

SUUNISED

EUROOPA KESKPANGA SUUNIS (EL) 2022/971,

19. mai 2022,

väärtpaberite keskandmebaasi ja väärtpaberiemissioonide statistika tegemise ning suuniste EKP/2012/21 ja (EL) 2021/834 kehtetuks tunnistamise kohta (EKP/2022/25)

EUROOPA KESKPANGA NÕUKOGU,

võttes arvesse Euroopa Liidu toimimise lepingut,

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

võttes arvesse nõukogu määrust (EÜ) nr 2533/98, 23. november 1998, statistilise teabe kogumise kohta Euroopa Keskpanga poolt ⁽¹⁾, eelkõige selle artiklit 4,

võttes arvesse Euroopa Keskpanga üldnõukogu soovitusi,

ning arvestades järgmist:

- (1) Väärtpaberite keskandmebaas (CSDB) on ühtne infotehnoloogia infrastruktuur, mida kasutavad ühiselt Euroopa Keskpangade Süsteemi (EKPS) liikmed, sealhulgas keskpangad liikmesriikides, mille rahaühik ei ole euro, (edaspidi „euroalavälised RKPd“) kui need euroalavälised RKPd osalevad vabatahtlikult CSDB tegevuses. CSDBs salvestatakse kirjepõhised andmed (*item-by-item data*), eelkõige väärtpaberite, nende emitentide ja reitingute kohta. CSDB tegevuse peamised protsessid on sisendandmete esitamine, nende töötlemine, andmekvaliteedihaldus (DQM) ning kirjepõhistest andmetest ja koondteabest koosnevate väljundandmete koostamine ja levitamine. Nende tegevuste mitmete muudatuste tõttu on vaja vastu võtta uus suunis, et tagada selge ja kindel CSDB juhtimiskord. Õiguskindluse huvides tuleks tunnistada kehtetuks Euroopa Keskpanga suunised EKP/2012/21 ⁽²⁾ ja (EL) 2021/834 (EKP/2021/15) ⁽³⁾, mis on seni reguleerinud CSDB andmekvaliteedihalduse raamistikku ja väärtpaberiemissioonide statistilise teabe esitamist.
- (2) Selleks et tõhustada euroala ja liidu rahapoliitika ja finantsstabiilsuse analüüsi, aidata kaasa teise statistika tegemisele, täita euroala aruandluskohustusi seoses võlakirjaemissioonide statistikaga G20 andmelünkade algatuse raames ning hinnata euro rolli rahvusvahelistel finantsturgudel, koostatakse CSDB kirjepõhiste andmete alusel väärtpaberiemissioonide kuustatistika, mis hõlmab väärtpaberiemissioonide seisuga ja voo agregaatide (edaspidi „CSEC koondstatistika“). Seega tuleks CSDBs koostada CSEC koondstatistika ning keskpangad liikmesriikides, mille rahaühik on euro, (edaspidi „RKPd“) ja Euroopa Keskpang (EKP) peaksid vastutama CSEC koondstatistika kontrollimise ja aluseks olevate CSDB kirjepõhiste andmete DQMi eest.

⁽¹⁾ EÜT L 318, 27.11.1998, lk 8.

⁽²⁾ Euroopa Keskpanga suunis EKP/2012/21, 26. september 2012, väärtpaberite keskandmebaasi andmekvaliteedihalduse raamistiku kohta (ELT L 307, 7.11.2012, lk 89).

⁽³⁾ Euroopa Keskpanga suunis (EL) 2021/834, 26. märts 2021, väärtpaberiemissioonide statistilise teabe aruandluse kohta (EKP/2021/15) (ELT L 208, 11.6.2021, lk 311).

- (3) CSDB jaoks sisendandmete esitamine hõlmab andmete kogumist eri allikatest ja nende edastamist EKP-le CSDB kaudu. Andmete kogumine EKP poolt on vajalik EKPSi ülesannete, eelkõige rahapoliitika ja finantssüsteemi stabiilsusega seotud ülesannete täitmiseks. Nende allikate hulka kuuluvad RKPd ja euroalavälised RKPd, EKP-sisesed allikad, teatavad äriandmete esitajad, haldusallikad ja avalik sektor.
- (4) Eri allikatest väärtpaberite kaupa kogutud andmete ühendamiseks ja topeltkirjete vältimiseks tuleks kõik CSDB-le edastatud väärtpaberid identifitseerida kordumatult rahvusvahelise väärtpaberite identifitseerimisnumbriga (ISIN-kood). Selleks et tagada RKPde esitatud sisendandmete õige rühmitamine ja CSDB andmete täpne ühendamine muu EKPSi statistilise teabega, tuleks RKPde poolt emitendi kohta esitatavate sisendandmete osana esitada vähemalt üks ühendav üksuse tunnuse, mis on kantud asutuste ja filiaalide andmebaasi registrisse (RIAD). Selleks et hõlbustada emitendi eri allikatest pärit võrdlusandmete õiget rühmitamist ja täpset ühendamist muu EKPSi statistilise teabega, tuleks esitada juriidilise isiku tunnus (LEI), kui see on kättesaadav.
- (5) CSDB kirjepõhiste andmete üldist kvaliteeti saab hinnata ainult väljundandmete põhjal, mitte üksikute sisendandmete kogumite põhjal. Selleks, et tagada väljundandmete täielikkus, täpsus ja kooskõla, tuleb määratleda DQM raamistik, mida kohaldatakse väljundi alusandmete (*output feed data*) suhtes, mis on väljundandmete alamrühm, mida võib kasutada statistika tegemiseks või muudel eesmärkidel.
- (6) CSDB DQM raamistikku tuleb kohaldada väljundi alusandmete suhtes olenemata sisendandmete allikatest. Selles tuleks sätestada RKPde ja EKP kohustused seoses CSDB väljundandmete kvaliteediga. Selleks et tagada väljundi alusandmete ja CSEC koondstatistika kõrge kvaliteet ning võimaldada EKP-l õigeaegselt esitada väljundi alusandmete läbilõikeid ja CSEC koondstatistikat, peaksid RKPd ja EKP kontrollima väljundi alusandmeid ja CSEC koondstatistikat kindlaksmääratud kuupäevaks.
- (7) Selleks et tagada CSDB kirjepõhiste andmete ja ajaloolise CSEC koondstatistika kvaliteet ning toetada RKPde riiklike väärtpaberite kirjepõhiste andmebaaside ja CSDB ühtlustamist, peaksid oma sisendandmeid parandanud RKPd esitama CSDB-le parandatud sisendandmefailid või kasutama andmete parandamiseks CSDB süsteemi.
- (8) Kuna CSDBd käitavad EKPS liikmed ühiselt, peaksid nad järgima samu DQM standardeid. Kui RKP soovib läbi viia DQMi, mis mõjutab teiste riikide residentidega seotud CSDB andmeid, peaks ta kooskõlastama oma tegevuse RKPde ja euroalaväliste RKPdega ning vajaduse korral EKPga, et selgelt kindlaks määrata sellise DQMi piirid. Lisaks saavad euroalavälises liikmesriikides resideerivate emitentide DQMi parimal viisil teostada vastavate liikmesriikide RKPd. EKP suunised ei pane küll kohustusi euroalavälistele RKPdele, kuid Euroopa Keskpangade Süsteemi ja Euroopa Keskpanga põhikirja artiklit 5 kohaldatakse nii euroala kui ka euroalaväliste RKPde suhtes. See tähendab euroalaväliste RKPde kohustust töötada välja ja rakendada kõiki meetmeid, mida nad peavad asjakohaseks CSDB väljundandmete DQMi teostamiseks ja CSEC koondstatistika koostamiseks kooskõlas käesoleva suunisega. Lisaks sellele võib euro kasutuselevõttu kavandavate euroalaväliste liikmesriikide keskpankadelt nõuda euro kasutuselevõttule eelnevat kindlaksmääratud ajavahemikku hõlmava statistilise teabe EKP-le esitamist, mis võimaldab EKP-l kujundada tervikliku kogutud statistilise teabe ülevaate ja teostada vajalikke analüüse.
- (9) Selleks et tõsta väljundandmete kvaliteeti, tuleks teostada andmeallikate haldust (*data source management*, DSM) eesmärgiga tuvastada ja parandada korduvaid ja/või struktuurseid vigu sisendandmetes. DHSi peaks teostama EKP kommertskanalilt saadud sisendandmete suhtes ja RKP nende endi sisendandmete suhtes.
- (10) CSDB andmete alusel statistiliste koondandmete avaldamiseks RKPde poolt tuleks kehtestada ühised reeglid, mis tagavad seonduvate põhiagregaatide nõuetekohase avaldamise.
- (11) Tuleb kehtestada tõhus kord tehniliste paranduste tegemiseks käesoleva suunise lisadesse, tingimusel et need parandused ei muuda aluseks olevaid raampõhimõtteid ega aruandluse ja DQMi koormust.

ON VÕTNUD VASTU KÄESOLEVA SUUNISE:

Artikkel 1

Mõisted

Käesolevas suunises kasutatakse järgmisi mõisteid:

- 1) „väärtpaberite keskandmebaas“ (*Centralised Securities Database, CSDB*) – Euroopa Keskpankade Süsteemi (EKPS) loodud väärtpaberite keskandmebaas;
- 2) „sisendandmed“ (*input data*) – mis tahes andmed, mis on esitatud CSDB-le ühest või mitmest järgmisest andmeallikast: a) nii keskpangad liikmesriikides, mille rahaühik on euro, (edaspidi „RKPd“) kui ka keskpangad liikmesriikides, mille rahaühik ei ole euro, (edaspidi „euroalavälised RKPd“); b) Euroopa Keskpanga sisesed allikad; c) kommertskanalid; d) haldusallikad; e) avalikud andmed;
- 3) „sisendandmete esitamise ajavahemik“ (*input provision bracket*) – iga kalendrikuu tööpäevade periood, mille määrab kindlaks Euroopa Keskpank (EKP) ja mille jooksul võivad RKPd esitada CSDB-le sisendandmeid;
- 4) „väljundandmed“ (*output data*) – kirjepõhised andmed, mida CSDB automaatselt tuleb sisendandmete liitmisel täielikuks ja kvaliteetseks andmekogumiks;
- 5) „väljundi alusandmed“ (*output feed data*) – kirjepõhised väljundandmete ja käesoleva suunise III lisas loetletud tunnuste alamrühm, mida kasutatakse statistika tegemiseks või muudel eesmärkidel;
- 6) „CSEC koondstatistika“ (*CSEC aggregate statistics*) – väärtpaberiemissioonide koondstatistika, mis hõlmab väärtpaberite emissioonide seisu ja voo agregate, mis on saadud CSDB kirjepõhistest andmetest, nagu on määratletud käesoleva suunise IV lisas;
- 7) „andmekvaliteedihaldus“ (*Data Quality Management, DQM*) – tegevus, millega tagatakse väljundi alusandmete ja CSEC koondstatistika kvaliteet, kontrollimine ja säilitamine, kasutades ja kohaldades DQM sihtväärtusi, DQM mõõdikuid, DQM lävendeid ja DQM töökorraldust;
- 8) „andmeallikate haldus“ (*Data Source Management, DSM*) – sisendandmete korduvate ja/või struktuursete vigade tuvastamine ja parandamine vahetult koos andmeesitajaga;
- 9) „esialgne DQM“ (*initial DQM*) – kirjepõhiste väljundi alusandmete ja CSEC koondstatistika igakuine DQM, mis hõlmab kõige viimase vaatluskuu kuulõpu eelvaadet;
- 10) „korraline DQM“ (*regular DQM*) – kirjepõhiste väljundi alusandmete ja CSEC koondstatistika igakuine DQM, mis hõlmab esialgse DQMiga hõlmatud kuule eelnevaid vaatluskuid, võttes arvesse erinevatest andmeallikatest saadud CSDB-väliseid võrdlusnäitajaid, eesmärgiga tagada, et CSDB väljundandmete kvaliteet vastab CSDB andmevoo nõuetele;
- 11) „DQM sihtväärtus“ (*DQM target*) – käesoleva suunise II lisas määratletud võrdlusnäitaja väljundi alusandmete kvaliteedi hindamiseks;
- 12) „DQM mõõdik“ (*DQM metric*) – statistiline näitaja, mis mõõdab teatava DQM sihtväärtuse saavutamise määra, nagu on määratletud käesoleva suunise II lisas;
- 13) „DQM lävend“ (*DQM threshold*) – sellise kontrolli miinimumtase, mis tuleb teostada DQM raamistiku nõuete täitmiseks DQM sihtväärtuse osas;
- 14) „DQM erand“ (*DQM exception*) – võimalik andmekvaliteedi probleem, mis tehakse kindlaks erireegli alusel ja mille puhul tuleb andmeid kinnitada või parandada, et saavutada vastav DQM lävend;
- 15) „DQM töökorraldus“ (*DQM workflow*) – tehniline protsess, mida kohaldatakse sisendandmete parandamisel DQM lävendi saavutamiseks;
- 16) „kuulõpu eelvaade“ (*end-month preview*) – igapäevane väljundandmete ja DQM mõõdikute ajakohastamine, mille tulemusel esitatakse vastava kuulõpu eelduslikud väljundandmed;
- 17) „esialgne CSEC koondstatistika“ (*initial CSEC aggregate statistics*) – CSEC koondstatistika, mis hõlmab viimast vaatluskuud;
- 18) „korraline CSEC koondstatistika“ (*regular CSEC aggregate statistics*) – CSEC koondstatistika, mis hõlmab esialgse CSEC koondstatistikaga hõlmatud kuule eelnevaid vaatluskuid;

