

I

(Resolutioner, rekommendationer och yttranden)

REKOMMENDATIONER

EUROPEISKA CENTRALBANKEN

EUROPEISKA CENTRALBANKENS REKOMMENDATION

av den 19 maj 2022

**om den centrala värdepappersdatabasen och produktionen av statistik om värdepappersemissioner
och om upphävande av rekommendation ECB/2012/22**

(ECB/2022/26)

(2022/C 240/01)

ECB-RÅDET HAR ANTAGIT DENNA REKOMMENDATION

med beaktande av fördraget om Europeiska unionens funktionssätt,

med beaktande av stadgan för Europeiska centralbankssystemet och Europeiska centralbanken, särskilt artikel 5.1 och artikel 34.1 tredje strecksatsen,

med beaktande av rådets förordning (EG) nr 2533/98 av den 23 november 1998 om Europeiska centralbankens insamling av statistiska uppgifter ⁽¹⁾, särskilt artikel 4,

med beaktande av Europeiska centralbankens allmänna råds medverkan, och

av följande skäl:

- (1) Den centrala värdepappersdatabasen (CSDB) utgörs av en samlad it-infrastruktur som drivs gemensamt av medlemmarna i Europeiska centralbankssystemet (ECBS), inbegripet nationella centralbanker i de medlemsstater som inte har euron som valuta (nedan kallade *nationella centralbanker utanför euroområdet*) i de fall då dessa nationella centralbanker utanför euroområdet frivilligt deltar i driften av CSDB. CSDB innehåller uppgifter post för post, särskilt uppgifter om värdepapper, emittenter, priser och värderingar. CSDB:s verksamhet omfattar följande huvudsakliga processer: att tillhandahålla ingående uppgifter, behandla dessa ingående uppgifter, utföra kvalitetssäkring (DQM) samt producera och sprida utgående uppgifter bestående av uppgifter data för data och aggregerad information. De relevanta undergrupperna till ECBS statistikkommitté definierar dessa processer och vidareutvecklar dem kontinuerligt, och processerna automatiseras så långt som möjligt för att säkerställa att CSDB fungerar effektivt. Eftersom flera av dessa processer ändrats är det nödvändigt att anta en ny riktlinje och att upphäva riktlinje ECB/2012/21 som hittills har styrt regelverket för kvalitetssäkring av CSDB. På samma sätt bör även rekommendation ECB/2012/22 ⁽²⁾, enligt vilken nationella centralbanker utanför euroområdet bör följa bestämmelserna i rekommendation ECB/2012/21, också upphävas.

⁽¹⁾ EUT L 318, 27.11.1998, s. 8.

⁽²⁾ Europeiska centralbankens rekommendation ECB/2012/22 av den 26 september 2012 om regler för kvalitetssäkringen av uppgifter i den centraliserade värdepappersdatabasen (EUT C 339, 7.11.2012, s. 1).

- (2) För att förbättra analyserna av monetär och finansiell stabilitet för euroområdet och unionen, bidra till produktion av sekundär statistik, fullgöra euroområdets rapporteringsskyldigheter om statistik över emissioner av skuldebrev i samband med G20-initiativet för bättre statistik samt bedöma eurons roll på internationella finansiella marknader produceras månadsstatistiken över värdepappersemissioner omfattande stock- och flödesaggregat från CSDB-uppgifter post för post (nedan kallad *aggregerad CSEC-statistik*). Aggregerad CSEC-statistik bör därför sammanställas i CSDB, och nationella centralbanker och Europeiska centralbanken (ECB) bör ansvara för verifieringen av aggregerad CSEC-statistik samt för DQM av underliggande CSDB-uppgifter post för post.
- (3) Den samlade kvaliteten på CSDB-uppgifter post för post kan bara bedömas på utgående nivå, inte genom att granska individuella uppsättningar ingående uppgifter. För att säkerställa att de utgående uppgifterna så långt möjligt är fullständiga, korrekta och konsistenta inrättar Europeiska centralbankens riktlinje (EU) 2022/971] (ECB/2022/25)¹ (³) ett ramverk för att tillhandahålla ingående uppgifter, sprida utgående uppgifter samt inrättar regler för kvalitets-säkringen (DQM) som tillämpas på produktionsdata, som är en delmängd av de utgående uppgifter som kan användas för statistikproduktion eller andra ändamål, och för aggregerad CSEC-statistik och de underliggande CSDB-uppgifterna.
- (4) Om andra behöriga myndigheter än nationella centralbanker tillhandahåller ingående uppgifter till CSDB eller utför kvalitetssäkringsarbetet i CSDB, ska sådana myndigheter och deras respektive nationella centralbanker samarbeta för att säkerställa att de krav som framgår av riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25) uppfylls. Ett sådant samarbete bör inkludera inrättandet av en varaktig struktur för att överföra uppgifter förutsatt att samma resultat inte redan uppnås genom nationell lagstiftning.
- (5) För att kvalitetssäkringsarbetet i CSDB ska fungera krävs att alla ECBS-medlemmar samarbetar i driften av CSDB och att medlemmarna tillämpar jämförbara kvalitetsstandarder. Centralbanker i medlemsstater utanför euroområdet som deltar i driften av CSDB bör samarbeta sinsemellan, med nationella centralbanker i de medlemsstater som har infört euron (nedan kallade *nationella centralbanker i euroområdet*) samt med ECB för att bedriva kvalitetssäkringsarbetet i CSDB i enlighet med riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25).

