



Zusätzliche Informationen zur Einreichung von Meldungen zur Geldmarktstatistik

Gültig ab: **28.09.2020**

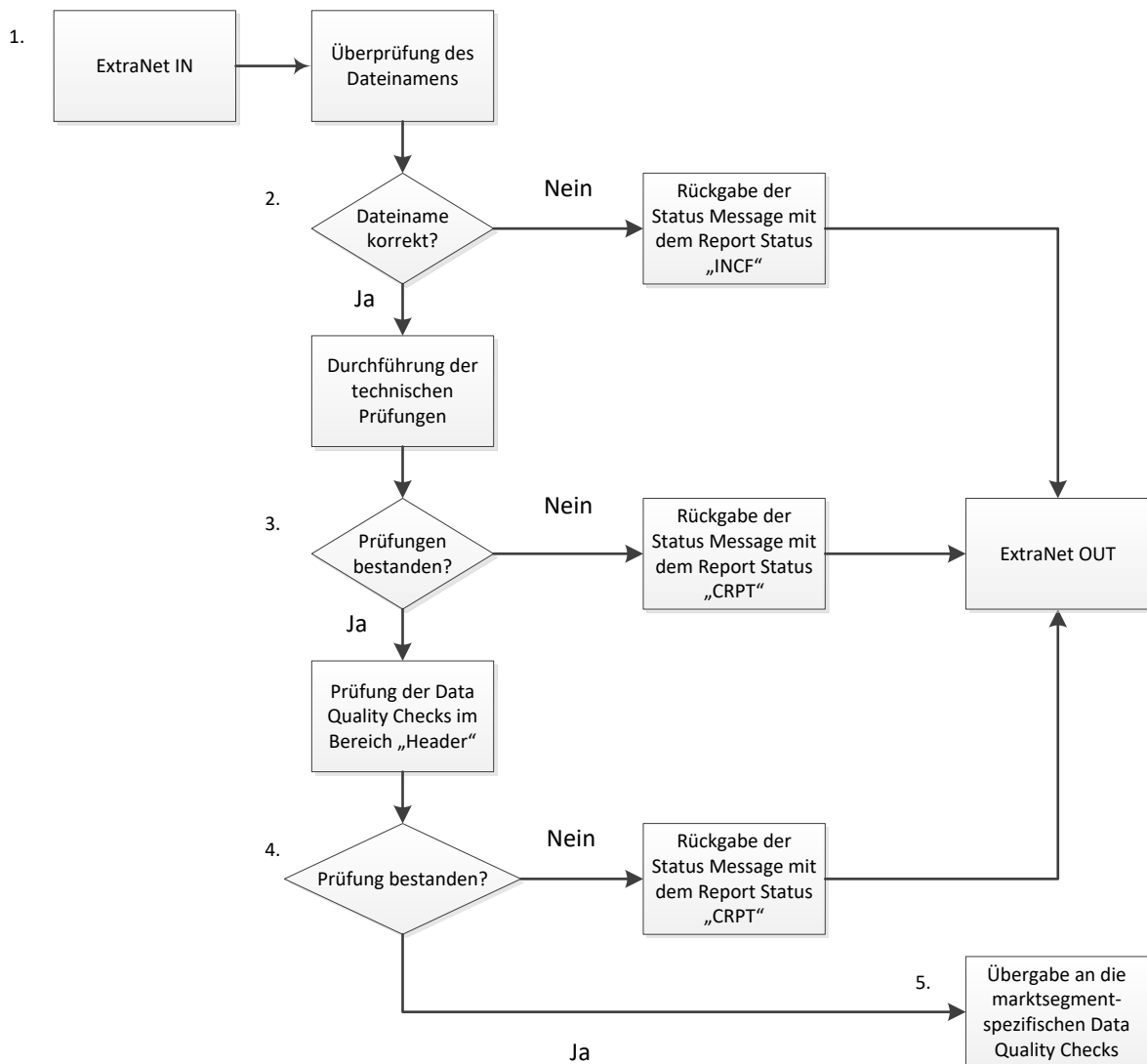
Änderungen zur Vorversion sind in **roter Schrift** gekennzeichnet.

