

I

(Entschlüsse, Empfehlungen und Stellungnahmen)

EMPFEHLUNGEN

EUROPÄISCHE ZENTRALBANK

EMPFEHLUNG DER EUROPÄISCHEN ZENTRALBANK

vom 2. August 2016

über das Rahmenwerk für das Datenqualitätsmanagement für Statistiken über Wertpapierbestände

(EZB/2016/24)

(2016/C 297/01)

DER EZB-RAT —

gestützt auf die Satzung des Europäischen Systems der Zentralbanken und der Europäischen Zentralbank, insbesondere auf Artikel 5.1 und Artikel 34.1 dritter Gedankenstrich,

gestützt auf die Verordnung (EG) Nr. 2533/98 des Rates vom 23. November 1998 über die Erfassung statistischer Daten durch die Europäische Zentralbank⁽¹⁾,

in Erwägung nachstehender Gründe:

- (1) Verordnung (EU) Nr. 1011/2012 der Europäischen Zentralbank (EZB/2012/24)⁽²⁾ bestimmt, dass die in einem Mitgliedstaat des Euro-Währungsgebiets ansässigen Berichtspflichtigen Positionen, Transaktionen und gegebenenfalls andere Volumenänderungen der von ihnen gehaltenen Wertpapiere nach einzelnen Wertpapieren getrennt melden müssen. Die nationalen Zentralbanken der Mitgliedstaaten, deren Währung der Euro ist (NZBen), sind verpflichtet, diese Daten zu klassifizieren und zu aggregieren.
- (2) Die Gesamtqualität der Daten zu Wertpapierbeständen ist auf Ebene der Inputdaten (einzelne Wertpapiere) wie auch auf Ebene der Outputdaten (sowohl einzelne als auch aggregierte Daten) zu beurteilen. Zur Gewährleistung der Vollständigkeit, Genauigkeit und Kohärenz der Statistik über Wertpapierbestände schafft Leitlinie EZB/2013/7 der Europäischen Zentralbank⁽³⁾ einen Rahmen für das Datenqualitätsmanagement (DQM).
- (3) Der DQM-Rahmen beschreibt die Verantwortlichkeiten der dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen für die Qualität der Ausgangsdaten von Wertpapierbeständen und gegebenenfalls die der Betreiber der Statistikdatenbank für Wertpapierbestände (Securities Holdings Statistics Database, nachfolgend die „SHSDB“) des Europäischen Systems der Zentralbanken (ESZB), d. h. der Europäischen Zentralbank (EZB) und der Deutschen Bundesbank.
- (4) Zur Gewährleistung einer gleichbleibenden Qualität sollten alle teilnehmenden Mitglieder des ESZB, die der EZB Daten für die SHSDB melden, dieselben DQM-Standards einhalten. Darüber hinaus sind die nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen am besten in der Lage, das DQM für Daten in Bezug auf die in ihren jeweiligen Mitgliedstaaten der NZBen ansässigen Anleger durchzuführen. Wenngleich anerkannt wird, dass die von der EZB erlassenen Leitlinien keine Verpflichtungen für nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörende NZBen begründen können, gilt Artikel 5 der Satzung des Europäischen Systems der Zentralbanken und der Europäischen Zentralbank für die dem Euro-Währungsgebiet angehörenden wie auch für die nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen gleichermaßen. Nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörende NZBen, die der EZB Daten für die SHSDB melden, sollten daher alle Maßnahmen darlegen und umsetzen, die sie für angemessen halten, um das DQM im Einklang mit Richtlinie EZB/2013/7 durchzuführen. Die nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen sollten bei der Anwendung des DQM-Rahmenwerks im Einklang mit dieser Richtlinie miteinander, mit den dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen und mit der EZB zusammenarbeiten —

⁽¹⁾ ABl. L 318 vom 27.11.1998, S. 8.

⁽²⁾ Verordnung (EU) Nr. 1011/2012 der Europäischen Zentralbank vom 17. Oktober 2012 über die Statistiken über Wertpapierbestände (EZB/2012/24) (ABl. L 305 vom 1.11.2012, S. 6).

⁽³⁾ Leitlinie EZB/2013/7 der Europäischen Zentralbank vom 22. März 2013 über die Statistiken über Wertpapierbestände (ABl. L 125 vom 7.5.2013, S. 17).

HAT FOLGENDE EMPFEHLUNG ERLASSEN:

Im Sinne der vorliegenden Empfehlung haben die Begriffe „Statistiken über Wertpapierbestände“ und „DQM“ dieselbe Bedeutung wie in der Leitlinie EZB/2013/7.

Die Adressaten der vorliegenden Empfehlung sollten das in Artikel 11 Absatz 3 bis 6 der Leitlinie EZB/2013/7 festgelegte DQM-Rahmenwerk für Statistiken über Wertpapierbestände anwenden und rechtzeitig mit den Betreibern der SHSDB zusammenarbeiten.

Die vorliegende Empfehlung ist an die nicht dem Euro-Währungsgebiet angehörenden NZBen gerichtet, die für den Zweck der SHSDB Daten an die EZB melden.

Geschehen zu Frankfurt am Main am 2. August 2016.

Der Präsident der EZB

Mario DRAGHI