HÄRIGENOM FÖRESKRIVS FÖLJANDE.

I. Definitioner

I denna rekommendation ska termerna "centraliserad värdepappersdatabas" eller "CSDB" och "kvalitetssäkring" eller "DQM" ha samma innebörd som i artikel 1 i riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25).

II. Tillhandahållande av statistisk information

1. Adressaterna ska uppfylla de skyldigheter för nationella centralbanker i euroområdet inom överenskomna tidsramar som framgår av artiklarna 2–13 och 16 i riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25).
2. För sammanställningen av aggregerad CSEC-statistik enligt artikel 10 i riktlinje (EU) [2022/971 (ECB/2022/25)] framgår uppdelningen av aggregerad CSEC-statistik för medlemsstater utanför euroområdet och unionen som helhet av bilaga I till denna rekommendation.

III. Upphävande

Rekommendation ECB/2012/22 ska upphöra att gälla.

IV. Slutbestämmelse

Denna rekommendation riktar sig i tillämpliga delar till de nationella centralbankerna i medlemsstater utanför euroområdet.

(¹) Europeiska centralbankens riktlinje (EU) 2022/971 av den 19 maj 2022 om statistik över värdepapper och värdepappersemissioner (ECB/2022/25) (EUT L 166, 22.6.2022, s. 147).

Utfärdad i Frankfurt am Main den 19 maj 2022.

Christine LAGARDE
ECB:s ordförande

BILAGA I

Aggregerad CSEC-statistik – uppdelning för medlemsstater utanför euroområdet och unionen som helhet

Uppdelningen av aggregerad CSEC-statistik för de enskilda länderna i euroområdet och euroområdet som helhet definieras i bilaga IV till riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25), och uppdelningen av aggregerad CSEC-statistik för sådana medlemsstater som inte har euron som valuta (nedan kallade *medlemsstater utanför euroområdet*) och unionen som helhet framgår av denna bilaga.

För alla emissioner som sker i enskilda medlemsstater utanför euroområdet, ska den aggregerade CSEC-statistiken anges i nationell valuta och sammanställas för de uppdelningar som anges i nedanstående tabeller. Därutöver ska aggregaten för emissioner denominerade i "Alla valutor" och i "EUR" också anges i euro. För emissioner för unionen som helhet ska den aggregerade CSEC-statistiken anges i euro och sammanställas endast för uppdelningen "Alla valutor" som definieras i nedanstående tabeller. Sektorkoderna som används i tabellerna följer definitionerna i avsnitt 1 om "Omfattning och klassificeringar i bilaga IV till riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25).

