

SMERNICE

SMERNICA EVROPSKE CENTRALNE BANKE

z dne 26. septembra 2012

o okviru za upravljanje s kakovostjo podatkov v centralizirani bazi vrednostnih papirjev

(ECB/2012/21)

(2012/689/EU)

SVET EVROPSKE CENTRALNE BANKE JE –

centralnim bankam zagotovijo najkasneje v sedmih delovnih dneh po koncu vsakega koledarskega meseca.

ob upoštevanju Statuta Evropskega sistema centralnih bank in Evropske centralne banke ter zlasti členov 5.1, 12.1 in 14.3 Statuta,

ob upoštevanju Uredbe Sveta (ES) št. 2533/98 z dne 23. novembra 1998 o zbiranju statističnih informacij s strani Evropske centralne banke ⁽¹⁾,

ob upoštevanju naslednjega:

- (1) Centralizirana baza vrednostnih papirjev (*Centralised Securities Database* – CSDB) je enotna informacijska infrastruktura, ki jo skupaj upravljajo članice Evropskega sistema centralnih bank (ESCB), vključno z nacionalnimi centralnimi bankami (NCB) držav članic zunaj euroobmočja, kadar take NCB prostovoljno sodelujejo pri upravljanju CSDB. V CSDB so shranjeni podatki po posameznih postavkah, zlasti podatki o vrednostnih papirjih, njihovih izdajateljih in cenah.
- (2) Podatki se zbirajo iz različnih virov, vključno od članic ESCB in nekaterih komercialnih ponudnikov podatkov ter iz javnih in upravnih virov, in se prenašajo v CSDB. Toda pri tem obstaja tveganje, da so taki vhodni podatki netočni ali nepopolni. Sistem CSDB lahko uskladi delno neskladne vhodne podatke iz različnih virov in zazna nepopolne ali manjkajoče podatke. Vhodne podatke iz različnih virov, ki se prekrivajo, samodejno sestavlja v kar se da popolno in visoko kakovostno enotno evidenco.
- (3) Splošna kakovost podatkov v CSDB se lahko ocenjuje samo na ravni izhodnih podatkov in ne na ravni posameznih nizov vhodnih podatkov. Da bi se, kolikor je mogoče, zagotovile popolnost, točnost in skladnost izhodnih podatkov, je treba opredeliti okvir za upravljanje s kakovostjo podatkov, ki se bo uporabljal za izhodne podatkovne vire, to je podniz izhodnih podatkov, ki se lahko uporabijo pri pripravi statistike ali za druge namene. Izhodni podatkovni viri se nacionalnim

- (4) Nekateri izhodni podatkovni viri vsebujejo tudi attribute, kot so informacije o cenah ali dohodku, za katere se pričakuje, da s časom nihajo. Sistem CSDB samodejno preverja te attribute prek statističnih algoritmov. Skladno s to smernico preverjajo pristojni organi samo tiste attribute, ki so določeni v Prilogi I za vsakega od ciljev upravljanja s kakovostjo podatkov. Popoln seznam atributov, ki predstavljajo podprte podatkovne vire, je določen v Prilogi II.

- (5) Okvir za upravljanje s kakovostjo podatkov v CSDB bi bilo treba za izhodne podatkovne vire uporabljati ne glede na vir vhodnih podatkov. Določiti bi moral odgovornost NCB euroobmočja za kakovost izhodnih podatkov v CSDB in, kadar je to primerno, odgovornost Evropske centralne banke (ECB).

- (6) Okvir za upravljanje s kakovostjo podatkov v CSDB bi moral temeljiti, prvič, na ciljih upravljanja s kakovostjo podatkov, ki predstavljajo kazalnike za ocenjevanje kakovosti izhodnih podatkovnih virov, in, drugič, na merilih za upravljanje s kakovostjo podatkov, ki za vsak posamezni cilj upravljanja s kakovostjo podatkov določijo in prednostno razvrstijo izhodne podatkovne vire, ki jih je treba preveriti. Prav tako bi moral temeljiti na pragovih upravljanja s kakovostjo podatkov, ki opredeljujejo najmanjšo raven preverjanja, ki ga je treba izvesti v povezavi s posameznim ciljem upravljanja s kakovostjo podatkov.

- (7) Zaradi odsotnosti referenčnih podatkov cilji upravljanja s kakovostjo podatkov vedno ne ugotovijo napak v izhodnih podatkovnih virih, ampak lahko zgolj ugotovijo primere, kjer je treba izhodne podatkovne vire ročno preveriti.

- (8) Ker CSDB skupaj upravljajo vse članice ESCB, bi vse morale spoštovati iste standarde za upravljanje s kakovostjo podatkov. Poleg tega so NCB zunaj euroobmočja v najboljšem položaju, da upravljajo s kakovostjo podatkov, povezanih z izdajatelji, ki so rezidenti v njihovih državah članicah. Medtem ko velja, da smernice, ki

⁽¹⁾ UL L 318, 27.11.1998, str. 8.

jih sprejme ECB, ne smejo nalagati obveznosti nacionalnim centralnim bankam zunaj euroobmočja, se člen 5 Statuta Evropskega sistema centralnih bank in Evropske centralne banke uporablja tako za NCB euroobmočja kot tudi za NCB zunaj euroobmočja. NCB zunaj euroobmočja bi zato morale oblikovati in izvesti vse ukrepe, ki jih štejejo kot primerne za upravljanje s kakovostjo podatkov v skladu s to smernico.

