En fullständig förteckning över de attribut som utgör produktionsdatan framgår av bilaga II.
- (5) Regler för kvalitetssäkring i CSDB bör tillämpas på produktionsdata oavsett var uppgifterna erhållits från. Av reglerna bör det framgå vilket ansvar euroområdets nationella centralbanker har för kvaliteten på de utgående uppgifterna i CSDB och, i förekommande fall, Europeiska centralbankens (ECB).
- (6) Reglerna för kvalitetssäkringen i CSDB bör i första hand baseras på DQM-mål som gör det möjligt att bedöma kvaliteten på produktionsdatan, och i andra hand på DQM-indikatorer som, för varje DQM-mål, identifierar och prioriterar den produktionsdata som måste verifieras. De bör även baseras på DQM-trösklar som anger miniminivån för den verifiering som ska utföras avseende ett DQM-mål.
- (7) Eftersom det saknas referensuppgifter kan DQM-målen inte alltid identifiera fel i produktionsdatan utan bara identifiera fall där produktionsdatan måste verifieras manuellt.
- (8) Eftersom CSDB drivs gemensamt av alla ECBS-medlemmar bör de alla sträva efter att tillämpa samma DQM-standarder. Nationella centralbanker utanför euroområdet är bäst lämpade att utföra kvalitetssäkringen av sådana uppgifter som avser emittenter med hemvist i deras medlemsstat. Även om de riktlinjer som ECB utfärdar inte

⁽¹⁾ EGT L 318, 27.11.1998, s. 8.

får medföra några skyldigheter för nationella centralbanker utanför euroområdet, är ändå artikel 5 i stadgan för Europeiska centralbankssystemet och Europeiska centralbanken tillämplig på såväl euroområdets nationella centralbanker som nationella centralbanker utanför euroområdet. De nationella centralbankerna utanför euroområdet bör därför vidta och genomföra alla de åtgärder som de anser lämpliga för att genomföra en kvalitetssäkring i enlighet med denna riktlinje.

- (9) För att förbättra kvaliteten på utgående uppgifter bör man hantera källdatan (DSM) för att identifiera och korrigera repetitiva och strukturella fel i de ingående uppgifterna och lösa dessa med uppgiftsleverantören.

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

Artikel 1

Definitioner

I denna riktlinje avses med

1. *CSDB*: den centraliserade värdepappersdatabas som skapats av ECBS och som befinner sig i ECB:s lokaler,
2. *ingående uppgifter*: uppgifter som CSDB erhåller från en eller flera uppgiftskällor,
3. *utgående uppgifter*: uppgifter som automatiskt härleds i CSDB genom att ingående uppgifter sammanställs till en komplett databaspost av hög kvalitet,
4. *produktionsdata*: den delmängd av utgående uppgifter och kännetecken som anges i bilaga II som kan användas som utgångspunkt för statistikproduktion eller andra ändamål,
5. *regler för kvalitetssäkring eller DQM*: att säkerställa, verifiera och underhålla kvaliteten på produktionsdata med hjälp av DQM-mål, DQM-indikatorer, DQM-trösklar och DQM-processen,
6. *hantering av källdatan eller DSM*: identifiera och korrigera repetitiva och/eller strukturella fel i de ingående uppgifterna och lösa felen med uppgiftsleverantören,
7. *initial DQM*: en DQM av produktionsdata, inklusive uppgifter som omfattar den senaste tidsperioden, utförd av en behörig DQM-myndighet på månadsbasis med beaktande av de produktionsdata som tillhandahållits som preliminära månadsuppgifter,
8. *regelbunden DQM*: DQM av produktionsdata som utförs av en behörig DQM-myndighet på månadsbasis med beaktande av icke-CSDB kontrolluppgifter som tillhandahålls av olika uppgiftslämnare för att säkerställa att CSDB:s utgående uppgifter motsvarar kvalitetskraven för CSDB-produktionsdata,
9. *DQM-mål*: mål för att bedöma kvaliteten på produktionsdata, enligt vad som framgår av bilaga I,
10. *DQM-indikator*: en statistisk indikator som mäter i vilken utsträckning ett visst DQM-mål har uppnåtts, enligt vad som framgår av bilaga I,
11. *DQM-tröskel*: miniminivån på det verifieringsarbete som ska utföras för att uppfylla DQM-reglerna för ett DQM-mål,
12. *DQM-process*: en teknisk process för att korrigera ingående uppgifter för att uppfylla en DQM-tröskel,
13. *preliminära månadsuppgifter*: en regelbunden, månadsvis, uppdatering av utgående uppgifter och DQM-indikatorer som ger preliminära utgående uppgifter avseende det kommande månadsslutet,
14. *arbetsdag*: varje hel dag då Target2 är öppet enligt vad som offentliggörs på ECB:s hemsida,
15. *verifiering*: ett förfarande där en behörig DQM-myndighet kontrollerar CSDB produktionsdata och vid behov korregerar CSDB:s ingående uppgifter med tillämpning av en DQM-process,
16. *hemvist*: har samma betydelse som hemvist enligt definitionen i artikel 1 i förordning (EG) nr 2533/98.