Tabell A1

Skuldebrev, hierarki 1 – Huvuduppdelningar efter löptid och typ av ränta för enskilda medlemsstater utanför euroområdet och för unionen som helhet

Sektor																					
Valutadenominering, löptid, instrumenttyp																					
Valutadenominering	Löptid	Typ av instrument	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Alla valutor	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta																			
	Långfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta																			
		Fast kupong																			
		Nollkupong																			
Rörlig ränta																					
Inhemsk valuta	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
	Långfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta																			
		Fast kupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Nollkupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Rörlig ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
EUR	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
	Långfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta																			
		Fast kupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Nollkupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Rörlig ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Andra valutor än euro	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
	Långfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta																			
		Fast kupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Nollkupong		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Rörlig ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L

Förklaringar: Varje ruta i tabellen ska sammanställas stockar, bruttoemission, inlösen, omvärderingar och andra volymförändringar till marknadsvärde och nominellt värde, samt för stockar till nominellt värde. Rutor markerade med "L" utgör aggregat på lägsta nivå som inte får delas upp ytterligare på nivån individuella medlemsstater utanför euroområdet. Rutor markerade med "L*" utgör aggregat på lägsta nivå som används för att identifiera CSEC-prioritetsserier, som omfattas av den kvalitetssäkring för aggregerad CSEC-statistik som framgår av bilaga IV till riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25). Alla andra rutor i tabellen utgör aggregat på högre nivå som skapas genom att aggregera aggregat på lägsta nivå.

Tabell A2

Skuldebrev, hierarki 2 – Detaljerade uppdelningar efter löptid och typ av ränta för enskilda medlemsstater utanför euroområdet och för unionen som helhet

Sektor																								
Valutadenominering, löptid, instrumenttyp																								
Valutadenominering	Löptid	Typ av instrument	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M			
Alla valutor	Alla löptider	Alla typer av ränta																						
		Fast ränta																						
		Fast kupong																						
		Nollkupong																						
		Rörlig ränta																						
		Inflationsrelaterad rörlig ränta																						
		Ränterelaterad rörlig ränta																						
		Rörlig ränta kopplad till tillgångspris																						
Inhemsk valuta	Alla löptider	Alla typer av ränta																						
		Fast ränta																						
		Fast kupong		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L			
		Nollkupong		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L			
		Rörlig ränta																						
		Inflationsrelaterad rörlig ränta		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*			
		Ränterelaterad rörlig ränta		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*			
		Rörlig ränta kopplad till tillgångspris		L*		L*	L*			L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*			

Sektor																						
			Valutadenominering, löptid, instrumenttyp																			
Valutadenominering	Löptid	Typ av instrument	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M	
EUR	Alla löptider	Alla typer av ränta																				
		Fast ränta																				
		Fast kupong		L		L	L				L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
		Nollkupong		L		L	L				L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
		Rörlig ränta																				
		Inflationsrelaterad rörlig ränta		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Ränterelaterad rörlig ränta		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Rörlig ränta kopplad till tillgångspris		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
Andra valutor än euro	Alla löptider	Alla typer av ränta																				
		Fast ränta																				
		Fast kupong		L		L	L				L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
		Nollkupong		L		L	L				L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
		Rörlig ränta																				
		Inflationsrelaterad rörlig ränta		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Ränterelaterad rörlig ränta		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*
		Rörlig ränta kopplad till tillgångspris		L*		L*	L*				L*		L*	L*	L*	L*	L*		L*	L*	L*	L*

Förklaringar: Varje ruta i tabellen ska sammanställas stockar, bruttoemission, inlösen, omvärderingar och andra volymförändringar till marknadsvärde och nominellt värde, samt för stockar till nominellt värde. Rutor markerade med "L" utgör aggregat på lägsta nivå som inte får delas upp ytterligare på nivån individuella medlemsstater utanför euroområdet. Rutor markerade med "L*" utgör aggregat på lägsta nivå som används för att identifiera CSEC-prioritetsserier, som omfattas av den kvalitetssäkring för aggregerad CSEC-statistik som framgår av bilaga IV till riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25). Alla andra rutor i tabellen utgör aggregat på högre nivå som skapas genom att aggregera aggregat på lägsta nivå.