- 19) „CSEC prioriteediseriad“ (*CSEC priority series*) – madalaima taseme CSEC koondstatistika, mille suhtes kohaldatakse DQM nõudeid, nagu on määratletud käesoleva suunise II ja IV lisas;
- 20) „vaatluskuu“ (*reference month*) – kalendrikuu, mida asjaomased andmed või statistika hõlmavad;
- 21) „tööpäev“ (*working day*) – täistööpäev, mis ei ole EKP veebilehel avaldatud EKP ametlik puhkepäev;
- 22) „kontrollimine“ (*verification*) – protsess, mille puhul kontrollitakse CSDB väljundi alusandmeid ja CSEC koondstatistikat ning vajaduse korral parandatakse CSDB sisendandmeid, järgides DQM töökorraldust;
- 23) „resident“ (*resident*) – vastavalt määratlusele Euroopa Parlamendi ja nõukogu määruses (EL) nr 549/2013 ⁽⁴⁾;
- 24) „ISIN-kood“ (*ISIN code*) – rahvusvaheline väärtpaperite identifitseerimisnumber vastavalt määratlusele Rahvusvahelise Standardiorganisatsiooni (ISO) standardis ISO 6166;
- 25) „ühendav üksuse tunnus“ (*linking entity identifier*) – üksuse tunnus, mis sisaldub nii CSDBs kui ka EKPSi asutuste ja filiaalide andmebaasi registris ning mis on kas RIADi kood, muu riiklik üksuse tunnuskood, mida kasutab asjaomane RKP või euroalaväline RKP, juriidilise isiku tunnus (LEI), mis on määratletud standardis ISO 17442, või muu üksuse tunnus, mida EKP ja asjaomane RKP või euroalaväline RKP üldiselt aktsepteerivad.

Artikkel 2

Reguleerimisese ja kohaldamisala

Käesoleva suunisega kehtestatakse väärtpaperiandmete esitamise ja väärtpaperiemiissioonide statistika tegemise raamistik CSDBs. Selle raamistiku eesmärk on tagada CSDB väljundandmete ja CSEC koondstatistika täielikkus, täpsus ja kooskõla, kohaldades järjepidevalt sisendandmete esitamise eeskirju ning selliste andmete DQM-i ja DSM-i.

Artikkel 3

EKP ja RKPde roll

1. EKP, keda abistavad RKPd, määrab kindlaks CSDB tööprotsessid, koostab CSEC koondstatistika ning toodab väljundandmeid, sealhulgas väljundi alusandmeid.
2. Kooskõlas käesoleva suunisega peavad RKPd:
 - a) esitama CSDBsse sisendandmed oma liikmesriigi residentide emiteeritud väärtpaperite kohta, kui sellised andmed on neile hõlpsasti kättesaadavad;
 - b) teostama nende liikmesriikide residentidest emitentidega seotud andmete DQM-i;
 - c) kontrollima oma liikmesriigi residentidest emitentidega seotud CSEC koondstatistikat.
3. EKP peab:
 - a) teostama euroalaväliste emitentide andmete DQM-i, v.a juhul, kui euroalaväline RKP on võtnud endale kohustuse teostada tema liikmesriigi residentidest emitentide andmete DQM-i;
 - b) kontrollima euroalaväliste emitentide CSEC koondstatistikat, v.a juhul, kui euroalaväline RKP on võtnud endale kohustuse kontrollida tema liikmesriigi residentidest emitentide CSEC koondstatistikat.

⁽⁴⁾ Euroopa Parlamendi ja nõukogu määrus (EL) nr 549/2013, 21. mai 2013, Euroopa Liidus kasutatava Euroopa rahvamajanduse ja regionaalse arvepidamise süsteemi kohta, (ELT L 174, 26.6.2013, lk 1).

*Artikkel 4***Sisendandmete esitamine RKPde poolt**

1. Kui RKPdele on hõlpsasti kättesaadavad kirjepõhised andmed oma liikmesriigi residentide emiteeritud väärtpaberite kohta, esitavad nad need andmed korrapäraselt CSDB-le.
2. Kui RKPdele on hõlpsasti kättesaadavad kirjepõhised andmed teiste riikide residentide emiteeritud väärtpaberite kohta, võivad nad need andmed korrapäraselt CSDB-le esitada, leppides selles kokku:
 - a) RKPga, kes vastutab asjaomase emitendiga seotud andmete DQMi eest kooskõlas käesoleva suunise artikliga 3;
 - b) EKP-ga euroalaväliste emitentide andmete osas, v.a juhul, kui euroalaväline RKP on võtnud vastutuse teostada tema liikmesriigi residentidest emitentide andmete DQMi.
3. CSDB-le sisendandmefailide esitades esitavad RKPd vähemalt teabe käesoleva suunise I lisa tabeliga 1 hõlmatud atribuutide kohta.
4. Väärtpaberite kohta CSDB-le edastatud sisendandmetes identifitseeritakse üksikud väärtpaberid nende ISIN-koodidega.
5. Kui RKP on oma sisendandmeid parandanud, esitab ta parandatud sisendandmefailid CSDB-le või kasutab CSDB süsteemi, et parandada oma sisendandmetes vead ja väljajätted, mida ei ole parandatud andmete kontrollimise käigus vastavalt artiklile 5.
6. RKPd määravad igal aastal kindlaks sisendandmete esitamise kuupäevad, mida nad kasutavad CSDB-le sisendandmete esitamiseks vastavalt EKP poolt kindlaks määratud sisendandmete esitamise ajavahemikele.
7. Kooskõlas Euroopa Keskpanga suunise EKP/2018/16 (^(*)) artikliga 26 tagavad RKPd, et residentidest väärtpaberite emitendid registreeritakse EKPSi RIADi andmekogumis. RKPd, kes esitavad CSDB-le sisendandmefailide, lisavad oma sisendandme failidesse vähemalt ühe RIADis sisalduva ühendava üksuse tunnuse.

*Artikkel 5***Andmekvaliteedihaldus**

1. ECB ja RKPd teostavad esialgset DQMi ja korralist DQMi. Seda tehes kontrollivad nad kirjepõhiseid väljundi alusandmeid ja CSEC koondstatistikat, olenemata selliste andmete või statistika allikast.
2. DQMi rakendatakse DQM sihtväärtuste 1, 2, 3a ja 3b ning vastavate DQM mõõdikute suhtes, nagu on täpsemalt sätestatud käesoleva suunise II lisas. Need mõõdikud põhinevad kuu lõpu andmetel, mida EKP ajakohastab iga päev vastavalt kohaldatavatele EKPSi teenusetaseme nõuetele.
3. II lisaga hõlmatud tunnuste osas kohaldavad EKP ja RKPd DQM lävendeid tasemel, mis tagab väljundi alusandmete kvaliteedi, et toetada nende tunnuste kasutamist vastavalt käesoleva suunise III lisale.
4. EKP ja RKPd kontrollivad väljundi alusandmeid selliselt, et DQM sihtväärtuste 1, 3a ja 3b osas on kõigi DQM erandite puhul DQM mõõdikute kohaselt kontrollitud, et need vastavad DQM lävenditele.
5. EKP ja RKPd kontrollivad esialgset ja korralist CSEC koondstatistikat selliselt, et DQM sihtväärtuse 2 DQM erandite puhul on kontrollitud, et need vastavad DQM lävenditele.
6. RKPd parandavad sisendandmeid kooskõlas kokkulepitud DQM töökorraldusega, kasutades CSDB süsteemi või esitades sisendandmete failid EKP-le.

(^(*)) Euroopa Keskpanga suunis (EL) 2018/876, 1. juuni 2018, asutuste ja filiaalide andmete registri kohta (EKP/2018/16) (ELT L 154, 18.6.2018, lk 3).

*Artikkel 6***Esialgne DQM**

1. Esialgset DQM-i teostatakse jooksva tootmistsükli vaatluskuu lõpu eelvaate andmete suhtes.
2. EKP ja RKPd kontrollivad DQM-erandeid, et tagada pärast esialgse DQM-i teostamist kõige hilisemate muutuste võimalikult suures ulatuses kajastamist väljundi alusandmetes ja CSEC koondstatistikas.
3. Esialgse DQM-i teostamisel tuginevad EKP ja RKPd üksnes teabele, mis on neile hõlpsasti kättesaadav.

*Artikkel 7***Korraline DQM**

1. Korralist DQM-i teostatakse esialgse DQM-iga hõlmatud kuule eelnevate vaatluskuude andmete suhtes.
2. Korralise DQM-i teostamisel võtavad EKP ja RKPd arvesse kogu sel ajal kättesaadavat teavet.

*Artikkel 8***Esialgse ja korralise DQM-i ajakava**

1. EKP ja RKPd kontrollivad vastavalt käesoleva suunise II lisa tabelis 2 esitatud koostamise ajakavale:
 - a) kuulõpu eelvaate väljundi alusandmeid, mille suhtes kohaldatakse esialgset DQM-i;
 - b) väljundi alusandmeid, mille suhtes kohaldatakse korralist DQM-i;
 - c) esialgset CSEC koondstatistikat;
 - d) korralist CSEC koondstatistikat.
2. Kui EKP ja RKPd tuvastavad kontrolli käigus andmete kvaliteediga seotud probleeme, korrigeerivad nad need probleemid sama ajakava kohaselt.

*Artikkel 9***Andmeallikate haldus**

1. Kui RKPd tuvastavad kommertskanalitega seotud DSM-probleeme, teatavad nad neist EKP-le, näidates ära probleemide olulisuse nii nende ulatuse osas viitega mõjutatud väärtpaberite bilansilisele väärtusele või turukapitalisatsioonile, kui ka konkreetsete mõjutatud väljundi alusandmete osas.
2. EKP teatab asjaomastele andmeesitajatele kommertskanalitega seotud olulistest DSM-probleemidest ühe kuu jooksul alates kuupäevast, mil vastavast DSM-probleemist EKP-le teatatakse. EKP teeb võimalusel kõik endast oleneva, et olulised DSM-probleemid koostöös asjaomaste andmeesitajatega lahendada.
3. EKP teatab RKPde esitatud sisendandmetega seotud DSM-probleemidest, näidates ära vastavate DSM-probleemide olulisuse nii nende ulatuse osas viitega mõjutatud väärtpaberite bilansilisele väärtusele või turukapitalisatsioonile, kui ka konkreetsete mõjutatud väljundi alusandmete osas. RKPd teevad oma võimaluste piires kõik endast oleneva, et koostöös EKPga lahendada olulised DSM-probleemid oma sisendandmetes.