Artikel 2

Syfte och tillämpningsområde

1. Genom denna riktlinje inrättas regler för kvalitetssäkringen i CSDB med målet att säkerställa att de utgående uppgifterna i CSDB är fullständiga, korrekta och konsistenta genom att kontinuerligt tillämpa regler för kvalitetsstandarder för sådana uppgifter.
2. Kvalitetssäkringsarbetet i CSDB ska baseras på reglerna för kvalitetssäkring och hanteringen av källdata.

Artikel 3

Behöriga DQM-myndigheter

1. Den nationella centralbanken i den medlemsstat i euroområdet där en emittent har sitt hemvist ska vara behörig för reglerna för kvalitetssäkring avseende de uppgifter som rör den emittenten.

2. ECB ska vara behörig för reglerna för kvalitetssäkring avseende emittenter med hemvist utanför euroområdet, om inte en nationell centralbank utanför euroområdet åtagit sig att genomföra reglerna för kvalitetssäkring avseende uppgifter som rör emittenter med hemvist i den medlemsstaten.

Artikel 4

Regler för kvalitetssäkring, DQM-indikatorer och DQM-trösklar

1. Behöriga DQM-myndigheter ska genomföra initial DQM och regelbunden DQM. I detta arbete ska de verifiera produktionsdata, oavsett källan.

2. Behöriga DQM-myndigheter ska tillämpa DQM-indikatorer i enlighet med bilaga I.

3. För de attribut som omfattas av bilaga I ska behöriga DQM-myndigheter tillämpa DQM-trösklar på en nivå som säkerställer kvaliteten på produktionsdata i enlighet med kraven att stödja användningen av dessa respektive attribut enligt vad som framgår av bilaga II.

Artikel 5

Initial DQM

1. Initial DQM ska tillämpas på DQM-målen 1, 2, 3a, 3b och 6 enligt vad som framgår av bilaga I.

2. ECB ska tillhandahålla de preliminära månadsuppgifterna sju arbetsdagar före varje kalendermånads utgång.

3. När de utför en initial DQM ska de behöriga DQM-myndigheterna verifiera större statistiska avvikelser för att säkerställa att produktionsdatan, efter initial DQM, i största möjliga utsträckning speglar den senaste utvecklingen.

4. De behöriga DQM-myndigheterna ska verifiera de preliminära månadsuppgifterna senast i slutet av den andra arbetsdagen under påföljande månad i den utsträckning som, med beaktande av DQM-indikatorerna, DQM-trösklarna inte uppnåtts.

5. Om det saknas kontrolluppgifter utanför CSDB ska en initial DQM uteslutande baseras på information som är lättillgänglig för de behöriga DQM-myndigheterna eller som enkelt kan erhållas utan att man behöver skapa några nya rapporteringsstrukturer.

6. De behöriga DQM-myndigheterna ska korrigera ingående uppgifter i enlighet med DQM-processen genom att använda CSDB-systemet eller genom att ta fram filer med produktionsdata åt ECB.

Artikel 6

Regelbunden DQM

1. Regelbunden DQM ska tillämpas på DQM-målen 3a, 3b, 4, 5 och 6 enligt vad som framgår av bilaga I.

2. De behöriga DQM-myndigheterna ska utföra regelbunden DQM inom en månad efter varje kalendermånads utgång. De ska verifiera produktionsdata och beakta all information som är tillgänglig vid den tidpunkten, senast den andra arbetsdagen under den kalendermånad som följer på den månad då regelbunden DQM utförs.