Inhaltsverzeichnis

| | | |
|------------|---|----------|
| 1 | Überprüfung technischer Anforderungen..... | 3 |
| 1.1 | Ablaufdiagramm | 3 |
| 1.2 | Erläuterung..... | 3 |
| 2 | Überprüfung marktsegmentspezifischer Data Quality Checks | 5 |
| 2.1 | Ablaufdiagramm | 5 |
| 2.2 | Erläuterung..... | 5 |
| 3 | Berücksichtigung von Sommer- und Winterzeit..... | 7 |
| 4 | Hinweis zu Korrekturen und Nachlieferungen..... | 7 |
| 5 | Dateinamenkonventionen für Meldungen | 8 |
| 6 | Technische Rahmenbedingungen | 8 |

1 Überprüfung technischer Anforderungen

1.1 Ablaufdiagramm



1.2 Erläuterung

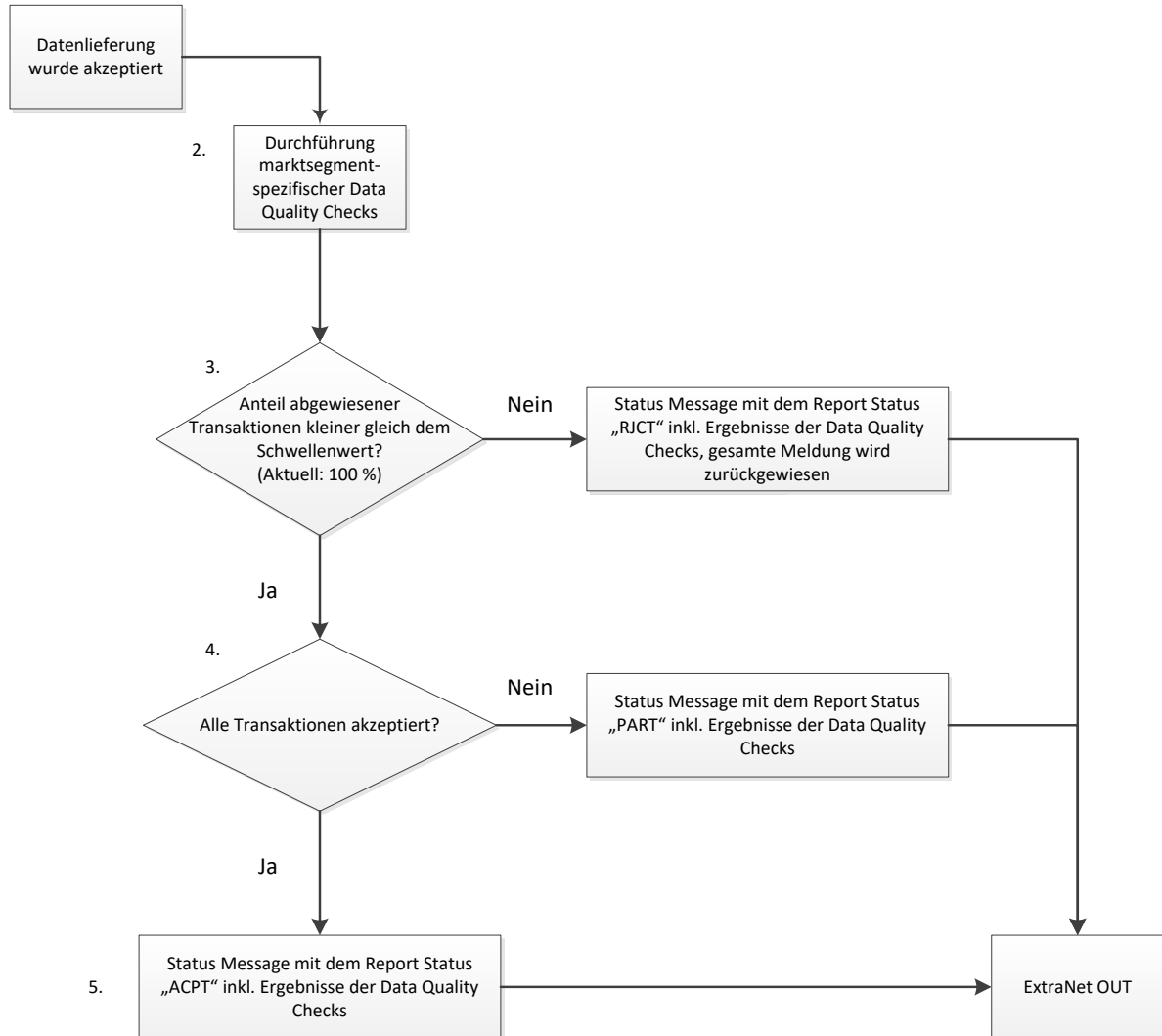
1. Das ExtraNet empfängt die eingereichte Meldung.
2. In einem ersten Schritt wird überprüft, ob der Dateiname der Meldung korrekt ist. Er muss den in Kapitel 5 definierten Dateinamenkonventionen entsprechen. Ist dies nicht der Fall, wird eine Status Message mit dem Report Status „INCF“ (Incorrect Filename) zurückgegeben. Bei einer Nachlieferung müssen alle Transaktionen den gleichen Reported Transaction Status wie in der ursprünglichen Datei besitzen.