*Artikkel 10***CSEC koondstatistika koostamine**

1. EKP kehtestab korra tagamaks, et CSEC koondstatistika ühise koostamise protsessis järgitakse käesoleva suunise IV lisas sätestatud koostamiseskirju ja -metoodikat.
2. EKP koostab CSDBs igapäevaselt CSEC kuu koondstatistika, nagu on määratletud käesoleva suunise IV lisas, võttes arvesse kohaldatavaid EKPSi teenusetaseme nõudeid. CSEC koondstatistika koostatakse alates vaatluskuust detsember 2020.

*Artikkel 11***Väljundandmete esitamine**

1. EKP teeb RKPdele kättesaadavaks:
 - a) igakuise läbilõike käesoleva suunise III lisas määratletud igakuistest väljundi alusandmetest;
 - b) igakuise läbilõike CSEC koondstatistika aluseks olevatest kirjepõhistest andmetest ja eelmise vaatluskuu CSEC koondstatistikast;
 - c) parimal võimalikul viisil eelmise vaatluspäeva osas läbilõike igapäevaste väljundi alusandmete kohta vastavalt käesoleva suunise III lisale, mis hõlmab EKPSi statistikakomitees kokku lepitud kõige asjakohasemaid väärtpabereid.
2. EKP teeb RKPdele kättesaadavaks ka kõik parandused:
 - a) läbilõigetes käesoleva suunise III lisas määratletud väljundi alusandmetest;
 - b) läbilõigetes CSEC koondstatistika aluseks olevatest kirjepõhistest andmetest ja CSEC koondstatistikast vähemalt viimase 12 vaatluskuu kohta;
 - c) läbilõigetes CSEC koondstatistika aluseks olevatest kirjepõhistest andmetest ja CSEC koondstatistikast vähemalt viimase 36 vaatluskuu kohta, välja arvatud 2020. aasta detsembrile eelnevad perioodid, igal aastal.
3. Lõigetes 1 ja 2 osutatud andmeid kasutatakse üksnes statistilistel eesmärkidel, sealhulgas statistika tootmiseks ja koostamiseks. Andmete mittestatistilise kasutamise korral järgitakse EKP nõukogu poolt heaks kiidetud konfidentsiaalse statistilise teabe jagamise eeskirju ja korda.
4. Lõigetes 1 ja 2 osutatud andmed tehakse kättesaadavaks kas edastamise teel või muul viisil, mida EKP ja RKPd üldiselt aktsepteerivad.

*Artikkel 12***Avaldamine**

1. RKPd ei avalda CSDB andmete alusel koostatud väärtpaberiemissioonide statistika riikide agregaat ega euroala agregaat enne, kui EKP on avaldanud CSEC koondstatistika. See ei takista RKPsid avaldamast kooskõlas riiklike avaldamis-graafikutega riikide väärtpaberiemissioonide statistika agregaat, mille koostamisel ei tugineta CSDB andmetele.
2. Euroala väärtpaberiemissioonide statistika agregaatide avaldamisel kordavad RKPd täpselt EKP avaldatud agregaat.

*Artikkel 13***Tagasivaatelistel andmetel aruandlusnõuded euro kasutuselevõtu korral**

Kui liikmesriik, mille rahaühik ei ole euro, võtab euro kasutusele pärast käesoleva suunise jõustumist, teeb selle liikmesriigi keskpank kõik endast oleneva, et kontrollida CSEC koondstatistikat selle liikmesriigi kohta vähemalt alates vaatluskuust detsember 2020 või viimase kolme aasta kohta enne euro kasutuselevõttu, olenevalt sellest, kumb kuupäev on hilisem.

*Artikkel 14***Muudatuste tegemise lihtsustatud kord**

Võttes arvesse EKPSi statistikakomitee seisukohti, on EKP juhatusel õigus teha käesoleva suunise lisades tehnilisi muudatusi, kui need muudatused ei muuda suunise aluspõhimõtteid, sealhulgas EKP ja RKPde vahelist vastutuse jaotust, ega mõjuta oluliselt RKPde aruandluskoormust. EKP juhatus teavitab EKP nõukogu põhjendamatu viivitusega igast käesoleva suunise lisade muutmisest.

*Artikkel 15***Kehtetuks tunnistamine**

1. Suunis EKP/2012/21 ja suunis (EL) 2021/834 (EKP/2021/15) tunnistatakse kehtetuks.
2. Viiteid kehtetuks tunnistatud suunisele tuleb käsitleda viidetena käesolevale suunisele ja lähtuda tuleb vastavustabelist V lisas.

*Artikkel 16***Jõustumine ja rakendamine**

1. Käesolev suunis jõustub päeval, mil sellest teatatakse keskpankadele liikmesriikides, mille rahaühik on euro.
2. RKPd liikmesriikides, mille rahaühik on euro, järgivad käesolevat suunist alates 1. juunist 2022.

*Artikkel 17***Adressaadid**

Käesolev suunis on adresseeritud kõikidele eurosüsteemi keskpankadele.

Frankfurt Maini ääres, 19. mai 2022

EKP nõukogu nimel
EKP president
Christine LAGARDE

I LISA

VÄÄRTPABERITE KESKANDMEBAASI (CSDB) SISENDANDMETE TUNNUSED

Kui nende liikmesriikide keskpangad, mille rahaühik on euro, (edaspidi „RKPd“) esitavad CSDB-le võla-, aktsia- või hinnasisendifailidega sisendandmeid, peavad nad esitama vähemalt järgmise teabe:

Tabel 1

Sisendandmete tunnuse nimetus	Kirjeldus	Sisendfailid		
		Võlg	Omandi-väärtpaber	Hinnad
Rahvusvaheline väärtpaberite identifitseerimisnumber (ISIN kood)	Väärtpaberi ISIN kood	✓	✓	✓
Aktiivne lipp	Sisendkirjete töötlemiseks vajalik tehniline lipp	✓	✓	✓
Euroopa arvepidamise süsteemi (ESA 2010) ⁽¹⁾ instrumentide klassifikatsioon	Väärtpaberi liigitus ESA 2010 süsteemis.	✓	✓	
Esmane vara liigitus 2	Instrumenti esmane liigitus, nt märke selle kohta, kas instrument on võla-, omakapitali- või fondiinstrument koos mõne täiendava üksikasjaga	✓	✓	
Nimivaluuta	Instrumenti nimivaluuta (ISO 4217)	✓	✓	
Emissiooni noteeringu väärtus	Instrumenti hinna esitamise viis, näiteks protsendina nimiväärtusest või aktsia/ühiku valuutas.	✓		
Väärtpaberi staatus	Instrumenti staatus, märkides, kas see on toimiv või mitte, koos mõne täiendava üksikasjaga	✓	✓	
Väärtpaberi staatuse kuupäev	Sündmuse kuupäev, mil väärtpaberi staatus muutus	✓	✓	
Emitendi allika kood	CSDB sisendandmete allika emitendi kood. RKPde esitatud sisendandmete puhul on tegemist CSDB ning asutuste ja filiaalide andmete registri (RIAD) vahelise ühendava üksuse tunnusega.	✓	✓	
Emitendi allika koodi liik	Emitendi allika koodi liik	✓	✓	
Emitendi asukohariik	Väärtpaberi emitendi asutamise (asukoha) riik (ISO 3166)	✓	✓	
Emitendi nimi	Emitendi täielik nimi	✓	✓	
ESA 2010 emitendi sektor	Emitendi institutsionaalne sektor ESA 2010 kohaselt	✓	✓	
Hinna kuupäev	Hinnateabe kuupäev			✓
Sulgemishind	Väärtpaberi hinna väärtus sulgemisel			✓
Hinnanoteeringu liik	Hinnanoteeringu liik, nt nimiväärtuse protsent või rahaühik aktsia/osa kohta			✓

Sisendandmete tunnuse nimetus	Kirjeldus	Sisendfailid		
		Võlg	Omandi-väärtpaber	Hinnad
Hinna võrdlusturg	Turg, kus hind on noteeritud (ISO 10383)			√
Hinna valuuta	Valuuta, milles hind on noteeritud (asjakohane ainult juhul, kui noteerimisliik on rahaühik)			√
Emitendi LEI kood	Emitendi juriidilise isiku tunnus (LEI) (ISO 17442), kui emitendil on LEI (*)	√	√	

(¹) Kehtestatud määrusega (EL) nr 549/2013.

(*) LEI tuleb esitada, kui see teave on RKP-le kättesaadav.

RKPD, kes esitavad CSDB-le sisendandmeid, peavad tegema kõik endast oleneva, et anda sisendteave järgmiste tunnuste kohta:

Tabel 2

Sisendandmete tunnuse nimetus	Kirjeldus	Sisendfailid		
		Võlg	Omandi-väärtpaber	Hinnad
Jääkväärtus	Jääkväärtuse summa (nimiväärtuses)	√		
Jääkarv	Hetkel käibel olevate aktsiate või fondide aktsiate/osakute koguarv		√	
Emissioonihind	Väärtpaberi emissioonihind, mida maksid investorid	√	√	
Tagasiostuhind	Väärtpaberi lõplik tagasiostuhind	√		
Emissiooni kuupäev	Kuupäev, mil emitent annab väärtpaberid makse vastu korraldajale üle. See on kuupäev, mil väärtpaberid olid esimest korda kättesaadavad investoritele.	√	√	
Lõpptähtpäev	Algne tagasiostupäev, s.t prospektis nimetatud lõpliku lepingulise põhimakse kuupäev	√		
Osaemissiooni summa	Osaemissiooni summa (nimivaluutas)	√		
Osaemissiooni kuupäev	Kuupäev, mil emiteeriti olemasoleva väärtpaberi uus osaemissioon	√		
Osaemissiooni hind	Hind, millega olemasoleva väärtpaberi uut osaemissiooni turul pakuti	√		
Osalise tagasiostu summa	Osalise tagasiostu summa (nimivaluutas)	√		
Osalise tagasiostu kuupäev	Kuupäev, mil olemasolev väärtpaber osaliselt tagasi osteti	√		
Osalise tagasiostu hind	Hind, millega olemasolev väärtpaber osaliselt tagasi osteti	√		
Kapitali suurendamise määr	Määr, mille võrra kapital suurenes (aktsiate arvuna)		√	
Kapitali suurendamise kuupäev	Kuupäev, mil kapitali suurendati		√	

Sisendandmete tunnuse nimetus	Kirjeldus	Sisendfailid		
		Võlg	Omandi-väärtpaber	Hinnad
Kapitali suurendamise hind	Hind, millega uusi aktsiaid turul pakuti		√	
Kapitali vähendamise määr	Määr, mille võrra kapitali vähendati (aktsiate arvuna)		√	
Kapitali vähendamise kuupäev	Kuupäev, mil kapitali vähendati		√	
Kapitali vähendamise hind	Hind, millega olemasolevad aktsiad tagasi osteti ja seejärel tühistati		√	
Vara väärtpaperistamise liik	Väärtpaperistatud vara liik	√		
Instrumendi järk	Näitab, kas instrumendil on garant, milline on selle nõudeõiguse järk/järgekoht ning kas see on tagatud.	√		
Kupongiga seotud tunnused	Teave kupongimaksete kohta, sealhulgas kupongi liik, kupongi sagedus, kupongi tähtajad, kupongimäärad ja intressi kogunemise alguskuupäev	√		
Spliti näitaja	Aktsiate spliti näitaja aktsiasplittide (ja pöördsplittide) puhul, määratletud kui (aktsiate arv enne spliti)/ (aktsiate arv pärast spliti)		√	
Aktsiaspliti kuupäev	Kuupäev, mil split toimus		√	
Dividendi summa	Viimase dividendimakse summa (valuutaühikutes)		√	
Dividendi summa liik	Dividendide väljamaksmise liik (nt rahaline või mitterahaline)		√	
Dividendi valuuta	Viimase dividendimakse valuuta (ISO 4217)		√	
Dividendimakse arvelduskuupäev	Viimase dividendimakse kuupäev		√	
Dividendide maksmise sagedus	Dividendimaksete sagedus		√	
Tulu summa	Fondiinvestoritele omistatav tulu, sealhulgas dividendid ja jaotamata kasum (ESA 2010 mõiste) – asjakohane ainult fondi aktsiate/osakute puhul		√	
Tulu valuuta	Fondiinvestoritele omistatava tulu valuuta (ISO 4217) – asjakohane ainult fondi aktsiate/osakute puhul		√	
Tulu kuupäev	Kuupäev, millele tulu summa on seotud, st kuu lõpp või kvartali lõpp – asjakohane ainult fondi aktsiate/osakute puhul		√	
Fondi varade struktuur	Fondi (enamuse) alusvarade liik		√	
Fondi geograafiline struktuur	Fondi (enamuse) alusvarade geograafiline jaotus		√	