3. De behöriga DQM-myndigheterna ska korrigera ingående uppgifter i enlighet med den avtalade DQM-processen genom att använda CSDB-systemet eller genom att ta fram filer med produktionsdata åt ECB.

Artikel 7

Arbetsuppgifter i samband med hanteringen av källdata

1. De behöriga DQM-myndigheterna ska identifiera problem som uppstår i samband med hanteringen av källdata och rapportera dessa till ECB.

2. ECB ska, i samarbete med de behöriga DQM-myndigheterna, söka lösningar på högprioriterade fel i samband med hanteringen av källdata inom en månad från den tidpunkt då problemen rapporterats till ECB.

Artikel 8

Korrigerig av ingående uppgifter

En behörig DQM-myndighet som har förbättrat ingående uppgifter ska använda CSDB-systemet för att korrigera fel och brister i sina ingående uppgifter som inte korrigerats inom ramen för den verifiering som avses i artikel 5.4.

Artikel 9

Årlig kvalitetsrapport

Med beaktande av de synpunkter som ECBS statistikkommitté framför ska ECB:s direktion en gång per år rapportera till ECB-rådet om kvaliteten på produktionsdatan.

Artikel 10

Förenklat ändringsförfarande

Med beaktande av de synpunkter som ECBS statistikkommitté framför har ECB:s direktion rätt att göra sådana tekniska ändringar i bilagorna till den här riktlinjen som varken ändrar riktlinjens underliggande begreppsram, inklusive ansvarsfördelningen mellan ECB och de nationella centralbankerna, eller som påtagligt påverkar rapporteringsbördan för de behöriga DQM-myndigheterna. ECB:s direktion ska omedelbart informera ECB-rådet om alla beslut som fattas enligt denna bestämmelse.

Artikel 11

Ikraftträdande

1. Denna riktlinje träder i kraft den 1 november 2012.

2. Denna riktlinje ska tillämpas från och med den 1 juli 2013.

*Artikel 12***Adressater**

Denna riktlinje riktar sig till alla centralbanker i Eurosystemet.

Utfärdad i Frankfurt am Main den 26 september 2012.

På ECB-rådets vägnar

Mario DRAGHI

ECB:s ordförande

DQM-MÅL, GENOMFÖRANDE, ATTRIBUT OCH DQM-TRÖSKLAR

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
Mål 1: Uppgifternas stabilitet – stockuppgifter	Koncept Indikatorn ska definieras för varje kombination av hemvistland/sector som ett volymvägt "förändringsindex", vägt med monetära belopp. Ett indexvärde på 1 anger att respektive attribut inte förändrats för något av de underliggande värdepapperena, och ett index på 0 anger att respektive attribut förändrats för alla värdepapper. Om ett index faller under 1 ska individuella värdepapper markeras med det ändrade attributet som medfört att indexet fallit så att man kan verifiera förändringen fram till dess att tröskelvärdet uppnås. Händelser som medför en förändring av index För enstaka attribut ska varje månadsvis förändring av attributen medföra en indexförändring. För sammansatta attribut ska varje månadsvis förändring som överstiger 25 % medföra en indexförändring. Täckning Denna DQM-indikator ska omfatta alla andelar i investeringsfonder, aktier och skuldinstrument inkl. certifikat vars förfallodag inte är äldre än tre månader.	Mål 1 bedömer stockuppgifternas stabilitet. Icke-verifierade ändringar av CSDB-attribut ska inte öka andelen stabila uppgifter bortom DQM-tröskeln för var och en av nedanstående emittentsektorer enligt europeiska nationalräkenskapssystemet (ENS) ⁽¹⁾: — S.11 "icke-finansiella företag" (S.11 enligt ENS 95) — S.121 "centralbanker" (S.121 enligt ENS 95) — S.122 "monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken" (S.122 enligt ENS 95) — S.123 "penningsmarknadsfonder" (S.122 enligt ENS 95) — S.124 "investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder" (S.123 enligt ENS 95) — S.125 "övriga finansinstitut, utom försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.123 enligt ENS 95). — S.126 "finansiella serviceföretag" (S.124 enligt ENS 95) — S.127 "koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag" (S.123 enligt ENS 95) — S.128 "försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.129 "pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.13 "offentlig sektor" (S.13 enligt ENS 95)	Explicita attribut: emissionsdag för skuld, förfallodag för skuld, nominell valuta, basen för prisangivelsen, instrumentklass enl. ENS, land där emittenten har sitt hemvist, emittentens ENS-sektor, emittentens klassifikation enl. Europeiska gemenskapernas statistiska näringsgrensindelning (Nace), utestående belopp, antal utelöpande aktier för det angivna aktieslaget.	Utestående belopp eller marknads-kapitalisering i euro, uttryckt som andel av stockuppgifterna.