3. Im Anschluss werden die technischen Prüfungen durchgeführt. Hierbei wird überprüft, ob die eingereichte Datei fehlerhaft codiert ist, XSD-Fehler oder weitere technische Fehler (siehe Szenario 2a im Dokument „Zusätzliche Informationen zur Status Message“) enthält. Weist die eingereichte Datei technische Fehler auf, wird eine Status Message mit dem Report Status „CRPT“ (Corrupted File) zurückgegeben. Bei einer Nachlieferung müssen alle Transaktionen den gleichen Reported Transaction Status wie in der ursprünglichen Datei besitzen.
4. Weist die eingereichte Datei keine technischen Fehler auf, werden anschließend die Data Quality Checks aus dem Bereich „Header“ durchgeführt. Verletzt die eingereichte Meldung einen oder mehrere Data Quality Checks aus dem Bereich „Header“, wird ebenfalls eine Status Message mit dem Report Status „CRPT“ (Corrupted File) zurückgegeben. Bei einer Nachlieferung müssen alle Transaktionen den gleichen Reported Transaction Status wie in der ursprünglichen Datei besitzen.
5. Liegt eine korrekt formatierte Meldung mit korrektem Dateinamen vor, welche keine Data Quality Checks aus dem Bereich „Header“ verletzt, wird die Meldung, wie in Kapitel 2 dargestellt, den marktsegmentspezifischen Data Quality Checks unterzogen.

2 Überprüfung marktsegment-spezifischer Data Quality Checks

2.1 Ablaufdiagramm

1. (im Anschluss an 5. aus Ablaufdiagramm aus 1.1)



2.2 Erläuterung

1. Eine korrekt formatierte Meldung mit korrektem Dateinamen, welche keine Data Quality Checks aus dem Bereich „Header“ verletzt, liegt vor.
2. Die marktsegment-spezifischen Data Quality Checks werden durchgeführt.
3. Es wird geprüft, ob der Anteil der fehlerhaften Transaktionen an der Gesamtheit der Transaktionen pro Meldung über einem bestimmten Schwellenwert liegt: Ist dies der

Fall, wird eine Status Message mit dem Report Status „RJCT“ (Rejected) zurückgegeben, welche die Ergebnisse der Data Quality Checks fehlerhafter Transaktionen enthält. Dieser Schwellenwert liegt aktuell bei 100 % fehlerhafter Transaktionen, weshalb zum derzeitigen Stand der Report Status RJCT kein mögliches Szenario darstellt. Bei einer Nachlieferung müssen **alle** Transaktionen der zuvor eingereichten Datei enthalten sein. Alle Transaktionen müssen zudem den gleichen Reported Transaction Status wie in der ursprünglichen Datei besitzen.

- Bei Unterschreitung des Schwellenwerts wird geprüft, ob alle Transaktionen akzeptiert werden, d. h. ob keine oder lediglich Data Quality Checks mit der Severity „Warning“ verletzt wurden. Sofern die Meldung teilweise fehlerhafte Transaktionen enthält, wird eine Status Message mit dem Report Status „PART“ (Partially Accepted) zurückgegeben. Die Ergebnisse der Data Quality Checks fehlerhafter Transaktionen sind in der Status Message enthalten. Die geprüften Data Quality Checks finden Sie auf der Homepage der Deutschen Bundesbank unter folgendem Link: http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Standardartikel/Service/Meldewesen/geldm_arktstatistik.html.

Korrigierte Transaktionen müssen den Reported Transaction Status „CORR“ erhalten.