Sisendandmete tunnuse nimetus	Kirjeldus	Sisendfailid		
		Võlg	Omandi-väärtpaber	Hinnad
Fondiliik	Fondi liik, st liigitus avatud või suletud fondiks ja dividendipoliitika (jaotamine või mittejaotamine)		√	
Instrumendi täiendav teave	Teave selle kohta, kas väärtpaber on nt stripitud, kas see on hoidmistunnistus, ostutäht või on asjakohane CSDB kirjepõhiste andmete alusel tehtava väärtpaberiemissioonide statistika (edaspidi „CSEC koondstatistika“) jaoks	√	√	

ANDEMEKVALITEEDIHALDUSE (DQM) SIHTVÄÄRTUSED, ERANDITE RAKENDAMINE, TUNNUSED, DQM LÄVENDI ALUS JA AJAKAVA

Väärtpaberite keskandmebaasi (CSDB) DQM raamistik põhineb esiteks DQM sihtväärtustel, mis kujutavad endast väljundi alusandmete kvaliteedi hindamise võrdlusalusaid, ja teiseks DQM mõõdikutel, mis mõõdavad teatava DQM sihtväärtuse saavutamise taset ning määravad nii iga DQM sihtväärtuse puhul kindlaks ja prioriseerivad väljundi alusandmed, mida tuleb kontrollida. Samuti põhineb see DQM lävenditel, millega määratakse kindlaks DQM sihtväärtusega seotud kontrolli miinimumtase, ning DQM eranditel, mis tuvastatakse erireegli abil ja millega kaasnevad (võimalikud) andmekvaliteedi probleemid, mida tuleb kontrollida või parandada, et saavutada vastav DQM lävend.

DQM sihtväärtused, DQM mõõdikud, DQM erandite rakendamine, tunnused ja DQM lävendi alus on esitatud järgmises tabelis. CSDBs avaldatakse iga DQM sihtmärgi kohta DQM erandite loetelu, mida tuleb DQM lävendi saavutamiseks kontrollida. EKP ja keskpangad liikmesriikides, mille rahühik on euro, (edaspidi „RKPD“) kontrollivad käesolevas lisas määratletud DQM erandeid, mille suhtes rakendatakse CSDBs DQM erandite eeskirju.

Tabel 1

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	DQM erandite rakendamine	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
Sihtväärtus 1: Andmete stabiilsus – seisude andmed	<i>Mõiste:</i> See mõõdik määratletakse iga residentsuse riigi/sektori kombinatsiooni kohta mahuna, mis kaalutakse indeksi muutusega; kaalutakse rahalises summas. 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. Kui indeks langeb alla 1, tuvastatakse konkreetsed väärtpaberid, mille muutunud tunnus põhjustas indeksi languse, eesmärgiga kontrollida seda muutust, kuni saavutatakse lävend.	Sihtväärtus 1 hindab seisude andmete stabiilsust. Mis tahes kuupõhine erinevus, mis käivitab indeksi muutuse, käivitab sihtväärtusega 1 hõlmatud väljundi alusandmete tunnuste DQM erandi. Kontrollimata DQM erandid ei või vähendada stabiilsete andmete osakaalu alla DQM lävendi järgmiste Euroopa arvepidamissüsteemi (ESA 2010) ⁽²⁾ sektorite osas: — S.11 „mittefinantsettevõtted“ — S.121 „keskpank“ — S.122 „hoiuseid kaasavad ettevõtted, v.a. keskpank“	Otsesed tunnused: emissiooni kuupäev, võla lõpptähtaeg, nimivaluuta, noteeringu alus, ESA 2010 instrumendi klassifikaator, esmane varaklassifikaator 2, CSDB emitendi asukohariik, ⁽¹⁾ ESA 2010 emitendi sektor, emitendi Euroopa majanduse tegevusalade statistiline klassifikaatori (NACE) liigitus, üksuse staatus, jääkväärtus, jääkarv, väärtpaberi staatus, kupongiga seotud tunnused, tekkepõhise tulu näitaja, hind, hinna liik, kuu keskmine hind, emissioonihind, tagasiostuhind, instrumendi lisateave, viimane spliti näitaja, viimane spliti kuupäev.	Jääkväärtused või turukapitalisatsioon eurodes, mida väljendatakse osakaaluna seisudest.

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	DQM erandite rakendamine	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
	<i>Sündmused, mis tingivad indeksi muutuse:</i> Eeldatavalt muutumatute tunnuste osas tekitab indeksimuutuse mis tahes kuudevaheline erinevus. Muutuda võivate tunnuste osas tekitab indeksimuutuse kuudevaheline erinevus, mis on suurem kui kindlaksmääratud lävend. <i>Hõlmatus:</i> See DQM mõõdik hõlmab kõiki investeerimisfondide osakuid, omandi- ja võlaväärtpabereid, sh sertifikaate.	— S.123 „rahaturufondid“ — S.124 „investeerimisfondid, mis ei ole rahaturufondid“ — S.125 „muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide“ — S.126 „finantsvahenduse abiettevõtted“ — S.127 „varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad“ — S.128 „kindlustusseltsid“ — S.129 „pensionifondid“ — S.13 „valitsemissektor“		
Sihtväärtus 2: Andmete täpsus – CSEC koondstatistika	<i>Kontseptuaalne taust:</i> CSEC koondstatistika kuu lõpu seisude ja kuuvoogude kohta koostatakse CSDB väljundandmetest iga päev vastavalt käesoleva suunise IV lisas sätestatule. Kuna CSEC koondstatistika koosneb paljudest erinevatest agregaatidest, sealhulgas kõrgema taseme ja kattuvatest agregaatidest, tuleb CSEC koondstatistika kontrollimisel keskenduda „CSEC prioriteediseeriade“ kogumitele, st madalaima taseme CSEC koondstatistikale, mille suhtes kohaldatakse DQM nõudeid, nagu on täpsustatud käesoleva suunise IV lisas. Prioriteediseeriade kogumite kontrollimisega tagatakse, et kontrollitakse ka kõiki kõrgema taseme	Sihtväärtus 2 hindab CSEC koondstatistika andmete kvaliteeti. Kõik CSEC võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate prioriteediseeriad käivitavad sihtväärtuse 2 DQM erandi. Kontrollimata DQM-i erandid ei tohi ületada võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate DQM lävendit.	Kaudsed tunnused: emissiooni kuupäev, võla lõpptähtaeg, nimivaluuta, noteeringu alus, ESA 2010 instrumendi klassifikaator, esmane varaklassifikaator 2, emitendi asukohariik (³), ESA 2010 emitendi sektor, üksuse staatus, jääkväärtus, jääkarv, osaemissiooni summa, osaemissiooni kuupäev, osaemissiooni hind, väärtpaberi staatus, kupongiga seotud tunnused, hind, emissioonihind, tagasiostuhind, instrumendi lisateave.	CSEC prioriteediseeriade turuväärtuses väljendatud seisud, väljendatuna osakaaluna vastava riigi kogumajanduse agregaatidest turuväärtuses (arvutatakse eraldi võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate agregaatide kohta).

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	DQM erandite rakendamine	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
	agregaate, mis põhinevad nendel seeriatel ja olulisel määral ka nendega seotud kattuvaid agregate. <i>Mõiste:</i> Iga riigi puhul peab see mõõdik määrama kindlaks „CSEC prioriteediseeriad“ ja seostama need jääkväärtuse või turukapitalisatsiooni protsendina kogumajanduse turuväärtuses seisude agregaatidega selles riigis. Peab olema võimalik saada CSEC koondstatistika aluseks olevaid disagregeeritud andmeid konkreetsete väärtpaberite tasemel. CSEC prioriteediseeriade kogumeid tuleb kontrollida ja kinnitada kuni lävendi saavutamiseni. <i>Hõlmatus:</i> Mõõdik hõlmab võlaväärtpabereid ja noteeritud aktsiaid, mis kuuluvad CSEC koondstatistikasse.			
Sihtväärtus 3a: Andmete täpsus – toetab emitendi sektori õiget määratlust ja andmete tuletamist emitentide kaupa	<i>Kontseptuaalne taust:</i> CSDB ühendab emitendi ja instrumendi teabe suhte baasil, mida võib kirjeldada kui „üks mitmega“, s.t üks emitent võib olla seotud mitme instrumendiga, kuid iga instrument saab olla seotud vaid ühe emitendiga. Instrument ja emitent seostatakse konkreetse emitendi	Sihtväärtus 3a hindab emitentide kogumi õiget identifitseerimist. Ebakõla instrumendi emitendi suhtes, st instrument on vastuoludega kogumis, toob kaasa sihtväärtuse 3a DQM erandi.	Otsesed tunnused: emitendi identifitseerimisandmed, mida kasutatakse kogumitesse jaotamiseks.	Vastuoludega kogumi instrumentide jääkväärtused ja turukapitalisatsioon eurodes, mida väljendatakse protsentuaalse osakaaluna kõikidest instrumentidest.

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	DQM erandite rakendamine	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
	identifitseerimisandmete alusel, mille annavad erinevad sisendandmete esitajad. Identifitseerimisandmed erinevatelt andmeesitajatelt ei lange kokku, kuna siiani puudub ühtne standard, kuid need peaksid olema kooskõlas. Kui sisendandmete esitajad esitavad sama instrumendi osas ebakõlalisi (vastuolulisi) emitendi identifitseerimisandmeid, s.t nad ei lange emitendi osas kokku, ei saa instrumenti määrata konkreetsele emitendile ja ta suunatakse „vastuoludega kogumisse“. Vastuoludega kogumit saab sellegipoolest liigitada riigi ja sektori järgi, kuigi puudub kooskõlaline seos instrumenti emitendiga. Vastuoludega kogumi instrumendid takistavad konkreetse emitendi poolt emiteeritud instrumentide andmete kooskõlalist ja usaldusväärset tuletamist. Vastuoludega kogumi instrumendid suurendavad valesi liigitamise riski residentsuse või sektori lõikes. <i>Mõiste:</i> Iga residentsuse riigi kohta määrab mõõdik vastuoludega kogumis olevad instrumendid ja suhestab need koguse või summa põhjal protsentuaalse osakaaluna kõigi selle riigi instrumentidega.	Kui tegemist on DQM erandiga, ei tohi selle erandiga hõlmatud instrumendid ületada DQM lävendit.		