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
Mål 2: Uppgifternas korrekthet – nyemissioner och inlösta belopp; nettoutgivning	Koncept Indikatorn ska definieras för varje kombination av hemvistland/sector och ska omfatta nyemissioner, inlösta och utestående belopp för skuldinstrument angivna i procent. Indikatorn ska koppla nettoutgivningen under månaden till utestående belopp vid föregående månads utgång (procentuell förändring) och visa den relativa utvecklingen för utestående skulder. Det ska vara möjligt att bedöma disaggregerade data ned till individuella nyemissioner och inlösen som orsakat förändringen av de utestående beloppen. Utvecklingen ska verifieras fram till dess att tröskelvärdet uppnås.	Mål 2 mäter nyemissioner och inlösta belopp mot respektive stockuppgifter. Overifierade uppgifter om utestående belopp om nyemissioner och inlösen av skuldinstrument som anges i procent ska till nettovärdet inte överskrida DQM-tröskeln för var och en av nedanstående emittentsektorer enligt ENS: — S.11 "icke-finansiella företag" (S.11 enligt ENS 95) — S.121 "centralbanker" (S.121 enligt ENS 95) — S.122 "monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken" (S.122 enligt ENS 95) — S.123 "penningsmarknadsfonder" (S.122 enligt ENS 95) — S.124 "investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder" (S.123 enligt ENS 95) — S.125 "övriga finansinstitut, utom försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.123 enligt ENS 95). — S.126 "finansiella serviceföretag" (S.124 enligt ENS 95) — S.127 "koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag" (S.123 enligt ENS 95) — S.128 "försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.129 "pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.13 "offentlig sektor" (S.13 enligt ENS 95)	Explicita attribut: utestående belopp. Implicita attribut: utgivningsdag, förfallodag, nominell valuta, basen för prisangivelsen, instrumentklass enl. ENS, land där emittenten har sitt hemvist, emittentens ENS-sektor.	Utestående belopp i euro, uttryckt som relativ utveckling jämfört med respektive stockuppgifter.

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
Mål 3a: Uppgifternas korrekthet – stöd för riktig sektorallokering och dataextraktion efter emittent	Konceptets bakgrund CSDB kopplar ihop information om emittent och instrument som en relation som kan beskrivas som "en till många", dvs. en emittent kan kopplas till många instrument men varje instrument kan bara kopplas till en emittent. Kopplingen instrument-emittent görs via individuella emittentkännetecken som de olika leverantörerna av ingående uppgifter tillhandahåller. Eftersom det än så länge saknas en gemensam standard använder de olika leverantörerna olika kännetecken, men dessa bör vara konsistenta. Om leverantörerna av ingående uppgifter tillhandahåller inkonsistenta (motstridiga) emittentkännetecken för samma instrument, dvs. om de inte stämmer överens i fråga om emittent, kan instrumentet inte tillordnas en viss emittent utan hamnar i gruppen "motstridiga". Gruppen "motstridiga" kan klassificeras korrekt efter land och sektor men det saknas en konsistent koppling mellan emittenten och instrumentet. Instrument i gruppen "motstridiga" förhindrar en konsistent och tillförlitlig extrahering av alla instrument som emitterats av en viss emittent. Instrument i gruppen "motstridiga" ökar risken för felklassificeringar efter land där emittenten har sitt hemvist eller sektor. Koncept För varje hemvistland ska indikatorn identifiera instrumenten i gruppen "motstridiga" och ange deras procentuella andel antingen som antal eller som monetärt belopp i förhållande till alla instrument för det landet. Täckning Indikatorn ska täcka alla instrument i CSDB.	Mål 3a bedömer den korrekta identifieringen av emittentpopulationen. Om det finns motstridigheter om ett instruments emittent, dvs. instrumenten i gruppen "motstridiga", ska dessa instrument inte överstiga DQM-tröskeln.	Explicita attribut: Emittentkännetecken för gruppindelning.	Utestående belopp i euro avseende instrument i gruppen "motstridiga", uttryckt procentuell andel av alla instrument.