- (9) Da bi se izboljšala kakovost izhodnih podatkov, bi bilo treba upravljanje z viri podatkov izvajati s ciljem, da bi se ponavljajoče se in strukturne napake vhodnih podatkov ugotovile in odpravile neposredno pri ponudniku podatkov –

SPREJEL NASLEDNJO SMERNICO:

Člen 1

Opredelitev pojmov

V tej smernici:

1. „CSDB“ pomeni centralizirano bazo vrednostnih papirjev, ki jo je vzpostavil ESCB in se nahaja v prostorih ECB;
2. „vhodni podatki“ pomenijo vse podatke, ki se iz enega ali več virov podatkov zagotovijo v CSDB;
3. „izhodni podatki“ pomenijo podatke, ki se samodejno izpeljejo v CSDB s sestavljanjem vhodnih podatkov v popolno, visoko kakovostno enotno evidenco;
4. „izhodni podatkovni viri“ pomenijo podniz izhodnih podatkov in značilnosti, naštetih v Prilogi II, ki služijo kot vhodni podatki pri pripravi statistike ali za druge namene;
5. „upravljanje s kakovostjo podatkov“ pomeni zagotavljanje, preverjanje in ohranjanje kakovosti izhodnih podatkovnih virov z uporabo ciljev in pragov upravljanja s kakovostjo podatkov ter meril in delovnega postopka za upravljanje s kakovostjo podatkov;
6. „upravljanje z viri podatkov“ pomeni ugotavljanje in odpravljanje ponavljajočih se in/ali strukturnih napak vhodnih podatkov neposredno pri ponudniku podatkov;
7. „začetno upravljanje s kakovostjo podatkov“ pomeni upravljanje s kakovostjo izhodnih podatkovnih virov, vključno s podatki za zadnje časovno obdobje, ki ga mesečno izvajajo pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov, pri čemer upoštevajo izhodne podatkovne vire iz predogleda podatkov ob koncu meseca;
8. „redno upravljanje s kakovostjo podatkov“ pomeni upravljanje s kakovostjo izhodnih podatkovnih virov, ki ga mesečno izvajajo pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov, pri čemer upoštevajo referenčne podatke zunaj CSDB, pridobljene iz različnih virov podatkov, z namenom zagotoviti, da bo kakovost izhodnih podatkov CSDB izpolnjevala zahteve za podatkovne vire CSDB;
9. „cilj upravljanja s kakovostjo podatkov“ pomeni referenčno merilo za ocenjevanje kakovosti izhodnih podatkovnih virov, kot je določeno v Prilogi I;
10. „merilo za upravljanje s kakovostjo podatkov“ pomeni statistični kazalnik, ki meri raven, do katere je bil dosežen določen cilj upravljanja s kakovostjo podatkov, in je določen v Prilogi I;
11. „prag upravljanja s kakovostjo podatkov“ pomeni najnižjo raven preverjanja, ki ga je treba izvesti, da bi bile izpolnjene zahteve okvira za upravljanje s kakovostjo podatkov glede posameznega cilja upravljanja s kakovostjo podatkov;
12. „delovni postopek za upravljanje s kakovostjo podatkov“ pomeni tehnični postopek, ki se uporablja za popravljanje vhodnih podatkov, da bi bil izpolnjen prag upravljanja s kakovostjo podatkov;
13. „predogled podatkov ob koncu meseca“ pomeni redno mesečno posodabljanje izhodnih podatkov in meril za upravljanje s kakovostjo podatkov, na podlagi katerega se izdela približek izhodnih podatkov za naslednje stanje ob koncu meseca;
14. „delovni dan“ je celoten dan, ko je odprt sistem TARGET2, kot je objavljeno na spletni strani ECB;
15. „preverjanje“ pomeni postopek, pri katerem pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov pregledajo izhodne podatkovne vire CSDB in, če je potrebno, popravijo vhodne podatke CSDB, pri čemer uporabljajo delovni postopek za upravljanje s kakovostjo podatkov;
16. „rezident“ ima pomen, kot je določen v členu 1 Uredbe (ES) št. 2533/98.

Člen 2

Vsebina in področje uporabe

1. Ta smernica postavlja okvir za upravljanje s kakovostjo podatkov v CSDB, katerega cilj je z usklajeno uporabo pravil o standardih kakovosti za izhodne podatke v CSDB zagotoviti popolnost, točnost in skladnost takih podatkov.
2. Okvir za upravljanje s kakovostjo podatkov v CSDB temelji na upravljanju s kakovostjo podatkov in upravljanju z viri podatkov.

Člen 3

Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov

1. NCB držav članic euroobmočja, v katerih je posamezen izdajatelj vrednostnih papirjev rezident, so pristojne za upravljanje s kakovostjo podatkov, povezanih s tem izdajateljem.

2. ECB je pristojna za upravljanje s kakovostjo podatkov, povezanih z izdajatelji, ki niso rezidenti euroobmočja, razen če je NCB zunaj euroobmočja sprejela obveznost upravljanja s kakovostjo podatkov, povezanih z izdajatelji, ki so rezidenti v njeni državi članici.

Člen 4

Upravljanje s kakovostjo podatkov, merila za upravljanje s kakovostjo podatkov in pragovi upravljanja s kakovostjo podatkov

1. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov izvajajo začetno in redno upravljanje s kakovostjo podatkov. Pri tem preverjajo izhodne podatkovne vires ne glede na njihov vir.

2. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov uporabljajo merila za upravljanje s kakovostjo podatkov v skladu s Prilogo I.

3. Za attribute, zajete s Prilogo I, pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov uporabljajo pragove upravljanja s kakovostjo podatkov na ravni, ki zagotavlja kakovost izhodnih podatkovnih virov, kakršna se zahteva za uporabo teh zadevnih atributov, kot je določeno v Prilogi II.

Člen 5

Začetno upravljanje s kakovostjo podatkov

1. Začetno upravljanje s kakovostjo podatkov se izvaja za cilje upravljanja s kakovostjo podatkov 1, 2, 3a, 3b in 6, kot je določeno v Prilogi I.