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	DQM erandite rakendamine	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
	<i>Hõlmatus:</i> Mõõdik hõlmab kõiki CSDBs olevaid instrumente.			
Sihtväärtus 3b: Andmete täpsus – toetab emitendi sektori õiget määratlust ja andmete tuletamist emitentide kaupa	<i>Kontseptuaalne taust:</i> CSDB ühendab emitendi ja instrumendi teabe suhte baasil, mida võib kirjeldada kui „üks mitmega“, s.t üks emitent võib olla seotud mitme instrumendiga, kuid iga instrument saab olla seotud vaid ühe emitendiga. Instrument ja emitent seostatakse konkreetse emitendi identifitseerimisandmete alusel, mille annavad erinevad sisendandmete esitajad. Identifitseerimisandmed erinevatelt andmeesitajatelt ei lange kokku, kuna siiani puudub ühtne standard, kuid need peaksid olema kooskõlas. Kui konkreetse instrumendi osas ei esita ükski andmeesitaja emitendi identifitseerimisandmeid, 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. Autonoomsete kogumite instrumendid takistavad konkreetse emitendi poolt emiteeritud instrumentide andmete kooskõlalist ja usaldusväärset tuletamist.	Sihtväärtus 3b hindab emitentide kogumi õiget identifitseerimist. Usaldusväärse teabe puudumine instrumendi emitendi kohta, st instrument on autonoomses kogumis, toob kaasa sihtväärtuse 3b DQM erandi. Kui tegemist on DQM erandiga, ei tohi selle erandiga hõlmatud instrumendid ületada DQM lävendit.	Otsesed tunnused: emitendi identifitseerimisandmed, mida kasutatakse kogumitesse jaotamiseks.	Autonoomse kogumi instrumentide jääkväärtused ja turukapitalisatsioon eurodes, mida väljendatakse protsentuaalse osakaaluna kõikidest instrumentidest.

DQM sihtväärtus	DQM mõõdikud	DQM erandite rakendamine	Väljundi alusandmete tunnused	DQM lävendi alus
	Instrumentid autonoomsetes kogumites suurendavad valesti liigitamise riski residentsuse või sektori lõikes, kuna nende kohta esitatakse mittetäielik teave. <i>Mõiste:</i> Iga residentsuse riigi kohta määrab mõõdik autonoomses kogumis olevad instrumentid ja suhestab need koguse või summa põhjal protsentuaalse osakaaluna kõigi selle riigi instrumentidega. <i>Hõlmatus:</i> Mõõdik hõlmab kõiki CSDBs olevaid instrumente.			

⁽¹⁾ Emitendi tunnuste sisendandmed edastatakse CSDB-le korrapäraselt asutuste ja filiaalide andmebaasi (RIAD) andmekogumist kooskõlas käesoleva suunise artikliga 4.

⁽²⁾ Kehtestatud määrusega (EL) nr 549/2013.

⁽³⁾ RIADi andmekogumist edastatakse emitendi tunnuste sisendandmed regulaarselt CSDB-le. RIADi sisendandmed on seotud CSDB andmetega vastavalt käesoleva suunise artikli 4 lõikele 7.

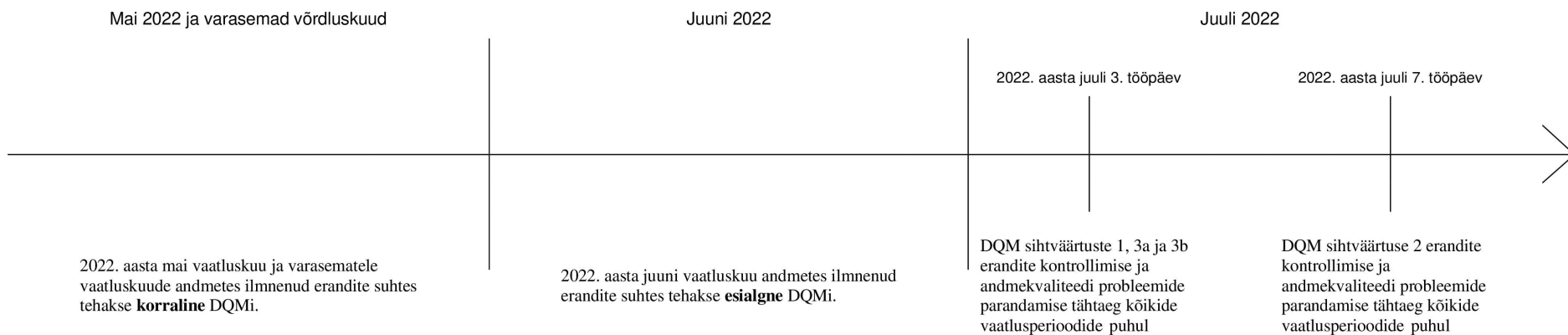
EKP ja RKPd peavad käesoleva suunise artikli 8 kohaste ülesannete täitmisel DQM erandite kontrollimisel ja andmekvaliteedi probleemide parandamisel DQM sihtväärtuste 1, 2, 3a ja 3b puhul järgima järgmist ajakava:

Tabel 2

DQM-i liik	Vaatluskood, mille suhtes kohaldatakse DQM-i	DQM-i hõlmatud andmete liik	DQM sihtväärtused, mille puhul tuleb kontrollida erandeid ja parandada andmekvaliteediga seotud probleemid	Tähtaeg, mil kõik DQM erandid peavad olema lävendite saavutamiseks kontrollitud
Esialgne DQM	Jooksva tootmistsükli võrdluskood	Kuulõpu eelvaate väljundi alusandmeid	DQM sihtväärtused 1, 3a ja 3b	Esialgse DQM-i hõlmatud vaatluskoodi järgneva kolmanda tööpäeva lõpp
		Esialgse CSEC koondstatistika	DQM sihtväärtus 2	Esialgse DQM-i hõlmatud vaatluskoodi järgneva seitsmenda tööpäeva lõpp
Korraline DQM	Kõik varasemad võrdluskoodid	Väljundi alusandmed	DQM sihtväärtused 1, 3a ja 3b	Esialgse DQM-i hõlmatud vaatluskoodi järgneva kolmanda tööpäeva lõpp
		Korraline CSEC koondstatistika	DQM sihtväärtus 2	Esialgse DQM-i hõlmatud vaatluskoodi järgneva seitsmenda tööpäeva lõpp

DQM sihtväärtuste 1, 2, 3a ja 3b puhul on esitatud konkreetne näide DQM erandite kontrollimise ja andmekvaliteedi probleemide parandamise ajakava kohta järgmises diagrammis. Näide illustreerib 2022. aasta juuni vaatluskoodi tootmistsükli. Sellisel juhul peavad EKP ja RKPd tegema 2022. aasta juuni vaatluskoodi DQM sihtväärtuste 1, 3a ja 3b DQM erandite osas **esialgse** DQM-i 2022. aasta juuli 3. tööpäevaks ning DQM-i sihtväärtuse 2 DQM erandite osas 2022. aasta juuli 7. tööpäevaks. Samamoodi peavad EKP ja RKPd tegema 2022. aasta mai vaatluskoodi ja varasemate vaatluskoodide DQM sihtväärtuste 1, 3a ja 3b DQM erandite osas **korralise** DQM-i 2022. aasta juuli 3. tööpäevaks ning DQM-i sihtväärtuse 2 DQM erandite osas 2022. aasta juuli 7. tööpäevaks.

Näide DQM erandite kontrollimise ajakava kohta 2022. aasta juuni vaatluskuu puhul.



[illegible]

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
Euroopa arvepidamise süsteemi (ESA 2010) instrumentide klassifikatsioon	Väärtpaberi klassifikatsioon ESA 2010 kohaselt.	√	√	√	√	√	√	√	√			√
Võlakohustuse liik	Võlainstrumenti liik.					√	√			√		
Esmane vara liigitus 2	Instrumenti esmane liigitus (nt märke selle kohta, kas instrument on võla-, omakapitali- või fondiinstrument koos mõne täiendava üksikasjaga).	√								√	√	√
Väärtpaber sisaldub CSDB-põhises väärtpaberiemissioonide statistikas (edaspidi „CSEC“).	Tunnus, mida saab kasutada väärtpaberite tuvastamiseks, mis on hõlmatud hetkeseisudes kooskõlas CSEC koondstatistika kohaldamisalale.	√					√			√		
Instrumenti täiendav teave	Täiendav tunnus, mis näitab, kas instrument peaks olema CSECga hõlmatud või mitte.	√					√	√	√	√		
Väärtpaberi staatus	Instrumenti staatus. Tunnus näitab, kas instrument on toimiv või mitte.	√					√	√	√	√		
Väärtpaberi staatuse kuupäev	Tunnus, mis näitab kuupäeva, mil väärtpaberi tunnus muutus toimivast mittetoimivaks (või vastupidi).	√						√	√	√		

[illegible]

[illegible]

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
	kindlustusseltside ja pensionifondide (ICPF) loend)											
Emitendi asukohariik	Väärtpaberi emitendi asutamise (asukoha) riik (ISO 3166)	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√
ESA 2010 emitendi sektor	Emitendi institutsionaalne sektor ESA 2010 kohaselt.	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√
Emitendi Euroopa majanduse tegevusalade klassifikaatori (NACE) klassifikaator	Peategevusala NACE kohaselt.		√					√	√	√		√
Üksuse staatus	Instrumendi emitendi üksuse staatus. Tunnus näitab, kas emitent toimib või mitte.	√										
Üksuse staatuse kuupäev	Tunnus, mis näitab kuupäeva, mil väärtpaberi tunnus muutus toimivast mittetoimivaks (või vastupidi).	√										
Emitendi juriidilise isiku tunnus (LEI)	Instrumendi LEI kood (ISO 17442)									√	√	√
Emitendi MFI kood	Emitendi rahaloomeasutuse kood.									√		√
Emiteeritud summa	Summa, mis saadi võlainstrumendi emiteerimisel (nimiväärtuses).						√			√		

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
	Stripi osas näitab see veerg väärtust, milles kupong põhisummast eraldati. Sama ISIN koodiga, kuid osadena emiteeritud väärtpaberite puhul näitab see veerg emissiooni kogusummat. Emiteeritud summa on väljendatud nimivaluutas.											
Jääkväärtus	Jääkväärtus (nimiväärtuses) Sama ISIN koodiga, kuid osadena emiteeritud väärtpaberite puhul näitab see veerg emissiooni kogusummat miinus tagasiostud. Väärtused näidatakse nimivaluutas. Jääkväärtused näidatakse nimivaluutas. Kui nimivaluuta puudub, näidatakse jääkväärtus eurodes.	√	√			√	√	√	√	√		√
Jääkväärtus eurodes	Jääkväärtus konverteerituna eurodesse, kasutades väljundandmete tootmise päeval kehtivat euro vahetuskurssi nimivaluuta suhtes.	√				√	√	√	√			√

[illegible]

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
Hinna esitamise viis	Instrumenti hinna esitamise viis, näiteks protsendina nimiväärtusest (protsent) või aktsia/ühiku(te) valuutas.	√	√	√	√	√	√	√	√	√		√
Hinna kuupäev	Kuupäev, millele osutab lahtris „Hind“ esitatud hinnateave.	√								√		√
Hind	Instrumenti viimane kättesaadav esinduslik hind vaatluskuupäeval vastavalt instrumenti hinna esitamise viisile, võimaluse korral nimivaluutas. Intressi tootvate väärtpaperite puhul esitatakse puhashind, s.t kogunenud intress jäetakse välja.	√	√	√	√	√	√	√	√	√		√
Hinna liik	Hinna olemus, s.t kas see näitab turuhinda, on prognoos või vaikeväärtus.		√	√	√	√	√	√	√	√		√
Kuu keskmine hind	Instrumenti normaliseeritud hindade viimase 30 kalendripäeva keskmine kuni vaatluskuupäevani vastavalt instrumenti hinna esitamise viisile, võimaluse korral nimivaluutas.	√	√			√				√		