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
Mål 3b: Uppgifternas korrekthet – stöd för riktig sektorallokering och dataextraktion efter emittent	Konceptets bakgrund CSDB kopplar ihop information om emittent och instrument som en relation som kan beskrivas som "en till många", dvs. en emittent kan kopplas till många instrument men varje instrument kan bara kopplas till en emittent. Kopplingen instrument-emittent görs via individuella emittentkännetecken som de olika leverantörerna av ingående uppgifter tillhandahåller. Eftersom det än så länge saknas en gemensam standard använder de olika leverantörerna olika kännetecken, men dessa bör vara konsistenta. Om ingen leverantör tillhandahåller något emittentkännetecken för ett visst instrument uppstår risken att detta instrument inte kan tillordnas en viss emittent och därför hamnar i gruppen "enskilda" som bara består av detta instrument. Gruppen "enskilda" kan klassificeras korrekt efter land och sektor men det saknas en konsistent koppling mellan emittenten och instrumentet. Instrument i gruppen "enskilda" förhindrar en konsistent och tillförlitlig extrahering av alla instrument som emitterats av en viss emittent. Instrument i gruppen "enskilda" ökar risken för felklassificeringar efter land där emittenten har sitt hemvist eller sektor, eftersom de ofta tillhandahålls med ofullständig information. Koncept För varje hemvistland ska indikatorn identifiera instrumenten i gruppen "enskilda" och ange deras procentuella andel antingen som antal eller som monetärt belopp i förhållande till alla instrument för det landet.	Mål 3b bedömer den korrekta identifieringen av emittentpopulationen. Om det saknas tillförlitlig information om ett instruments emittent, dvs. instrumenten i gruppen "enskilda", ska dessa instrument inte överstiga DQM-tröskeln.	Explicita attribut: Emittentkännetecken för gruppindelning.	Utestående belopp i euro avseende instrument i gruppen "enskilda", uttryckt procentuell andel av alla instrument.

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
	Täckning Indikatorn ska täcka alla instrument i CSDB.			
Mål 4: Uppgifternas korrekthet – uppgifter om utestående belopp för skuldinstrument inkl. certifikat	Koncept Indikatorn ska aggregera utestående belopp för skuldinstrument inkl. certifikat efter land där en emittent har sitt hemvist och emittentsektor enligt konceptet för emissionsstatistik (SEC). Aggregatet ska jämföras med resp. SEC-tal och den procentuella avvikelser för CSDB-datan ska beräknas. Ej verifierade och ej förklarade skillnader ska ej överstiga DQM-tröskeln.	Mål 4 jämför de utgående uppgifterna i CSDB med extern benchmarkdata. Ej verifierade och ej förklarade skillnader mellan aggregerade uppgifter i CSDB och respektive information från ECB SEC eller andra tillförlitliga benchmarks ska, förutsatt att sådan benchmarkdata finns tillgänglig, inte överstiga DQM-tröskeln för samma referensdatum för var och en av nedanstående emittentsektorer enl. ENS: — S.11 "icke-finansiella företag" (S.11 enligt ENS 95) — S.121 "centralbanker" (S.121 enligt ENS 95) — S.122 "monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken" (S.122 enligt ENS 95) — S.123 "penningsmarknadsfonder" (S.122 enligt ENS 95) — S.124 "investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder" (S.123 enligt ENS 95) — S.125 "övriga finansinstitut, utom försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.123 enligt ENS 95). — S.126 "finansiella serviceföretag" (S.124 enligt ENS 95) — S.127 "koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag" (S.123 enligt ENS 95) — S.128 "försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.129 "pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.13 "offentlig sektor" (S.13 enligt ENS 95)	Explicita attribut: Utestående belopp i euro, marknadskapitalisering i euro Implicita attribut: emissionsdag, förfallodag, valuta, emittentens ENS-sektor, hemvistland.	Utestående belopp eller marknadskapitalisering i euro, uttryckt som procentuell skillnad mellan CSDB och extern benchmark.