2. ECB da na voljo predogled podatkov ob koncu meseca sedem delovnih dni pred koncem vsakega koledarskega meseca.

3. Pri izvajanju začetnega upravljanja s kakovostjo podatkov pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov preverijo znatna statistična odstopanja, da bi izhodni podatkovni viri po izvedbi začetnega upravljanja s kakovostjo podatkov, kolikor je mogoče, odražali zadnja gibanja.

4. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov preverijo podatke iz predogleda podatkov ob koncu meseca do konca drugega delovnega dne naslednjega koledarskega meseca, kolikor pragovi upravljanja s kakovostjo podatkov glede na merila za upravljanje s kakovostjo podatkov niso bili izpolnjeni.

5. Kadar referenčnih podatkov zunaj CSDB ni, se začetno upravljanje s kakovostjo podatkov opira zgolj na informacije, ki so že na voljo pristojnim organom za upravljanje s kakovostjo podatkov ali se lahko zlahka pridobijo, ne da bi se vzpostavljala kakšna nova poročevalska struktura.

6. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov popravijo vhodne podatke v skladu z delovnim postopkom za upravljanje s kakovostjo podatkov tako, da uporabijo sistem CSDB ali da Evropski centralni banki zagotovijo datoteke z vhodnimi podatki, kar je primerno.

Člen 6

Redno upravljanje s kakovostjo podatkov

1. Redno upravljanje s kakovostjo podatkov se izvaja za cilje upravljanja s kakovostjo podatkov 3a, 3b, 4, 5 in 6, kot je določeno v Prilogi I.

2. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov izvedejo redno upravljanje s kakovostjo podatkov v enem mesecu po koncu vsakega koledarskega meseca. Izhodne podatkovne vires preverijo ob upoštevanju vseh informacij, ki so trenutno na voljo, najkasneje do drugega delovnega dne tistega koledarskega meseca, ki sledi mesecu, v katerem je bilo izvedeno redno upravljanje s kakovostjo podatkov.

3. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov popravijo vhodne podatke v skladu z dogovorjenim delovnim postopkom za upravljanje s kakovostjo podatkov tako, da uporabijo sistem CSDB ali da Evropski centralni banki zagotovijo datoteke z vhodnimi podatki, kar je primerno.

Člen 7

Naloge v zvezi z upravljanjem z viri podatkov

1. Pristojni organi za upravljanje s kakovostjo podatkov ugotavljajo kakršna koli odprta vprašanja v zvezi z upravljanjem z viri podatkov in jih sporočajo ECB.

2. ECB obravnava ponavljajoče se, visoko prednostne napake, ki zadevajo upravljanje z viri podatkov, v sodelovanju z zadevnimi pristojnimi organi za upravljanje s kakovostjo podatkov v enem mesecu od datuma, ko je bilo vprašanje v zvezi z upravljanjem z viri podatkov sporočeno ECB.

Člen 8

Popravljanje vhodnih podatkov

Če pristojni organ za zagotavljanje kakovosti podatkov pridobi izboljšane vhodne podatke, uporabi sistem CSDB za popravo vseh napak in pomanjkljivosti svojih vhodnih podatkov, ki niso bile odpravljene med preverjanjem, kot je določeno v členu 5(4).

Člen 9

Letno poročilo o kakovosti

Izvršilni odbor ECB ob upoštevanju stališč Odbora ESCB za statistiko letno poroča Svetu ECB o kakovosti izhodnih podatkovnih virov.

Člen 10

Poenostavljen postopek spreminjanja

Izvršilni odbor ECB je ob upoštevanju stališč Odbora ESCB za statistiko upravičen izvesti tehnične spremembe prilog k tej smernici, pod pogojem, da take spremembe ne spremenijo osnovnega konceptualnega okvira te smernice, vključno z delitvijo odgovornosti med ECB in NCB, ali bistveno ne vplivajo na breme poročanja pristojnih organov za upravljanje s kakovostjo podatkov. Izvršilni odbor brez nepotrebnega odlašanja o vsaki taki spremembi obvesti Svet ECB.

Člen 11

Začetek veljavnosti

1. Ta smernica začne veljati 1. novembra 2012.
2. Ta smernica se uporablja od 1. julija 2013.

*Člen 12***Naslovniki**

Ta smernica je naslovljena na vse centralne banke Eurosistema.