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
Emissioonihind	Väärtpaberi emissioonihind, mida maksid investorid	√										
Tagasiostu liik	Tagasiostu liik, näiteks täismakse, tähtajatu, struktureeritud, aasta-, seeria-, ebaregulaarne või astmeline makse.						√			√		
Tagasiostu sagedus	Tagasiostude arv aastas võlainstrumenti kohta						√			√		
Tagasiostu valuuta	Põhisumma makse valuuta (ISO 4217).	√								√		
Tagasiostuhind	Väärtpaberi lõplik tagasiostuhind.	√					√			√		
Intressi kogunemise alguskuupäev	Kuupäev, mil intressi maksvatelt võlainstrumentidelt hakkab kogunema intress.	√								√		√
Kogunenud intress	Viimasest kupongimaksest või kogunemise algusest kogunenud intress. Intressi kandvate väärtpaberite osas saadakse selle väärtuse lisamisel hinnale nn musthind (<i>dirty price</i>).	√	√	√	√		√	√	√	√		√
Tekkepõhise tulu näitaja	Konkreetsed väärtpaberi tootluse näitaja päeva kohta protsentides, mis arvutatakse võlgniku meetodil. Näitaja on tekkepõhine, s.t tulemus ühendab nii	√	√	√	√	√		√	√	√		√

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
	kogunenud intressi kui ka tekkepõhise tulu tulenevalt erinevusest emissiooni- ja tagasiostuhinnas.											
Kogunenud tulu (kreeditor)	Konkreetsed väärtpaberi tootlus päeva kohta protsentides, mis arvutatakse võlausaldaja meetodil.									√		
Kupongi liik	Kupongi liik, näiteks fikseeritud, ujuva või astmelise intressimääraga jne.	√				√	√	√	√	√		√
Viimane kupongi intressimäär	Viimane tegelikult makstud kupongi intressimäär protsentides aasta kohta (aastapõhine).	√	√	√	√	√		√	√	√		
Viimase kupongimakse kuupäev	Viimase tegelikult makstud kupongi intressimäära kuupäev. Tunnus võimaldab tuvastada, kas viimane tegelikult makstud kupongi intressimäär langeb aruandlusperioodi või mitte.	√	√	√	√	√		√	√	√		
Viimase kupongimakse sagedus	Kupongi viimase intressimäära makse sagedus aasta kohta.	√	√	√	√	√		√	√	√		
Kupongi valuuta	Kupongi valuuta (ISO 4217).	√						√	√	√		
Dividendi summa	Viimane dividendi suurus aktsia kohta (dividendi summa liigi alusel) enne maksustamist (brutodividend).		√		√	√		√	√			√

Väljundi alusandmete tunnuste nimetus	Kirjeldus	Andmevoo kasutus										
		CSEC	EXT	FVC	IF	SHS	GSF	IC	PF	CM	MM	SFT
Dividendi summa liik	Dividendi suurus aktsia kohta võib olla esitatud dividendina valuutas või aktsiate arvus.		√		√	√		√	√			
Dividendi valuuta	Viimase dividendimakse valuuta (ISO 4217).		√		√	√		√	√			√
Dividendimakse arvelduskuupäev	Viimase dividendimakse arvelduskuupäev. Tunnus võimaldab tuvastada, kas dividendimakse langeb aruandlusperioodi või mitte.		√		√	√		√	√			√
Viimase spliti näitaja	Aktsia spliti ja pöördspliti spliti näitaja, mis arvutatakse järgmiselt: (aktsiate arv enne spliti) / (aktsiate arv pärast spliti).	√	√		√	√		√	√			
Viimase spliti kuupäev	Kuupäev, mil aktsia split jõustub.	√	√		√	√		√	√			
Fondi varade struktuuri liik	Fondi (enamiku) alusvara liik.							√	√			

IV LISA

CSEC KOONDSTATISTIKA

Sissejuhatus

Väärtpaberite keskandmebaasil (CSDB) põhinevas väärtpaperiemissioonide statistikas (edaspidi „CSEC“) esitatakse liikmesriikide, mille rahaühik on euro, (edaspidi „euroala liikmesriigid“) ja nende liikmesriikide, mille rahaühik ei ole euro, (edaspidi „euroalavälised liikmesriigid“) residentide väärtpaperiemissioonide seisude ja voogude koondandmed kõigis valuutades ning välismaailma residentide kaupa eurodes, jaotatuna emitendi sektori, instrumendi liigi, intressimäära liigi, tähtaja ja valuuta kaupa.

Euroala liikmesriikide keskpankade (edaspidi „RKPd“) kohustuseks on kontrollida nende riikide residentidest emitentidega seotud CSEC koondstatistikat. EKP kohustuseks on kontrollida euroalaväliste emitentidega seotud CSEC koondstatistikat, välja arvatud juhul, kui euroalavälise liikmesriigi RKP (edaspidi „euroalaväline RKP“), on võtnud endale kohustuse kontrollida oma liikmesriigi residentidest emitentidega seotud CSEC koondstatistikat.

CSEC koondstatistika koostamise metoodika järgib võimalikult täpselt rahvusvahelisi standardeid, mis on määratletud Rahvusvaheliste Arvelduste Panga, Euroopa Keskpanga (EKP) ja Rahvusvahelise Valuutafondi väärtpaperistatistika käsiraamatus ⁽¹⁾ ning ESA 2010s ⁽²⁾. Erandjuhud, mille puhul metoodika erineb nendest statistikastandarditest, on eraldi esile tõstetud. Üksikasjalikud CSEC arvutuseeskirjad määratakse kindlaks EKPSi statistikakomitees kokku lepitavas ja EKP veebilehel avaldatavas koostamisjuhendis.

1. Hõlmatus ja liigitused

1.1 Emitendi residentsus: CSEC koondstatistika hõlmab euroala ja euroalaväliste liikmesriikide residentide emissioone kõigis valuutades ning muu maailma residentide emissioone eurodes. Euroala ja/või euroalaväliste liikmesriikide residentide emissioonid on jaotatud emitendi riigi ja muude kriteeriumide alusel. Lisaks hõlmavad euroala ja liidu tasandi koondnäitajad ka euroala ja liidu kui terviku residendiks loetavate riigiüleste asutuste emissioone.

1.2 Sektorid: CSEC koondstatistika hõlmab emissioone järgmistes emitentide sektorites:

- S1: kogumajandus (kõik sektorid kokku)
- S11: mittefinantsettevõtted
- S12: finantsettevõtted
- S121: keskpangad
- S122: hoiuseid kaasavad ettevõtted, v.a. keskpank
- S12M: muud finantsinstitutsioonid, v.a hoiuseid kaasavad ettevõtted
- S12P: muud finantsinstitutsioonid, v.a hoiuseid kaasavad ettevõtted, kindlustusseltsid ja pensionifondid
- S124: investeerimisfondid, v.a rahaturufondid
- S125: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide
- S125A: väärtpaperistamistingutusse kaasatud finantsvahendusettevõtted,
- S125W: muud finantsvahendusettevõtted peale kindlustusseltside ja pensionifondide (välja arvatud väärtpaperistamise tingutustes osalevad finantsvahendusettevõtted)
- S126: finantsvahenduse abiettevõtted
- S127: varasid hoidvad finantsasutused ja laenuandjad
- S12Q: kindlustusseltsid ja pensionifondid

⁽¹⁾ Avaldatud Rahvusvahelise Valuutafondi veebilehel www.imf.org.

⁽²⁾ Kehtestatud määrusega (EL) nr 549/2013.

- S13: valitsemissektor
- S1311: keskvalitsus (v.a riiklikud sotsiaalkindlustusfondid)
- S13M: osariigi/liidumaa ja kohalik omavalitsus (v.a riiklikud sotsiaalkindlustusfondid)
- S1314: riiklikud sotsiaalkindlustusfondid
- S1M: kodumajapidamised ja neid teenindavad kasumitaotluseta institutsioonid

1.3 Instrumendi liik: CSEC koondstatistika hõlmab võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate emissioone ⁽³⁾. Siia ei kuulu noteerimata aktsiate, muude omandiväärtpaberite, rahaturufondide emiteeritud aktsiate/osakute ning muude investeerimisfondide peale rahaturufondide emiteeritud aktsiate/osakute emissioonid.

Võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate emissioonid hõlmavad ainult väärtpabereid, mis on identifitseeritud rahvusvahelise väärtpaberite identifitseerimisnumbriga (ISIN kood). Siia ei kuulu mittekaubeldavate instrumentide emissioonid, sealhulgas laenud, väärtpaberitehingud tagasiostulepingute raames ja valitsuse investeeringud juriidiliselt aktsiakapitaliga äriühingutena moodustatud rahvusvaheliste organisatsioonide kapitali.

1.4 Intressimäära liik: CSEC koondstatistika hõlmab igat liiki võlaväärtpaberite emissioone järgmiste jaotustega:

- Fikseeritud kupong: võlaväärtpaberid, mille puhul lepingujärgsed nominaalsed kupongimaksed on emiteerimise kuupäeval kindlaks määratud võlaväärtpaberi kehtivusaja nimivaluutas ja põhiosa tagasimaksed on kindlaks määratud nimivaluutas ja ajas. See hõlmab ka tõusva ja langeva intressimääraga võlaväärtpabereid, mille puhul emiteerimise kuupäeval määratakse eelnevalt kindlaks erinevad kupongid kogu väärtpaberi eluea jooksul.
- Nullkupong: ühekordse maksega võlaväärtpaberid ilma kupongimakseteta, mida tavaliselt müüakse allahindlusega.
- Inflatsiooniga seotud muutuv intressimäär: võlaväärtpaberid, mille kupongi- või põhiosamaksed on seotud hinnaindeksitega.
- Intressimääraga seotud muutuv intressimäär: võlaväärtpaberid, mille kupongi- või põhiosamaksed on seotud intressimäära võrdlusaluste või võlakirjade tootlusega.
- Vara hinnaga seotud muutuv intressimäär: võlaväärtpaberid, mille kupongi- või põhiosamaksed on seotud mis tahes muu finantsvara, kauba või indeksiga, mis erineb hinnaindeksitest või intressimäära võrdlusalustest. See hõlmab võlaväärtpabereid, mis on seotud väärtpaberikorvide, valuutade, ärisündmuste (nt emitendi makseviivitused) ja muud liiki varade või sündmustega.

Võlaväärtpaberid, mis sisaldavad muutuvat kupongi koos fikseeritud kupongiga, liigitatakse vastavasse muutuva intressimäära kategooriasse.

1.5 Tähtaeg: CSEC koondstatistika hõlmab kõikide tähtaegadega võlaväärtpaberite emissioone. Võlaväärtpaberite emissioonide tähtaegade jaotuses liigitatakse võlaväärtpaberid algse tähtaja ja teataval määral järelejäanud tähtaja järgi.

1.6 Nimivaluuta: CSEC koondstatistika hõlmab euroala residentide emissioone eurodes ja „muudes vääringutes“, euroalaväliste liikmesriikide residentide emissioone eurodes, „muus riigi vääringus kui euro“ ja „muudes vääringutes“ ning muu maailma residentide emissioone eurodes. Alljärgnevas tabelis on esitatud kokkuvõtte vääringute jaotusest.

Nimivaluuta	Euroala residentide emissioonid	Euroalaväliste liikmesriikide residentide emissioonid	Muu maailma residentide emissioonid
Eurodes	✓	✓	✓
Muus riigi vääringus, v.a euro	ei kohaldu	✓	
Muudes vääringutes	✓	✓	

⁽³⁾ ESA 2010 kategooriad F.3 ja F.511.

2. Seisu ja voo mõisted

CSEC koondstatistika annab teavet seisude (st jääkväärtused) ja voogude (st brutoemissioonid, tagasiostud, ümberhindlused ja muud mahumuutused, sealhulgas ümberliigitused) kohta. Järgmine võrrand illustreerib seisude ja voogude vahelist seost:

$$\text{Seisud (t)} = \text{seisud (t-1)} + \text{emissioonide kogumaht (t)} - \text{tagasiostud (t)} + \text{ümberhindlused (t)} + \text{muud mahumuutused (t)}$$

2.1 Seisud: CSEC koondstatistika seisude kohta hõlmab võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate vaatlusperioodi lõpu positsioone.