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
Mål 5: Uppgifternas korrekthet – marknadskapitalisering aktier	Koncept Indikatorn ska aggregera marknadskapitalisering för aktier efter land där en emittent har sitt hemvist och emittentsektor enligt konceptet för emissionsstatistik. Aggregatet ska jämföras med resp. SEC-tal och den procentuella avvikelserna för CSDB-datan ska beräknas. Ej verifierade och ej förklarade skillnader ska ej överstiga DQM-tröskeln.	Mål 5 jämför de utgående uppgifterna i CSDB med extern benchmarkdata. Ej verifierade och ej förklarade skillnader mellan aggregerade information i CSDB och respektive information från ECB SEC eller andra tillförlitliga benchmarks ska, förutsatt att benchmarkdata finns tillgänglig, inte överstiga DQM-tröskeln för samma referensdatum för var och en av nedanstående emittentsektorer enl. ENS: — S.11 "icke-finansiella företag" (S.11 enligt ENS 95) — S.121 "centralbanker" (S.121 enligt ENS 95) — S.122 "monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken" (S.122 enligt ENS 95) — S.123 "penningsmarknadsfonder" (S.122 enligt ENS 95) — S.124 "investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder" (S.123 enligt ENS 95) — S.125 "övriga finansinstitut, utom försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.123 enligt ENS 95) — S.126 "finansiella serviceföretag" (S.124 enligt ENS 95) — S.127 "koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag" (S.123 enligt ENS 95) — S.128 "försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.129 "pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.13 "offentlig sektor" (S.13 enligt ENS 95)	Explicita attribut: utestående belopp i euro, antal utelöpande aktier för det angivna aktieslaget. Implicita attribut: nominell valuta, emittentens ENS-sektor, hemvistland, aktiernas pris (endast extremvärden kontrolleras).	Utestående belopp eller marknadskapitalisering i euro, uttryckt som procentuell skillnad mellan CSDB och extern benchmark.

DQM-mål	DQM-indikator	Genomförande	Produktionsdata attribut	Bas för DQM-tröskeln
Mål 6: Uppgifternas korrekthet – emittentklassificering	Koncept Indikatorn ska rangordna emittenter för varje kombination av hemvistland/sektor enligt deras sammanlagda värdepappersbaserade skulder (aktier och skulder). Indikatorn ska också visa en absolut rangordning mellan olika emittenter för att underlätta upptäckten av signifikanta extremvärden för utestående belopp eller marknadskapitalisering. Emittentens hemvistland och emittentsektor ska verifieras upp till DQM-tröskeln. Täckning Indikatorn ska omfatta alla andelar i investeringsfonder, aktier och skuldinstrument vars förfallodag inte är äldre än tre månader.	Mål 6 bedömer den statistiska klassificeringen av emittenter. Den statistiska klassificeringen av emittenter upp till DQM-tröskeln ska verifieras för var och en av nedanstående emittentsektorer enl. ENS: — S.11 "icke-finansiella företag" (S.11 enligt ENS 95) — S.121 "centralbanker" (S.121 enligt ENS 95) — S.122 "monetära finansinstitut som tar emot inlåning, utom centralbanken" (S.122 enligt ENS 95) — S.123 "penningsmarknadsfonder" (S.122 enligt ENS 95) — S.124 "investeringsfonder, utom penningmarknadsfonder" (S.123 enligt ENS 95) — S.125 "övriga finansinstitut, utom försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.123 enligt ENS 95). — S.126 "finansiella serviceföretag" (S.124 enligt ENS 95) — S.127 "koncerninterna finansinstitut och utlåningsföretag" (S.123 enligt ENS 95) — S.128 "försäkringsföretag och pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.129 "pensionsinstitut" (S.125 enligt ENS 95) — S.13 "offentlig sektor" (S.13 enligt ENS 95)	Emittentsektor enl. ENS, hemvistland.	Utestående belopp eller marknadskapitalisering i euro, uttryckt som "kapitalisering", dvs. utestående belopp plus marknadskapitalisering per emittent.

(¹) Numreringen av kategorierna är baserad på den numrering som framgår av förslaget till Europaparlamentets och rådets förordning om det europeiska national- och regionalräkenskapssystemet i Europeiska unionen, COM(2010) 774 final.