V Frankfurtu na Majni, 26. septembra 2012

Za Svet ECB
Predsednik ECB
Mario DRAGHI

CILJI UPRAVLJANJA S KAKOVOSTJO PODATKOV, IZVEDBA, ATRIBUTI IN PODLAGA ZA PRAG UPRAVLJANJA S KAKOVOSTJO PODATKOV

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
Cilj 1: Stabilnost podatkov – podatki o stanjih	Koncept: Merilo se za vsako kombinacijo rezidenčna država/sektor opredeli kot z obsegom tehtani „indeks spremembe“, tehtano z denarnimi zneski. Če ima indeks vrednost 1, to prikazuje, da se zadevni atribut ni spremenil za nobenega od vrednostnih papirjev, na katere se indeks nanaša, vrednost indeksa 0 pa prikazuje, da se je zadevni atribut spremenil za vse vrednostne papirje. Če indeks pade pod 1, se ugotovijo posamezni vrednostni papirji s spremenjenim atributom, ki je povzročil padec indeksa, da bi se preverila sprememba, dokler ni dosežen prag za upravljanje s kakovostjo podatkov. Dogodki, ki sprožijo spremembo indeksa: Za diskretne attribute se šteje, da spremembo indeksa sproži vsaka razlika v atributu na medmesečni ravni. Za zvezne attribute se šteje, da spremembo indeksa sproži vsaka razlika na medmesečni ravni, ki je večja od 25 %. Zajeti instrumenti: To merilo upravljanja s kakovostjo podatkov zajema vse delnice investicijskih skladov, lastniške in dolžniške vrednostne papirje, vključno s certifikati, katerih datum zapadlosti ni starejši od treh mesecev.	Cilj 1 ocenjuje stabilnost podatkov o stanjih. Nepreverjene spremembe atributov CSDB ne smejo zmanjšati deleža stabilnih podatkov prek praga upravljanja s kakovostjo podatkov za vsakega od naslednjih sektorjev izdajateljev po Evropskem sistemu računov (ESR) ⁽¹⁾: — S.11 „nefinančne družbe“ (S.11 po ESR 95) — S.121 „centralna banka“ (S.121 po ESR 95) — S.122 „institucije, ki sprejemajo vloge, razen centralne banke“ (S.122 po ESR 95) — S.123 „skladi denarnega trga“ (MMF) (S.122 po ESR 95) — S.124 „investicijski skladi razen MMF“ (S.123 po ESR 95) — S.125 „drugi finančni posredniki razen zavarovalnih družb in pokojninskih skladov“ (S.123 po ESR 95) — S.126 „izvajalci pomožnih finančnih dejavnosti“ (S.124 po ESR 95) — S.127 „lastne finančne institucije in posojilodajalci“ (S.123 po ESR 95) — S.128 „zavarovalne družbe“ (IC) (S.125 po ESR 95) — S.129 „pokojninski skladi“ (PF) (S.125 po ESR 95) — S.13 „država“ (S.13 po ESR 95).	Eksplisitni atributi: datum izdaje dolga, datum zapadlosti dolga, nominalna valuta, osnova za kotacijo, razred instrumenta po ESR, rezidenčna država izdajatelja, sektor izdajatelja po ESR, razvrstitev izdajatelja po evropski klasifikaciji gospodarskih dejavnosti (NACE), neporavnani znesek, število uveljavljajočih se delnic za kotirane delnice.	Neporavnani zneski ali tržna kapitalizacija v eurih, izraženi kot delež podatkov o stanjih.

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
Cilj 2: Točnost podatkov – nove izdaje in odkupi; neto izdaje	Koncept: Merilo se opredeli za vsako kombinacijo rezidenčna državo/sektor in zajema nove izdaje, odkupe in neporavnane zneske dolžniških vrednostnih papirjev, navedeno v odstotkih. Merilo poveže aktivnosti v zvezi z neto izdajo med mesecem z neporavnanim zneskom ob koncu preteklega meseca (odstotkovna sprememba) in spremlja relativno gibanje neporavnane dolga. Omogočiti je treba dostop do razčlenjenih podatkov, navzdol do podatkov o posameznih novih izdajah in odkupih, ki so povzročili spremembo v neporavnanih zneskih. Ta gibanja je treba preveriti, dokler ni dosežen prag za upravljanje s kakovostjo podatkov.	Cilj 2 ocenjuje nove izdaje in odkupe glede na ustrezne podatke o stanjih. Nepreverjeni podatki o neporavnanih zneskih novih izdaj in odkupov dolžniških vrednostnih papirjev, navedeni v odstotkih, v neto vrednosti ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov za vsakega od naslednjih sektorjev izdajatelj po ESR: — S.11 „nefinančne družbe“ (S.11 po ESR 95) — S.121 „centralna banka“ (S.121 po ESR 95) — S.122 „institucije, ki sprejemajo vloge, razen centralne banke“ (S.122 po ESR 95) — S.123 „skladi denarnega trga“ (MMF) (S.122 po ESR 95) — S.124 „investicijski skladi razen MMF“ (S.123 po ESR 95) — S.125 „drugi finančni posredniki razen zavarovalnih družb in pokojninskih skladov“ (S.123 po ESR 95) — S.126 „izvajalci pomožnih finančnih dejavnosti“ (S.124 po ESR 95) — S.127 „lastne finančne institucije in posojilodajalci“ (S.123 po ESR 95) — S.128 „zavarovalne družbe“ (IC) (S.125 po ESR 95) — S.129 „pokojninski skladi“ (PF) (S.125 po ESR 95) — S.13 „država“ (S.13 po ESR 95).	Eksplcitni atributi: neporavnani znesek. Implicitni atributi: datum izdaje, datum zapadlosti, nominalna valuta, osnova za kotacijo, razvrstitev instrumenta po ESR, rezidenčna država izdajatelja, sektor izdajatelja po ESR.	Neporavnani zneski v eurih, izraženi kot relativno gibanje v primerjavi z ustreznimi podatki o stanjih.