Tabell A3

Skuldebrev, hierarki 3 – Detaljerade uppdelningar efter ursprunglig löptid för enskilda medlemsstater utanför euroområdet och för unionen som helhet

Sektor																					
Valutadenominering, löptid, instrumenttyp																					
Valutadenominering	Löptid	Typ av instrument	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Alla valutor	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta																			
	Ursprunglig löptid >1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta																			
	Ursprunglig löptid >2 år och ≤5 år	Alla typer av ränta																			
	Ursprunglig löptid >5 år och ≤10 år	Alla typer av ränta																			
	Ursprunglig löptid >10 år	Alla typer av ränta																			
Inhemsk valuta	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >2 år och ≤5 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >5 år och ≤10 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >10 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
EUR	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >2 år och ≤5 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >5 år och ≤10 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >10 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Andra valutor än euro	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >2 år och ≤5 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >5 år och ≤10 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Ursprunglig löptid >10 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L

Förklaringar: Varje ruta i tabellen ska sammanställas stockar, bruttoemission, inlösen, omvärderingar och andra volymförändringar till marknadsvärde och nominellt värde, samt för stockar till nominellt värde. Rutor markerade med "L" utgör aggregat på lägsta nivå som inte får delas upp ytterligare på nivån individuella medlemsstater utanför euroområdet. Alla andra rutor i tabellen utgör aggregat på högre nivå som skapas genom att aggregera aggregat på lägsta nivå.

Tabell A4

Skuldebrev, hierarki 4 – Detaljerade uppdelningar efter återstående löptid för enskilda medlemsstater utanför euroområdet och för unionen som helhet

Sektor																					
Valutadenominering, löptid, instrumenttyp																					
Valutadenominering	Löptid	Typ av instrument	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Alla valutor	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid ≤1 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid > 1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid >2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Inhemsk valuta	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid ≤1 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid > 1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid >2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
EUR	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid ≤1 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid > 1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid >2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
Andra valutor än euro	Alla löptider	Alla typer av ränta																			
	Kortfristig till ursprunglig löptid	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid ≤1 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid > 1 år och ≤2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L
	Långfristig ursprunglig löptid med en återstående löptid >2 år	Alla typer av ränta		L		L	L			L		L	L	L	L	L		L	L	L	L

Förklaringar: Varje ruta i tabellen ska sammanställas stockar, bruttoemission, inlösen, omvärderingar och andra volymförändringar till marknadsvärde och nominellt värde, samt för stockar till nominellt värde. Rutor markerade med "L" utgör aggregat på lägsta nivå som inte får delas upp ytterligare på nivån individuella medlemsstater utanför euroområdet. Alla andra rutor i tabellen utgör aggregat på högre nivå som skapas genom att aggregera aggregat på lägsta nivå.

Tabell A5

Uppdelningar av noterade aktier för enskilda medlemsstater utanför euroområdet och för unionen som helhet

Sektor																			
	S1	S11	S12	S121	S122	S12M	S12P	S124	S125	S125A	S125W	S126	S127	S12Q	S13	S1311	S13M	S1314	S1M
Alla valutor								Ej tillämpl.		Ej tillämpl.					Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.
Inhemsk valuta		L*		L*	L*			Ej tillämpl.		Ej tillämpl.	L*	L*	L*	L*	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.
EUR		L*		L*	L*			Ej tillämpl.		Ej tillämpl.	L*	L*	L*	L*	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.
Andra valutor än euro		L*		L*	L*			Ej tillämpl.		Ej tillämpl.	L*	L*	L*	L*	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.	Ej tillämpl.

Förklaringar: Varje ruta i tabellen ska sammanställas stockar, bruttoemission, inlösen, omvärderingar och andra volymförändringar till marknadsvärde. Rutor markerade med "L" utgör aggregat på lägsta nivå som inte får delas upp ytterligare på nivån individuella medlemsstater utanför euroområdet. Rutor markerade med "L*" utgör aggregat på lägsta nivå som används för att identifiera CSEC-prioritetsserier, som omfattas av den kvalitetssäkring för aggregerad CSEC-statistik som framgår av bilaga IV till riktlinje (EU) 2022/971 (ECB/2022/25). Andra rutor i tabellen (med undantag för sådana som är markerade "Ej tillämpl.", som anger sektorer som normalt inte emitterar noterade aktier) utgör aggregat på högre nivå som skapas genom att aggregera aggregat på lägsta nivå.