2.2 Brutoemissioonid: CSEC koondstatistika brutoemissioonide kohta hõlmab uusi võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate emissioone vaatlusperioodil. Emissioonid osutavad olukorrale, kus emitent müüb omanikele uusi võlaväärtpabereid või noteeritud aktsiaid. Väärtpaber loetakse emitteerituks, kui emitent annab selle üle omanikule, tavaliselt sularaha või ülekantava hoiuse eest, või kui see on tegelikult emitteeritud, kuid algne emitent on selle endale jättnud ⁽⁴⁾. Lisaks sisaldavad brutoemissioonid võlakirjade nimiväärtuse ja turuväärtuse agregaatide puhul ka kogunenud intressi. Brutoemissioone ei kajastata, kui tegemist on lihtsalt äriühingu noteerimisega börsil, ilma et uut kapitali kaasataks ⁽⁵⁾. Selliste väärtpaberite emissioonid, mida saab hiljem muudeks instrumentideks konverteerida, tuleb kajastada algse instrumendi liigi emissioonidenä; konverteerimise korral kajastatakse need, nagu oleks need selles instrumentide liigis lõpetatud ning identne summa loetakse uut liiki instrumentide brutoemissioonideks.

2.3 Tagasiostud: CSEC koondstatistika tagasiostude kohta hõlmab võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate tühistamist vaatlusperioodil. Tagasiostud hõlmavad võlaväärtpabereid, mis on jõudnud lõpptähtajani või mis on ennetähtaegselt tagasi ostetud, samuti börsil noteeritud aktsiaid, mis on ametlikult tühistatud. Lisaks hõlmavad tagasiostud võlakirjade nimiväärtuse ja turuväärtuse agregaatide puhul ka kogunenud intressi. Tagasioste ei kajastata, kui tegemist on lihtsalt noteerimise lõpetamisega börsil ⁽⁶⁾.

2.4 Ümberhindlused: CSEC koondstatistika ümberhindluste kohta hõlmab võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate ümberhindlusi vaatlusperioodil. Ümberhindlused võivad tuleneda hindade ja vahetuskursside arengust turul.

2.5 Muud mahumuutused: CSEC koondstatistika muude mahumuutuste kohta hõlmab võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate muid mahumuutusi, mis on tingitud väärtpaberite koguse või füüsiliste omaduste muutumisest või muutustest väärtpaberite klassifitseerimises. Muutused klassifitseerimises hõlmavad emitendi institutsionaalse sektori, emitendi asukohariigi, institutsionaalsete üksuste struktuuri ja varade klassifitseerimise muutusi. Muud mahumuutused tuletatakse seisude-voogude võrrandi järgina.

Üksikasjalikud seisude ja voogude arvutuseeskirjad määratakse kindlaks EKPSi statistikakomitees kokku lepivas ja EKP veebilehel avaldatavas koostamisjuhendis.

3. Konkreetsete instrumendikategooriate statistiline käsitlemine

CSEC koondstatistika koostamisel tuleks konkreetsete instrumendikategooriate suhtes kohaldada järgmist käsitlust:

Hoidmistunnistused: Topeltarvestuse vältimiseks tuleb hoidmistunnistuste emissioonid CSEC koondstatistikast välja jätta.

⁽⁴⁾ Väärtpaberid loetakse tegelikult emitteerituks (isegi kui neid ei ole enne teisele üksusele müüdud), kui: i) need kajastatakse emitendi raamatupidamisbilansis; või ii) emitent kasutab või võib neid kasutada turuoperatsioonides.

⁽⁵⁾ Seevastu ESA 2010 (5.150) võimaldab teoreetiliselt selliste tehingute kajastamist, kuna selles on märgitud: „Noteerimist kajastatakse noteeritud aktsiate emitteerimisena ja noteerimata aktsiate tagasiostmisena [...] kui see on asjakohane.“

⁽⁶⁾ Seevastu ESA 2010 (5.150) võimaldab teoreetiliselt selliste tehingute kajastamist, kuna selles on märgitud: „[...] noteerimise lõpetamist kajastatakse noteeritud aktsiate tagasiostmisena ja noteerimata aktsiate emissioonina, kui see on asjakohane.“

Mitme ISIN koodiga emissioonid: Topeltarvestuse vältimiseks tuleb emissioone, mis on identifitseeritavad mitme ISIN koodiga (nt kuna emissiooni erinevad osad emiteeritakse erinevate regulatiivsete eeskirjade alusel või hoiustatakse eri depositeerimiskohades), kajastada CSEC koondstatistikas ainult sel määral, mil vastavad jääkväärtused ei ole juba hõlmatud mõne muu ISIN-koodiga.

Stripitud võlaväärtpaberid: Topeltarvestuse vältimiseks tuleb stripitud võlaväärtpaberite emissioonid lisada CSEC koondstatistikasse ainult sel määral, mil vastavad jääkväärtused ei ole juba hõlmatud vastava algse võlaväärtpaberiga.

Oma väärtpaberite hoidmine: CSEC koondstatistika tuleb koostada brutopõhiselt ja see hõlmab oma väärtpaberite hoidmist, sealhulgas i) turul müüdud ja emitendi poolt tagasi ostetud väärtpabereid ning ii) väärtpabereid, mille emitent on tegelikult emiteerinud, kuid endale jätanud (?).

4. Hindamine

Võlaväärtpaberite ja noteeritud aktsiate osas koostatakse CSEC koondstatistika turuväärtuses. Ainult võlaväärtpaberite osas koostatakse CSEC koondstatistika ka nimiväärtuses ja võlaväärtpaberite seisude osas nimiväärtuses. Järgmises tabelis on kokkuvõtlikult esitatud CSEC koondstatistika koostamiseks kasutatud hindamismeetodid.

Instrumendi liik	Seisud ja vood turuväärtuses	Seisud ja vood nimiväärtuses	Seisud nimiväärtuses
Võlaväärtpaberid	✓	✓	✓
Noteeritud aktsiad	✓	ei kohaldu	ei kohaldu

5. Ülevaade jaotustest

Iga üksiku euroala liikmesriigi ja euroala kui terviku emissioonide osas mõõdetakse CSEC koondstatistikat eurodes ja see koostatakse vastavalt järgmistes tabelites määratletud jaotustele. Tabelites kasutatud sektorikoodide tähendused on määratletud 1. jaos „Hõlmatus ja liigitused“.

(?) Vt 4. joonealune märkus.

Tabel A1

Võlaväärtpaperite hierarhia 1 – Peamised tähtaja ja intressimäära liigi jaotused euroala liikmesriigi ja euroala kui terviku kohta

Sektor																						
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																						
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M	
Kõik valuutad	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid																				
	Algselt pikaajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud kupong																				
		Nullkupong																				
		Muutuv intressimäär																				
Euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*	
	Algselt pikaajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud kupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Nullkupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Muutuv intressimäär		L		L	L			L		L	L	L	L	L	L		L	L	L	L
Muud vääringud	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*	
	Algselt pikaajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud kupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Nullkupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Muutuv intressimäär		L		L	L			L		L	L	L	L	L	L		L	L	L	L

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa üksikute euroala liikmesriikide tasemel enam jaotada. Lahtrid märkega „L**“ on madalaima taseme agregaadid, mida kasutatakse nende CSEC prioriteediseeriade identifitseerimiseks, mille suhtes kohaldatakse käesolevas lisas CSEC koondstatistika andmekvaliteedihaldust (DQM). Kõik muud tabeli lahterid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Tabel A2

Võlaväärtpaberite hierarhia 2 – Üksikasjalikud intressimäära liigi jaotused euroala liikmesriigi ja euroala kui terviku kohta

Sektor																						
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																						
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M	
Kõik valuutad	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud intressimäär																				
		Fikseeritud kupong																				
		Nullkupong																				
		Muutuv intressimäär																				
		Inflatsiooniga seotud muutuv intressimäär																				
		Intressimääraga seotud muutuv intressimäär																				
		Vara hinnaga seotud muutuv intressimäär																				
Euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud intressimäär																				
		Fikseeritud kupong		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L	
		Nullkupong		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L	
		Muutuv intressimäär																				
		Inflatsiooniga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Intressimääraga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Vara hinnaga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
Muud vääringud	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud intressimäär																				
		Fikseeritud kupong		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L	
		Nullkupong		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L	
		Muutuv intressimäär																				
		Inflatsiooniga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Intressimääraga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Vara hinnaga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märgeda „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa üksikute euroala liikmesriikide tasemel enam jaotada. Lahtrid märgeda „L*“ on madalaima taseme agregaadid, mida kasutatakse nende CSEC prioriteediseeriate identifitseerimiseks, mille suhtes kohaldatakse käesolevas lisas CSEC koondstatistika DQMI. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide aggregeerimise teel.

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa üksikute euroala liikmesriikide tasemel enam jaotada. Lahtrid märkega „L*“ on madalaima taseme agregaadid, mida kasutatakse nende CSEC prioriteediseeriade identifitseerimiseks, mille suhtes kohaldatakse käesolevas lisas CSEC koondstatistika DQMi. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Tabel A3

Võlaväärtpaberite hierarhia 3 – Üksikasjalikud algse tähtaja jaotused euroala liikmesriigi ja euroala kui terviku kohta

Sektor																					
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																					
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Kõik valuutad	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid																			
	Algne tähtaeg >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid																			
	Algne tähtaeg >2 aasta ja ≤5 aastat	Kõik intressimäära liigid																			
	Algne tähtaeg >5 aasta ja ≤10 aastat	Kõik intressimäära liigid																			
	Algne tähtaeg >10 aastat	Kõik intressimäära liigid																			
Euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >2 aasta ja ≤5 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >5 aasta ja ≤10 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >10 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Muud vääringud	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >2 aasta ja ≤5 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >5 aasta ja ≤10 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Algne tähtaeg >10 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märgesega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa üksikute euroala liikmesriikide tasemel enam jaotada. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Tabel A4

Võlaväärtpaperite hierarhia 4 – Üksikasjalikud järelejäänud tähtaja jaotused euroala liikmesriigi ja euroala kui terviku kohta

Sektor																					
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																					
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Kõik valuutad	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga ≤1 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >2 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga ≤1 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >2 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Muud vääringud	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga ≤1 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >2 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa üksikute euroala liikmesriikide tasemel enam jaotada. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Tabel A5

Noteeritud aktsiate jaotused euroala liikmesriigi ja euroala kui terviku kohta

Sektor																			
	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Valuuta																			
Kõik valuutad								ei kohaldu		ei kohaldu					ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu
Euro		L*		L*	L*			ei kohaldu		ei kohaldu	L*	L*	L*	L*	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu
Muud väärangud		L*		L*	L*			ei kohaldu		ei kohaldu	L*	L*	L*	L*	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu	ei kohaldu

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turuväärtuses. Lahtrid märgena „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa üksikute euroala liikmesriikide tasemel enam jaotada. Lahtrid märgena „L*“ on madalaima taseme agregaadid, mida kasutatakse nende CSEC prioriteediseeriate identifitseerimiseks, mille suhtes kohaldatakse käesolevas lisas CSEC koondstatistika DQMi. Kõik muud tabeli lahtrid (välja arvatud need, mis on tähistatud märgena „ei kohaldu“, mis tähistavad sektoreid, mis tavaliselt börsil noteeritud aktsiaid ei emiteeri) on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Euroalavälise välismaailma võlaväärtpaberite emissioonide puhul tuleb CSEC koondstatistikat mõõta eurodes ja koostada vastavalt järgmistes tabelites määratletud jaotustele. Tabelites kasutatud sektorikoodide tähendused on määratletud 1. jaos „Hõlmatus ja liigitused“.