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
Cilj 3a: Točnost podatkov – podpreti pravilne razporeditev po sektorjih in izvlečke podatkov po izdajateljih	Konceptualno ozadje: CSDB povezuje informacije o izdajatelju in instrumentu na podlagi povezave, ki se lahko opiše „od enega izdajatelja k več instrumentom“ (<i>one to many</i>), tj. en izdajatelj se lahko poveže z več instrumenti, nasprotno pa je vsak instrument povezan samo z enim izdajateljem. Ta povezava med instrumentom in izdajateljem se vzpostavi prek posameznih identifikacijskih oznak izdajateljev, ki jih določijo različni ponudniki vhodnih podatkov. Ker skupni standard še ne obstaja, se te identifikacijske oznake med ponudniki podatkov razlikujejo, morale pa bi biti usklajene. Če ponudniki vhodnih podatkov za isti instrument določijo neskladne (nasprotujoče si) identifikacijske oznake izdajateljev, tj. če med njimi ni strinjanja o izdajatelju, instrumenta ni mogoče razporediti k določenemu izdajatelju in pristane v „sporni skupini“ (<i>clash group</i>). Instrumente iz sporne skupine je še vedno mogoče pravilno razvrstiti po državi in sektorju, toda usklajene povezave do zadevnega izdajatelja instrumenta ni. Instrumenti v sporni skupini onemogočajo pridobitev usklajenih in zanesljivih izvlečkov vseh instrumentov, ki jih je izdal določen izdajatelj. Instrumenti v sporni skupini povečujejo tveganje napačne razvrstitve po rezidenčni državi ali sektorju. Koncept: Merilo za vsako rezidenčno državo ugotovi instrumente v sporni skupini in jih v odstotnih deležih glede na število ali denarne zneske poveže z vsemi instrumenti za to državo. Zajeti instrumenti: Merilo zajema vse instrumente v CSDB.	Cilj 3a ocenjuje pravilno identifikacijo izdajateljev. Kadar ni strinjanja o izdajatelju instrumenta, tj. instrumenti v „sporni skupini“, taki instrumenti ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov.	Eksplisitni atributi: identifikacijska oznaka izdajatelja, ki se uporablja za razvrščanje v skupine.	Neporavnani zneski v eurih, ki se nanašajo na instrumente v sporni skupini, izraženi kot odstotni delež vseh instrumentov.

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
Cilj 3b: Točnost podatkov – podpreti pravilne razporeditev po sektorjih in izvlečke podatkov po izdajateljih	Konceptualno ozadje: CSDB povezuje informacije o izdajatelju in instrumentu na podlagi povezave, ki se lahko opiše „od enega izdajatelja k več instrumentom“ (<i>one to many</i>), tj. en izdajatelj se lahko poveže z več instrumenti, nasprotno pa je vsak instrument povezan samo z enim izdajateljem. Ta povezava med instrumentom in izdajateljem se vzpostavi prek posameznih identifikacijskih oznak izdajateljev, ki jih določijo različni ponudniki vhodnih podatkov. Ker skupni standard še ne obstaja, se te identifikacijske oznake med ponudniki podatkov razlikujejo, morale pa bi biti usklajene. Če za določen instrument noben ponudnik podatkov ne določi identifikacijske oznake izdajatelja, obstaja tveganje, da ta instrument ne bo razporejen k določenemu izdajatelju in bo pristal v „samostojni skupini“ (<i>stand-alone group</i>), ki jo sestavlja samo ta instrument. Instrumente iz samostojnih skupin je še vedno mogoče pravilno razvrstiti po državi in sektorju, toda usklajene povezave do zadevnega izdajatelja instrumenta ni. Instrumenti v samostojnih skupinah onemogočajo pridobitev usklajenih in zanesljivih izvlečkov vseh instrumentov, ki jih je izdal določen izdajatelj. Instrumenti v samostojnih skupinah povečujejo tveganje napačne razvrstitve po rezidenčni državi ali sektorju, saj so informacije o njih pogosto nepopolne. Koncept: Merilo za vsako rezidenčno državo ugotovi instrumente v samostojnih skupinah in jih v odstotnih deležih glede na število ali denarne zneske poveže z vsemi instrumenti za to državo.	Cilj 3b ocenjuje pravilno identifikacijo populacije izdajateljev. Kadar ni zanesljivih informacij o izdajatelju instrumenta, tj. ko obstajajo instrumenti v „samostojnih skupinah“, taki instrumenti ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov.	Eksplisitni atributi: identifikacijska oznaka izdajatelja, ki se uporablja za razvrščanje v skupine.	Neporavnani zneski v eurih, ki se nanašajo na instrumente v samostojnih skupinah, izraženi kot odstotni delež vseh instrumentov.

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
	Zajeti instrumenti: Merilo zajema vse instrumente v CSDB.			
Cilj 4: Točnost podatkov – neporavnani znesek dolžniških vrednostnih papirjev, vključno s certifikati	Koncept: Merilo agregira neporavnane zneske za dolžniške vrednostne papirje, vključno s certifikati, po rezidenčni državi vsakega izdajatelja in po sektorju izdajatelja v skladu s konceptom statistike izdaj vrednostnih papirjev. Ta agregat se primerja z ustrezno postavko SEC in izračuna se odstotkovno odstopanje podatkov CSDB. Nepreverjene in nepojasnjene razlike ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov.	Cilj 4 primerja izhodne podatke CSDB z zunanjimi referenčnimi podatki. Nepreverjene in nepojasnjene razlike med agregiranimi podatki CSDB in ustreznimi informacijami statistike ECB o izdajah vrednostnih papirjev ali drugimi zanesljivimi referenčnimi podatki, če so taki referenčni podatki na voljo, za isti referenčni datum ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov za vsakega od naslednjih sektorjev izdajateljev po ESR: — S.11 „nefinančne družbe“ (S.11 po ESR 95) — S.121 „centralna banka“ (S.121 po ESR 95) — S.122 „institucije, ki sprejemajo vloge, razen centralne banke“ (S.122 po ESR 95) — S.123 „skladi denarnega trga“ (MMF) (S.122 po ESR 95) — S.124 „investicijski skladi razen MMF“ (S.123 po ESR 95) — S.125 „drugi finančni posredniki razen zavarovalnih družb in pokojninskih skladov“ (S.123 po ESR 95) — S.126 „izvajalci pomožnih finančnih dejavnosti“ (S.124 po ESR 95) — S.127 „lastne finančne institucije in posojilodajalci“ (S.123 po ESR 95) — S.128 „zavarovalne družbe“ (IC) (S.125 po ESR 95) — S.129 „pokojninski skladi“ (PF) (S.125 po ESR 95) — S.13 „država“ (S.13 po ESR 95).	EksPLICITNI atributi: Neporavnani znesek v eurih, tržna kapitalizacija v eurih. IMPLICITNI atributi: datum izdaje, datum zapadlosti, valuta, sektor izdajatelja po ESR, rezidenčna država.	Neporavnani zneski ali tržna kapitalizacija v eurih, izraženi kot odstotkovna razlika med podatki CSDB in zunanjimi referenčnimi podatki.