BILAGA II

ATTRIBUT FÖR PRODUKTION OCH PRODUKTIONSDATA SOM OMFATTAS AV KVALITETSSÄKRINGSARBETET

Kvalitetssäkringsarbetet ska omfatta följande produktion som stöder olika användningsområden:

- Produktion som stöder extern statistik (EXT 1.0)
- Produktion av statistik om finansiella företag (FVC 1.0)
- Produktion av statistik om investeringsfonder (IF 1.0)
- Produktion av statistik om värdepappersinnehav (SHS 1.0)
- Produktion av statistik om den offentliga sektorns värdepappersfinansiering (GSF 1.0)

Attribut för produktionsdata avseende produktionen:

Output feed data attribute name (Produktionsdatans attributsnamn)	Beskrivning	Tillämplig produktion				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
International Security Identification Number (ISIN) code (ISIN-kod)	ISIN-koden för värdepapperet.	√	√	√	√	√
Instrument European System of Accounts (ESA) class (Instrumentets klassificering enl. ENS)	Värdepapperets klassificering enl. ENS.	√	√	√	√	√
Debt type (Typ av skuld)	Typ av skuldinstrument.				√	√
Is In securities issues statistics (SEC)	Ett attribut som kan användas för att identifiera värdepapper som bör inkluderas i "aktuella utestående belopp", i linje med definitionerna i ECB SEC.					√
Instrument supplementary class (Instrumentets tilläggsklassificering)	Tilläggsattribut som gör det möjligt att ange huruvida ett instrument bör inkluderas i SEC eller inte. Attributet kan ha värden som 1 = "utan kupong", 2 = "utan kapitalbelopp" etc.					√
Security status (Värdepappersstatus)	Tilläggsattribut som gör det möjligt att ange huruvida ett instrument bör inkluderas i SEC eller inte. Attributet kan ange huruvida ett värdepapper är aktivt eller inte.					√
Asset securitisation type (Typ av säkerhet)	Typ av tillgång som används som säkerhet.		√		√	
Is In the Eligible Assets Database	Attribut som anger huruvida ett instrument godtas som säkerhet för Eurosystemets kreditoperationer.				√	
Nominal currency (Nominell valuta)	Instrumentets nominella valuta (Internationella standardiseringsorganisationen (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Output feed data attribute name (Produktionsdatans attributsnamn)	Beskrivning	Tillämplig produktion				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Issue Date (Utgivningsdag)	Den dag då emittenten levererar värdepapperena till underwritern mot betalning. Detta är dagen då värdepapperena för första gången kan levereras till investerarna. Obs.: För avskilda kuponger anger denna kolumn den dag då kupongen/kapitalbeloppet avskiljs.	√	√	√	√	√
Maturity date (Förfallodag)	Den dag då skuldinstrumentet löses in.	√	√	√	√	√
Residual maturity (Återstående löptid)	Ett instruments återstående löptid den dag då uppgiften förs in.					√
Issuer domicile country (Land där emittenten har sitt hemvist)	Land där värdepapperets emittent har sitt säte (hemvist) (ISO 3166).	√	√	√	√	√
Issuer ESA sector (Emittentens ENS-sektor)	Emittentens institutionella sektor enligt ENS.	√	√	√	√	√
Issuer European Classification of Economic Activities (Nace) classification (Emittentens klassificering enl. Europeiska gemenskapernas statistiska näringsgrensin- delning (Nace))	Huvudsaklig ekonomisk verksamhet enl. Nace.	√				
Amount issued (Emitterat belopp)	Det belopp som influtit vid emissionen av skuldinstrumentet (nominellt värde). För avskilda kuponger anger denna kolumn det belopp till vilket kupongen/kapitalbeloppet avskiljs. För värdepapper som emitteras i trancher, under en ISIN-kod, anger denna kolumn det samlade beloppet som hittills emitterats. Det emitterade beloppet anges i nominell valuta.					√
Amount outstanding (Utestående belopp)	För utestående belopp anges nominellt värde. För värdepapper som emitteras i trancher, under samma ISIN-kod, anger denna kolumn det samlade beloppet som hittills emitterats, efter avdrag för inlösen. Värden anges i nominell valuta. Det utestående beloppet anges i nominell valuta. Om nominell valuta saknas anges det utestående beloppet i euro.	√			√	√
Amount outstanding in euro (Utestående belopp i euro)	Utestående belopp omräknas till euro med hjälp av växelkursen till den nominella valutan den dag då uppgiften förs in.				√	√
Market capitalisation (Marknadskapitalisering)	Senast tillgängliga marknadskapitalisering. Marknadskapitaliseringen anges i nominell valuta. Om nominell valuta saknas anges marknadskapitaliseringen i euro.				√	