Tabel A6

Võlaväärtpaberite hierarhia 1 – Peamised tähtaja ja intressimäära liigi jaotused euroalavälise välismaailma kohta

Sektor																						
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																						
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M	
Euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*	
	Algselt pikaajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud kupong		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Nullkupong		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Muutuv intressimäär		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L	

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa euroalavälise muu maailma tasemel enam jaotada. Lahtrid märkega „L*“ on madalaima taseme agregaadid, mida kasutatakse nende CSEC prioriteediseeriate identifitseerimiseks, mille suhtes kohaldatakse käesolevas lisas CSEC koondstatistika DQMi. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Tabel A7

Võlaväärtpaberite hierarhia 2 – Üksikasjalikud intressimäära liigi jaotused euroalavälise välismaailma kohta

Sektor																						
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																						
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M	
Euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																				
		Fikseeritud intressimäär																				
		Fikseeritud kupong		L		L	L				L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
		Nullkupong		L		L	L				L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
		Muutuv intressimäär																				
		Inflatsiooniga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Intressimääraga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Vara hinnaga seotud muutuv intressimäär		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa euroalavälise muu maailma tasemel enam jaotada. Lahtrid märkega „L*“ on madalaima taseme agregaadid, mida kasutatakse nende CSEC prioriteediseeriade identifitseerimiseks, mille suhtes kohaldatakse käesolevas lisas CSEC koondstatistika DQMi. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.																						

Tabel A8

Võlaväärtpaberite hierarhia 3 – Üksikasjalikud algse tähtaja jaotused euroalavälise välismaailma kohta

Sektor			S1	S11	S12											S13	S1311	S13M	S1314	S1M	
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik						S121	S122	S12M	S12P	S124	S125			S126	S127						S12Q
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik										S125A	S125W								
euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L		L		L	L	L	L	L		L	L	L		
	Algne tähtaeg >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L		L		L	L	L	L	L		L	L	L		
	Algne tähtaeg >2 aasta ja ≤5 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L		L		L	L	L	L	L		L	L	L		
	Algne tähtaeg >5 aasta ja ≤10 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L		L		L	L	L	L	L		L	L	L		
	Algne tähtaeg >10 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L		L		L	L	L	L	L		L	L	L		

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa euroalavälise muu maailma tasemel enam jaotada. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide agregeerimise teel.

Tabel A9

Võlaväärtpaberite hierarhia 4 – Üksikasjalikud järelejäänud tähtaja jaotused euroalavälise välismaailma kohta

Sektor																					
Nimivaluuta, tähtaeg, instrumendi liik																					
Valuuta	Tähtaeg	Instrumendi liik	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
euro	Kõik tähtajad	Kõik intressimäära liigid																			
	Algselt lühiajalise tähtajaga	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga ≤1 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >1 aasta ja ≤2 aastat	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Pikaajaline algne tähtaeg järelejäänud tähtajaga >2 aasta	Kõik intressimäära liigid		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L

Märkused: Tabeli iga lahter tuleb täita seisude, brutoemissioonide, tagasiostude, ümberhindluste ja muude mahumuutuste kohta turu- ja nimiväärtuses, samuti seisude kohta nimiväärtuses. Lahtrid märkega „L“ on madalaima taseme agregaadid, mida ei saa euroalavälise muu maailma tasemel enam jaotada. Kõik muud tabeli lahtrid on kõrgema taseme agregaadid, mis luuakse madalaima taseme agregaatide aaregeerimise teel.

6. CSEC koondstatistika koostamise protsess

CSEC koondstatistika koostatakse keskselt ja automaatselt CSDBs sisalduvate kirjepõhiste andmete alusel. Koostamisprotsessi käigus saadakse tabelites A1–A9 esitatud madalaima taseme agregaadid (lahtrid, mis on tähistatud tähega „L“ või „L*“). Kõik muud tabelites A1–A9 määratletud agregaadid saadakse nende madalaima taseme agregaatide edasise agregeerimise teel.

7. CSEC koondstatistika kontrollimine ja DQM

EKP teeb kõik endast oleneva, et koguda ja teha CSEC koondstatistika iga päev kättesaadavaks, et võimaldada agregaatide korrapärasest kontrollimist.

Esialgsete ja regulaarsete agregaatide kontrollimine

Vastavalt käesoleva suunise II lisa tabelis 2 esitatud ajakavale peavad EKP ja RKPd kontrollima esialgset ja korralist CSEC koondstatistikat jooksvale tootmistsüklile järgneva kalendrikuu seitsmenda tööpäeva lõpuks, tagamaks, et kõik CSEC prioriteediseeriade kogumid on kontrollitud.

EKP ja RKPd peavad tegema kõik endast oleneva, et kontrollida esialgset CSEC koondstatistikat neile hõlpsasti kättesaadava teabe põhjal, ning kontrollima vastavaid agregaate nende usaldusväärsuse osas. Esialgne CSEC koondstatistika puhul tuleb levitatud andmete juures märkida „esialgsed väärtused“.

EKP ja RKPd peavad põhjalikult kontrollima korralist CSEC koondstatistikat kogu selleks ajaks kättesaadava teabe, sealhulgas selliste muude võrdlusandmete alusel, mis on kättesaadavad väljaspool CSDBd. Korralise CSEC koondstatistika puhul tuleb levitatud andmete juures märkida „normaalväärtused“ (*normal values*).

Kontrollitegevuse prioriseerimine

Tõhusa kontrollimise töövoogu tagamiseks ja kontrolli dubleerimise vältimiseks tuleb CSEC koondstatistika kontrollimisel keskenduda „CSEC prioriteediseeriatele“, st kõige asjakohasemale madalaima taseme CSEC koondstatistikale. Prioriteediseeriade kontrollimisega tagatakse, et kontrollitakse ka kõiki kõrgema taseme agregaate, mis põhinevad nendel seerialtel ja olulisel määral ka kõiki nendega seotud kattuvaid agregaate.

CSEC prioriteediseeriad kujutavad endast riigi suhtes kõige asjakohasemat CSEC koondstatistikat, mida mõõdetakse nende jääkväärtusena väljendatuna osakaaluna CSEC kogumajanduse võlaväärtpaberite koondandmete jääkväärtusest ja mida mõõdetakse nende turukapitalisatsioonina, väljendatuna osakaaluna kogu CSEC kogumajanduse noteeritud aktsiate agregaatidest. Prioriteediseeriad on määratletud kui selline madalaima taseme CSEC koondstatistika seisude kohta turuväärtuses, mis on vajalik, et saavutada kõnealuse riigi puhul sihtväärtuse 2 DQM lävend.

Võlaväärtpaberite puhul hõlmab CSEC koondstatistika nelja kattuvat hierarhiat, mis on määratletud tabelites A1–A4 ja A6–A9. Töö dubleerimise vältimiseks määratakse võlaväärtpaberite puhul kindlaks CSEC prioriteediseeriad, mis põhinevad tabelites A1 ja A6 määratletud „fikseeritud kupongi“ ja „nullkupongi“ madalaima taseme „algsest lühiajalise tähtajaga“ ja „algsest pikaajalise tähtajaga“ agregaatidel ning samuti tabelites A2 ja A7 määratletud „inflatsiooniga seotud muutuva intressimäära“, „intressiga seotud muutuva intressimäära“ ja „vara hinnaga seotud muutuva intressimäära“ madalaima taseme agregaatidel. See tagab jaotuste üksikasjaliku kontrollimise instrumendi liikide kaupa ning samuti tähtajapõhiste jaotuste kõrgetasemelise kontrollimise (st algselt lühiajaline vs. pikaajaline tähtaeg).

Noteeritud aktsiate puhul põhineb CSEC prioriteediseeriade kindlaksmääramine tabelis A5 määratletud madalaima taseme agregaatidel.

CSEC koondstatistikat tuleb kontrollida „seeriade kogumite“ tasandil, mis koosneb kolme hinnameetodi (st turu-, nominaal- ja nimiväärtus) ja viie seerialiigi (st seisud, emissioonid, tagasiostud, ümberhindlused ja muud mahumuutused) agregaatidest, mis jagavad ülejäänud jaotusi. See tähendab, et turuväärtuses seisude puhul peab CSEC prioriteediseeriade kontrollimine alati hõlmama nende seeriade täielikku kogumit, mis on seotud vastava CSEC prioriteediseeriaga (edaspidi „CSEC prioriteediseeriade kogumid“).

Kui CSEC prioriteediseeriade kogumid näitavad olulist muutust jääkväärtuses või turukapitalisatsioonis pärast nende kontrollimist, kuid enne käesoleva suunise II lisa tabelis 2 esitatud ajakavas kindlaks määratud kontrollitähhtaega, peab CSDB vastavad seeriade kogumid esile tooma ja neid tuleb uuesti kontrollida.

CSEC koondstatistika DQM

CSEC prioriteediseeriade kontrollimisel ja kinnitamisel peavad EKP ja RKPd kontrollima seotud andmeseeriade kogumite aegridasid, et teha kindlaks järgmised võimalikud andmekvaliteedi probleemid:

- võõrväärtused, st väärtused, mis erinevad oluliselt vastavate aegridade muudest väärtustest;
- seisude-voogude vastuolud, st vaatlusperioodid, mille puhul jooksvad seisud ei võrdu eelmiste seisude pluss brutoemissioonide miinus tagasiostude pluss ümberhindluste summaga, mis võib olla tingitud muudest mahumuutustest või andmekvaliteedi probleemidest.

Kui EKP ja RKPd teevad esialgse ja korralise CSEC koondstatistika kontrollimise käigus kindlaks vastavad statistiliste andmete kvaliteedi probleemid, peavad nad need emissioonid CSDB kirjepõhistes alusandmetes parandama põhjendamatult viivitusega ning hiljemalt käesoleva suunise II lisa tabelis 2 esitatud ajakavas sätestatud tähtajaks. Kirjepõhiste andmete parandused kajastuvad CSEC koondstatistikas, mis koostatakse üleöötootlemise käigus järgmiseks päevaks.

V LISA

VASTAVUSTABEL

Suunis 2012/689/EU (ECB/2012/21)	Suunis (EL) 2021/834 (EKP/2021/15)	Käesolev suunis
Artikkel 1	-	Artikkel 1
Artikkel 2	-	Artikkel 2
-	-	Artikli 3 lõige 1
Artikli 3 lõige 1	-	Artikli 3 lõige 2
Artikli 3 lõige 2	-	Artikli 3 lõige 3
-	-	Artikli 4 lõiked 1, 2, 3 ja 4
Artikkel 8	-	Artikli 4 lõige 5
-	-	Artikli 4 lõiked 6 ja 7
Artikli 4 lõige 1	-	Artikli 5 lõige 1
Artikli 4 lõige 2, artikli 5 lõiked 1 ja 2 ning artikli 6 lõige 1	-	Artikli 5 lõige 2
Artikli 4 lõige 3	-	Artikli 5 lõige 3
Artikli 5 lõige 4	-	Artikli 5 lõige 4
-	-	Artikli 5 lõige 5
Artikli 5 lõige 6 ja artikli 6 lõige 3	-	Artikli 5 lõige 6
Artikli 5 lõige 4	-	Artikli 6 lõige 1
Artikli 5 lõige 3	-	Artikli 6 lõige 2
Artikli 5 lõige 5	-	Artikli 6 lõige 3
Artikli 6 lõige 2	-	Artikkel 7
Artikli 5 lõige 4 ja artikli 6 lõige 2	-	Artikkel 8
Artikli 7 lõige 1	-	Artikli 9 lõige 1
Artikli 7 lõige 2	-	Artikli 9 lõige 2
-	-	Artikli 9 lõige 3
-	-	Artikkel 10
-	-	Artikkel 11
-	Artikkel 9	Artikkel 12

Suunis 2012/689/EU (ECB/2012/21)	Suunis (EL) 2021/834 (EKP/2021/15)	Käesolev suunis
-	Artikkel 5	Artikkel 13
Artikkel 10	Artikkel 10	Artikkel 14
-	-	Artikkel 15
Artikkel 11	Artikkel 11	Artikkel 16
Artikkel 12	Artikkel 12	Artikkel 17
-	-	I lisa
I lisa	-	II lisa
II lisa	-	III lisa
-	-	IV lisa