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
Cilj 5: Točnost podatkov – tržna kapitalizacija lastniških vrednostnih papirjev	Koncept: Merilo agregira tržno kapitalizacijo za lastniške vrednostne papirje po rezidenčni državi vsakega izdajatelja in po sektorju izdajatelja v skladu s konceptom statistike izdaj vrednostnih papirjev. Ta agregat se primerja z ustrezno postavko SEC in izračuna se odstotkovno odstopanje podatkov CSDB. Nepreverjene in nepojasnjene razlike ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov.	Cilj 5 primerja izhodne podatke CSDB z zunanjimi referenčnimi podatki. Nepreverjene in nepojasnjene razlike med agregiranimi informacijami CSDB in ustreznimi informacijami statistike ECB o izdajah vrednostnih papirjev ali drugimi zanesljivimi referenčnimi podatki, če so taki referenčni podatki na voljo, za isti referenčni datum ne smejo preseči praga upravljanja s kakovostjo podatkov za vsakega od naslednjih sektorjev izdajateljev po ESR: — S.11 „nefinančne družbe“ (S.11 po ESR 95) — S.121 „centralna banka“ (S.121 po ESR 95) — S.122 „institucije, ki sprejemajo vloge, razen centralne banke“ (S.122 po ESR 95) — S.123 „skladi denarnega trga“ (MMF) (S.122 po ESR 95) — S.124 „investicijski skladi razen MMF“ (S.123 po ESR 95) — S.125 „drugi finančni posredniki razen zavarovalnih družb in pokojninskih skladov“ (S.123 po ESR 95) — S.126 „izvajalci pomožnih finančnih dejavnosti“ (S.124 po ESR 95) — S.127 „lastne finančne institucije in posojilodajalci“ (S.123 po ESR 95) — S.128 „zavarovalne družbe“ (IC) (S.125 po ESR 95) — S.129 „pokojninski skladi“ (PF) (S.125 po ESR 95) — S.13 „država“ (S.13 po ESR 95).	Eksplisitni atributi: neporavnani znesek v eurih, število uveljavljajočih se delnic za kotirane delnice, ki kotirajo na borzi. Implicitni atributi: nominalna valuta, sektor izdajatelja po ESR, rezidenčna država, cena za kotirane delnice, ki kotirajo na borzi (samo pregled odstopanj).	Neporavnani zneski ali tržna kapitalizacija v eurih, izraženi kot odstotkovna razlika med podatki CSDB in zunanjimi referenčnimi podatki.

Cilj upravljanja s kakovostjo podatkov	Merila za upravljanje s kakovostjo podatkov	Izvedba	Atributi izhodnih podatkovnih virov	Podlaga za prag upravljanja s kakovostjo podatkov
Cilj 6: Točnost podatkov – razvrstitev izdajateljev	Koncept: Merilo razvršča izdajatelje za vsako kombinacijo rezidenčna država/sektor izdajatelja glede na njihove skupne obveznosti iz vrednostnih papirjev (združeno lastniški in dolžniški vrednostni papirji). Merilo prav tako prikazuje absolutne spremembe v razvrstitvi med različnimi izdajatelji, da bi se olajšalo ugotavljanje znatnih odstopanj v neporavnanih zneskih ali tržni kapitalizaciji. Razvrstitev izdajatelja po rezidenčni državi in sektorju se preverja do praga upravljanja s kakovostjo podatkov. Zajeti instrumenti: Merilo zajema vse delnice investicijskih skladov, lastniške in dolžniške vrednostne papirje, katerih datum zapadlosti ni starejši od treh mesecev.	Cilj 6 ocenjuje statistično razvrstitev izdajateljev. Statistična razvrstitev izdajateljev do praga upravljanja s kakovostjo podatkov se preverja za vsakega od naslednjih sektorjev izdajateljev po ESR: — S.11 „nefinančne družbe“ (S.11 po ESR 95) — S.121 „centralna banka“ (S.121 po ESR 95) — S.122 „institucije, ki sprejemajo vloge, razen centralne banke“ (S.122 po ESR 95) — S.123 „skladi denarnega trga“ (MMF) (S.122 po ESR 95) — S.124 „investicijski skladi razen MMF“ (S.123 po ESR 95) — S.125 „drugi finančni posredniki razen zavarovalnih družb in pokojninskih skladov“ (S.123 po ESR 95) — S.126 „izvajalci pomožnih finančnih dejavnosti“ (S.124 po ESR 95) — S.127 „lastne finančne institucije in posojilodajalci“ (S.123 po ESR 95) — S.128 „zavarovalne družbe“ (IC) (S.125 po ESR 95) — S.129 „pokojninski skladi“ (PF) (S.125 po ESR 95) — S.13 „država“ (S.13 po ESR 95).	Sektor izdajatelja po ESR, rezidenčna država.	Neporavnani zneski ali tržna kapitalizacija v eurih, izraženi kot „kapitalizacija“, tj. neporavnani zneski plus tržna kapitalizacija na izdajatelja.

(¹) Številčenje kategorij odraža številčenje, uvedeno v predlogu uredbe Evropskega parlamenta in Sveta o Evropskem sistemu nacionalnih in regionalnih računov v Evropski uniji, COM(2010) 774 konč.