Bitte berücksichtigen Sie folgende Besonderheit bei der Korrektur des Feldes „interne Transaktionskennung (PTI)“:

Eine ~~nicht-taggleich~~ ausgeführte Korrektur einer falsch angegebenen internen Transaktionskennung (PTI) ist nur über eine entsprechende Cancellation „CANC“ und Neumeldung „NEWT“ möglich, da eine Änderung mittels „CORR“ oder „AMND“ bei Angabe einer anderen PTI nicht dem Ursprungsgeschäft zugeordnet werden kann. Eine Cancellation betrifft dabei generell alle Transaktionen, welche die PTI der Cancellation aufweisen.

Sofern eine Meldung mehrere Transaktionen mit derselben PTI beinhaltet, ist auch in diesem Fall eine Korrektur betroffener Transaktionen nur über eine Cancellation „CANC“ - dabei werden alle Transaktionen dieser PTI gelöscht - und entsprechender Neumeldung „NEWT“ möglich.

Beispiel:

| | | | |
|-----|------|-------|---|
| T | NEWT | PTI 1 | RJCT wegen doppelter PTI |
| | NEWT | PTI 1 | RJCT wegen doppelter PTI |
| | NEWT | PTI 1 | RJCT wegen doppelter PTI |
| T+1 | CANC | PTI 1 | Alle Transaktionen mit PTI 1 werden gelöscht. |

Alle Transaktionen müssten ggf. erneut mit je einer neuen PTI eingereicht werden.

Dabei ist zu beachten, dass eine PTI mit dem Status „CANC“ nicht für andere Transaktionen wiederverwendet werden kann.

- Sind in einer Meldung alle Transaktionen korrekt ausgewiesen oder beinhalten lediglich Warnings, wird eine Status Message mit dem Report Status „ACPT“ (Accepted) zurückgegeben.

3 Berücksichtigung von Sommer- und Winterzeit

Im Rahmen der Geldmarktstatistik ist für sämtliche in Lokalzeit zu meldenden *DateTime* Formate („Reference Period“ und „Trade Date“) der Zeitabstand zur UTC/GMT-Zeit („...+hh:mm“) entsprechend der Sommer- bzw. Winterzeit anzupassen.

Demzufolge ist für eine Transaktion, welche um 15.00 Uhr deutscher **Winterzeit** getätigt wurde, folgendes *DateTime* Format für das Feld Trade Date anzugeben: „yyyy-mm-ddT15:00:00+01:00“.

Eine Transaktion, welche um 15.00 Uhr deutscher **Sommerzeit** getätigt wurde, ist hingegen wie folgt auszuweisen: „yyyy-mm-ddT15:00:00+02:00“.

Des Weiteren möchten wir Sie darauf hinweisen, dass eine nicht an Sommer- bzw. Winterzeit angepasste Reference Period in folgendem Fallbeispiel zum Abweisen der gesamten Meldung mit Report Status CRPT führt:

Referenztag der Meldung: 01.04.2016 (Sommerzeit)
Reference Period End: „2016-04-01T23:59:59+01:00“

Das angegebene Ende der Reference Period entspricht nach Umrechnung in deutsche Lokalzeit (Sommerzeit) 00:59:59 Uhr am 02.04.2016 und wird dementsprechend aufgrund des technischen Checks "REFERENCE_PERIOD" mit dem Report Status CRPT abgewiesen. Die korrekte Angabe für das Feld Reference Period End wäre in diesem Fall "2016-04-01T23:59:59+02:00".

4 Hinweis zu Korrekturen und Nachlieferungen

Sowohl Korrekturen, ~~welche nicht taggleich (bis 6:30 Uhr am Folgetag) durchgeführt werden,~~ als auch Nachlieferungen sind generell in die reguläre Meldung des darauffolgenden Tages zu integrieren. Dabei ist es unerheblich, ob es sich um einzelne Transaktionen oder ein gesamtes Marktsegment handelt. Bitte beachten Sie, dass der technische Check REFERENCE_PERIOD (dargestellt im Dokument „Zusätzliche Informationen zur Status Message“) eine Einreichung von Meldungen für einen anderen Tag als den Referenztag verhindert. Eine Nachlieferung für vergangene Tage würde demnach mit dem Report Status CRPT abgewiesen werden.