Output feed data attribute name (Produktionsdatans attributsnamn)	Beskrivning	Tillämplig produktion				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Yield to maturity (Avkastning till förfallodagen)	Värdepapperets avkastning till förfalldagen anges i procent.				√	√
Short name (Kort namn)	Kort namn som emittenten valt, definierat utifrån emissionens särdrag och annan tillgänglig information.					√
Pool factor (Poolfaktor)	För värdepapper med bakomliggande tillgångar i form av fastighetslån är poolfaktorn eller faktorn för det återstående kapitalbeloppet det utestående kapitalbeloppet i den underliggande poolen av fastighetslån delat med det ursprungliga kapitalbeloppet.	√	√	√	√	√
Quotation basis (Prisangivelse)	Prisangivelsen för ett instrument, dvs. procent av nominellt belopp (procent) eller valuta per aktie/andel (andelar).	√	√	√	√	√
Price value (Pris)	Senast tillgängliga pris för instrumentet på referensdagen baserat på prisangivelse och, i förekommande fall, nominell valuta. För räntebärande värdepapper anges ett s.k. rent pris, dvs. exklusive upplupen ränta.	√	√	√	√	√
Price value type (Typ av pris)	Typ av pris, dvs. huruvida det utgör marknadspris, uppskattat pris eller defaultvärde.	√	√	√	√	√
Monthly average price (Genomsnittligt månadspris)	Genomsnittligt normaliserat pris för instrumentet tillgängligt under de 30 kalenderdagarna före referensdagen baserat på prisangivelse och, i förekommande fall, nominell valuta.	√			√	
Redemption type (Typ av inlösen)	Typ av inlösen (t.ex. bullet, perpetual, structured, annuity, serial, irregular, null, stepped).					√
Redemption frequency (Inlösenfrekvens)	Antal inlösen per år för ett skuldinstrument.					√
Redemption price (Inlösenpris)	Slutligt inlösenpris.					√
Accrued interest (Upplupen ränta)	Upplupen ränta sedan sista kupongbetalningen eller tidpunkt då räntan började löpa. När detta värde adderas till priset för räntebärande värdepapper erhålls ett s.k. smutsigt pris.	√	√	√		√
Accrued income factor (Faktor för upplupen inkomst)	En värdepappersspecifik inkomstfaktor i procent som beräknas dagligen. Faktorn är beräknad på upplupen inkomst, dvs. speglar den kombinerade effekten av upplupen ränta och upplupen inkomst utifrån skillnaden mellan emissions- och inlösenpriset.	√	√	√	√	

Output feed data attribute name (Produktionsdatans attributsnamn)	Beskrivning	Tillämplig produktion				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
Coupon type (Typ av kupong)	Typ av kupong, t.ex. fast, rörlig etc.				√	√
Last coupon rate (Senaste kupongränta)	Senaste kupongränta i procent per år som faktiskt utbetalats (på årsbasis).	√	√	√	√	
Last coupon date (Senaste kupongdag)	Dag då den senaste kupongräntan faktiskt betalades. Attributet gör det möjligt att bestämma huruvida den senaste kupongräntan hör till rapporteringsperioden eller ej.	√	√	√	√	
Last coupon frequency (Senaste kupongfrekvens)	Frekvens per år då den senaste kupongräntan betalats ut: "årsvis" blir AN, "halvårsvis" blir SA etc.	√	√	√	√	
Dividend amount (Avkastningens belopp)	Beloppet på den senaste avkastningen som betalats per aktie (i typ av avkastningsbelopp) före skatt (bruttoavkastning).	√		√	√	
Dividend amount type (Typ av avkastningsbelopp)	Avkastningsbelopp per aktie kan anges i avkastningsvalutan eller i antal aktier.	√		√	√	
Dividend currency (Avkastningsvaluta)	ISO 4217 kod för den valuta i vilken den senaste avkastningen betalades.	√		√	√	
Dividend Settlement date (Avkastningens avvecklingsdag)	Avvecklingsdag för den senaste utbetalningen av avkastning. Attributet gör det möjligt att bestämma huruvida den erlagda avkastningen hör till rapporteringsperioden eller ej.	√		√	√	
Last split factor (Senaste splitfaktor)	Aktiesplittar och omvända splittar av aktier.	√		√	√	
Last split date (Senaste splitdag)	Dag då aktiesplit träder i kraft.	√		√	√	