PRILOGA II

PODATKOVNI VIRI IN ATRIBUTI IZHODNIH PODATKOVNIH VIROV, KI JIH ZAJEMA OKVIR ZA UPRAVLJANJE S KAKOVOSTJO PODATKOV

Okvir za upravljanje s kakovostjo podatkov zajema naslednje podatkovne vire, ki podpirajo različne namene:

- podatkovni viri za zunanjo statistiko (EXT 1.0)
- podatkovni viri glede družb, ki se ukvarjajo s prenosom finančnih sredstev, ki podpirajo statistiko družb, ki se ukvarjajo s prenosom finančnih sredstev (FVC 1.0)
- podatkovni viri glede investicijskih skladov, ki podpirajo statistiko investicijskih skladov (IF 1.0)
- podatkovni viri glede imetja vrednostnih papirjev, ki podpirajo statistiko imetja vrednostnih papirjev (SHS 1.0)
- podatkovni viri glede državnega financiranja z izdajanjem vrednostnih papirjev, ki podpirajo statistiko državnega financiranja z izdajanjem vrednostnih papirjev (GSF 1.0)

Atributi izhodnih podatkovnih virov, ki predstavljajo podprte podatkovne vire:

Ime atributa izhodnih podatkovnih virov	Opis	Podatkovni vir				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
<i>International Security Identification Number (ISIN) code</i> (Mednarodna identifikacijska številka vrednostnega papirja (ISIN))	Identifikacijska številka vrednostnega papirja ISIN.	√	√	√	√	√
<i>Instrument European System of Accounts (ESA) class</i> (Razred instrumenta po Evropskem sistemu računov (ESR))	Razvrstitev vrednostnega papirja po ESR.	√	√	√	√	√
<i>Debt type</i> (Vrsta dolga)	Vrsta dolžniškega instrumenta.				√	√
<i>Is In securities issues statistics (SEC)</i>	Atribut, ki se lahko uporabi za določanje vrednostnih papirjev, ki bi morali biti vključeni v „trenutne nepravne zneske“, skladno z opredelitvami pojmov statistike ECB o izdajah vrednostnih papirjev.					√
<i>Instrument supplementary class</i> (Dodatni razred instrumenta)	Dodatni atribut, ki omogoča ugotovitev, ali bi moral biti instrument vključen v statistiko izdaj vrednostnih papirjev ali ne. Ta atribut lahko zavzame vrednosti, kot so 1 = „coupon strip“ (ločeno trgovanje s kuponom), 2 = „principal strip“ (ločeno trgovanje z glavnico), itd.					√
<i>Security status</i> (Status vrednostnega papirja)	Dodatni atribut, ki omogoča ugotovitev, ali bi moral biti instrument vključen v statistiko izdaj vrednostnih papirjev ali ne. Ta atribut lahko prikaže, ali je instrument aktiven ali ne.					√
<i>Asset securitisation type</i> (Vrsta zavarovanja finančnega premoženja)	Vrsta zavarovanja finančnega premoženja.		√		√	
<i>Is In the Eligible Assets Database</i>	Atribut, ki prikazuje, ali je instrument primeren, da se uporabi kot zavarovanje za kreditne posle Eurosistema.				√	
<i>Nominal currency</i> (Nominalna valuta)	Nominalna valuta instrumenta (Mednarodna organizacija za standardizacijo (ISO) 4217).	√	√	√	√	√

Ime atributa izhodnih podatkovnih virov	Opis	Podatkovni vir				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
<i>Issue Date</i> (Datum izdaje)	Datum, ko izdajatelj proti plačilu izroči vrednostne papirje odkupniku primarne izdaje vrednostnih papirjev. To je datum, ko so vrednostni papirji prvič na voljo za izročitev investitorjem. Opomba: Za ločeno trgovanje (<i>strip</i>) ta stolpec prikazuje datum, ko se loči kupon/glavnica.	√	√	√	√	√
<i>Maturity date</i> (Datum zapadlosti)	Datum, ko se dolžniški instrument dejansko odkupi.	√	√	√	√	√
<i>Residual maturity</i> (Preostala zapadlost)	Preostala zapadlost instrumenta, izračunana za datum, na katerega se nanašajo izhodni podatkovni viri.					√
<i>Issuer domicile country</i> (Domicilna država izdajatelja)	Država pravne registriranosti (domicil) izdajatelja vrednostnega papirja (ISO 3166).	√	√	√	√	√
<i>Issuer ESA sector</i> (Sektor izdajatelja po ESR)	Institucionalni sektor izdajatelja po ESR.	√	√	√	√	√
<i>Issuer European Classification of Economic Activities (NACE) classification</i> (Razvrstitev izdajatelja po evropski klasifikaciji gospodarskih dejavnosti (NACE))	Glavna gospodarska dejavnost po NACE.	√				
<i>Amount issued</i> (Izdani znesek)	Znesek dolžniškega instrumenta, ki je bil pridobljen ob izdaji (nominalna vrednost). Za ločeno trgovanje (<i>strip</i>) ta stolpec prikazuje, pri katerem znesku je bil ločen kupon/glavnica. Za vrednostne papirje, izdane v tranšah pod eno številko ISIN, ta stolpec prikazuje kumulativni znesek, ki je bil dotlej izdan. Izdani znesek je izražen v nominalni valuti.					√
<i>Amount outstanding</i> (Neporavnani znesek)	Neporavnani znesek v nominalni vrednosti. Za vrednostne papirje, izdane v tranšah pod isto številko ISIN, ta stolpec prikazuje kumulativni znesek, ki je bil dotlej izdan, neto brez odkupov. Vrednosti so v nominalni valuti. Neporavnani znesek je izražen v nominalni valuti. Če podatka o nominalni valuti ni, je neporavnani znesek izražen v eurih.	√			√	√
<i>Amount outstanding in euro</i> (Neporavnani znesek v eurih)	Neporavnani znesek, preračunan v eure po menjalnem tečaju za euro glede na nominalno valuto, veljavnem na datum, na katerega se nanašajo izhodni podatkovni viri.				√	√
<i>Market capitalisation</i> (Tržna kapitalizacija)	Zadnja tržna kapitalizacija, ki je na voljo. Tržna kapitalizacija je izražena v nominalni valuti. Če podatka o nominalni valuti ni, je tržna kapitalizacija izražena v eurih.				√	