Zur Verdeutlichung folgendes Beispiel:

| Transaktionen | Ref. Period End | Marktsegment | Versand | Report Status |
|---------------|-----------------|-----------------|------------------|---------------|
| von Tag T | Tag T | auth.012.001.02 | bis 6:30 Uhr T+1 | ACPT |
| von Tag T | Tag T | auth.013.001.02 | bis 6:30 Uhr T+1 | ACPT |
| von Tag T | Tag T | auth.014.001.02 | Nicht versendet | n/a |
| von Tag T | Tag T | auth.015.001.02 | bis 6:30 Uhr T+1 | CRPT |

Nachlieferung für Marktsegment „auth.014.001.02“ und „auth.015.001.02“:

Variante A

| | | | | |
|-----------|-------|-----------------|---------------|------|
| von Tag T | Tag T | auth.014.001.02 | 10:00 Uhr T+1 | CRPT |
| von Tag T | Tag T | auth.015.001.02 | 10:00 Uhr T+1 | CRPT |

Variante B

| | | | | |
|-----------------|---------|-----------------|------------------|------|
| von Tag T & T+1 | Tag T+1 | auth.014.001.02 | bis 6:30 Uhr T+2 | ACPT |
| von Tag T & T+1 | Tag T+1 | auth.015.001.02 | bis 6:30 Uhr T+2 | ACPT |

Diese Besonderheit gilt lediglich für die Produktivumgebung. Auf der Testumgebung kann zu Testzwecken weiterhin für alle Tage ab dem 5. Januar 2016 eingereicht werden.

5 Dateinamenkonventionen für Meldungen

Bitte verwenden Sie für die Einreichung von Dateien zur Geldmarktstatistik die folgenden Dateinamenkonventionen:

"Marktsegment"."LEI"."Datum"."fortlaufende Nummer"

(z.B.: auth.012.001.02.7LTWFZYICNSX8D621K86.20160701.0001)

Die Bezeichnungen der Marktsegmente lauten (15 Stellen):

- „auth.012.001.02“ für den besicherten Geldmarkt
- „auth.013.001.02“ für den unbesicherten Geldmarkt
- „auth.014.001.02“ für FX Swaps
- „auth.015.001.02“ für EONIA-Swaps

Der LEI entspricht dem LEI des berichtspflichtigen Instituts, nicht des Einreichers (20 Stellen).

Das Datum hat den Aufbau „JJJJMMTT“ und entspricht dem Handelstag (8 Stellen).

Die fortlaufende Nummer beginnt pro Marktsegment täglich mit „0001“ (4 Stellen).

Eine Dateiendung ist **nicht** anzufügen.

6 Technische Rahmenbedingungen

Weiterhin bitten wir Sie, Dateien ab einer **Dateigröße von 10 MB** (ungezippt) ausschließlich als Archiv in Form einer **.zip-Datei** einzureichen. Der Dateiname sollte dabei den oben dargestellten Konventionen entsprechen (einziger Unterschied ist die in diesem Fall enthaltene

Dateiendung „.zip“). Die XML-Datei innerhalb des Archives darf auch in diesem Fall keine Dateiendung enthalten. Bitte berücksichtigen Sie, dass in jedem Archiv nur eine einzige XML-Datei enthalten sein darf, d. h. pro Tag sind weiterhin vier Dateien (je eine Datei pro Marktsegment, ggf. zuzüglich taggleicher Korrekturen) einzureichen.

Für Dateien mit einer Dateigröße kleiner als 10 MB ist es Ihnen freigestellt, die Meldung als Archiv in Form einer .zip-Datei oder als XML-Datei (ohne Dateiendung) einzureichen. Aus Sicht der Deutschen Bundesbank wird jedoch eine Einreichung als .zip bevorzugt.

Zudem weisen wir Sie darauf hin, dass als Status (Business Service) der eingereichten Dateien „ECB_MMSR_TEST“ ausschließlich verwendet werden soll, um den Übertragungsweg zu testen. Auf derart gekennzeichnete Meldungen werden keine Data Quality Checks angewandt.

Falls die eingereichten Dateien inhaltlich geprüft und weiterverarbeitet werden sollen, muss der Status „ECB_MMSR_PROD“ verwendet werden.

Zentralbereich Statistik
Abteilung Wertpapier- und Geldmarktstatistiken
Geldmarktstatistik-Hotline: 069 9566-7630