Ime atributa izhodnih podatkovnih virov	Opis	Podatkovni vir				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
<i>Yield to maturity</i> (Donos do zapadlosti)	Donos do zapadlosti posameznega vrednostnega papirja v odstotkih.				√	√
<i>Short name</i> (Skrajšano ime)	Skrajšano ime, ki ga določi izdajatelj in se opredeli glede na značilnosti izdaje in kakršne koli razpoložljive informacije.					√
<i>Pool factor</i> (Faktor sklada)	Pri vrednostnih papirjih, zavarovanih s hipotekami, faktor sklada ali faktor preostalih glavnih izraža neporavnane zneske glavnih iz sklada hipotek, s katerim je zavarovan vrednostni papir, deljeno s prvotnim zneskom glavnih.	√	√	√	√	√
<i>Quotation basis</i> (Osnova za kotacijo)	Osnova za kotacijo instrumenta, npr. odstotek nominalne vrednosti (odstotek) ali valuta na delnico/enoto (enote).	√	√	√	√	√
<i>Price value</i> (Cena)	Zadnja razpoložljiva reprezentativna cena instrumenta na referenčni datum glede na osnovo za kotacijo in nominalno valuto, če je primerno, instrumenta. Za vrednostne papirje, ki prinašajo obresti, je podana čista cena, tj. brez natečenih obresti.	√	√	√	√	√
<i>Price value type</i> (Vrsta cene)	Narava cene, tj. če predstavlja tržno vrednost, ocenjeno ali privzeto vrednost.	√	√	√	√	√
<i>Monthly average price</i> (Povprečna mesečna cena)	Povprečje normaliziranih cen instrumenta, ki so na voljo v zadnjih 30 kalendarjskih dnevih do referenčnega datuma glede na osnovo za kotacijo in nominalno valuto, če je primerno, instrumenta.	√			√	
<i>Redemption type</i> (Način odkupa)	Način odkupa, npr. z enkratnim odplačilom ob zapadlosti (<i>bullet</i>), časovno neomejen (<i>perpetual</i>), strukturiran (<i>structured</i>), z anuitetami (<i>annuity</i>), serijski (<i>serial</i>), neredni (<i>irregular</i>), ničeni (<i>null</i>), stopničasti (<i>stepped</i>).					√
<i>Redemption frequency</i> (Pogostost odkupov)	Število odkupov na leto za dolžniški instrument.					√
<i>Redemption price</i> (Cena ob odkupu)	Končna cena ob odkupu.					√
<i>Accrued interest</i> (Natečene obresti)	Obresti, ki so se natekle od zadnjega izplačila kupona ali od datuma, ko začnejo teči. Za vrednostne papirje, ki prinašajo obresti, dodajanje te vrednosti k ceni prikazuje tako imenovano „polno ceno“ (<i>dirty price</i>).	√	√	√		√
<i>Accrued income factor</i> (Faktor nastalih dohodkov)	Faktor dnevnega dohodka posameznega vrednostnega papirja v odstotkih, izračunan po dolžniškem pristopu (<i>debtor approach</i>). Faktor temelji na dohodkih, tj. prikazuje združen učinek natečenih obresti in dohodka iz razlike v ceni ob izdaji in odkupu.	√	√	√	√	

Ime atributa izhodnih podatkovnih virov	Opis	Podatkovni vir				
		EXT 1.0	FVC 1.0	IF 1.0	SHS 1.0	GSF 1.0
<i>Coupon type</i> (Vrsta kupona)	Vrsta kupona, npr. fiksni, spremenljiv, stopničast itd.				√	√
<i>Last coupon rate</i> (Zadnja kuponska obrestna mera)	Zadnja kuponska obrestna mera v odstotkih na leto, ki je bila dejansko izplačana (letna obrestna mera).	√	√	√	√	
<i>Last coupon date</i> (Datum zadnjega izplačila kupona)	Datum, ko je bila dejansko izplačana zadnja kuponska obrestna mera. Atribut omogoča ugotovitev, ali je zadnja kuponska obrestna mera, ki je bila dejansko izplačana, zajeta v poročevalsko obdobje ali ne.	√	√	√	√	
<i>Last coupon frequency</i> (Pogostost izplačevanja kuponov)	Pogostost na leto, s kakršno se izplačuje zadnja kuponska obrestna mera: „annual“ (letno) se preoblikuje v AN, „semi-annual“ (polletno) v SA itd.	√	√	√	√	
<i>Dividend amount</i> (Znesek dividende)	Znesek zadnjega izplačila dividende na delnico (glede na način izplačila dividende) pred obdavčitvijo (bruto dividenda).	√		√	√	
<i>Dividend amount type</i> (Način izplačila dividende)	Dividenda na delnico je lahko izražena v valuti ali številu delnic.	√		√	√	
<i>Dividend currency</i> (Valuta dividende)	Koda valute ISO 4217 za zadnje izplačilo dividende.	√		√	√	
<i>Dividend Settlement date</i> (Datum poravnave dividende)	Datum poravnave zadnjega izplačila dividende. Atribut omogoča ugotovitev, ali je izplačan znesek dividende zajet v poročevalsko obdobje ali ne.	√		√	√	
<i>Last split factor</i> (Faktor zadnje razdelitve delnic)	Razdelitve in združitve delnic.	√		√	√	
<i>Last split date</i> (Datum zadnje razdelitve delnic)	Datum, od katerega učinkuje razdelitev delnic.	√		√	√	