DEUTSCHE BUNDESBANK
EUROSYSTEM

Informationen zur Einreichung von Meldungen (Geldmarktstatistik)

Gültig ab: 18.11.2026

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 QualityChecks 5
2.1 Ablaufdiagramm..... 5
2.2 Erläuterung..... 5

3 Berücksichtigung von Sommer- und Winterzeit 7

4 Hinweis zu Korrekturen und Nachlieferungen 7

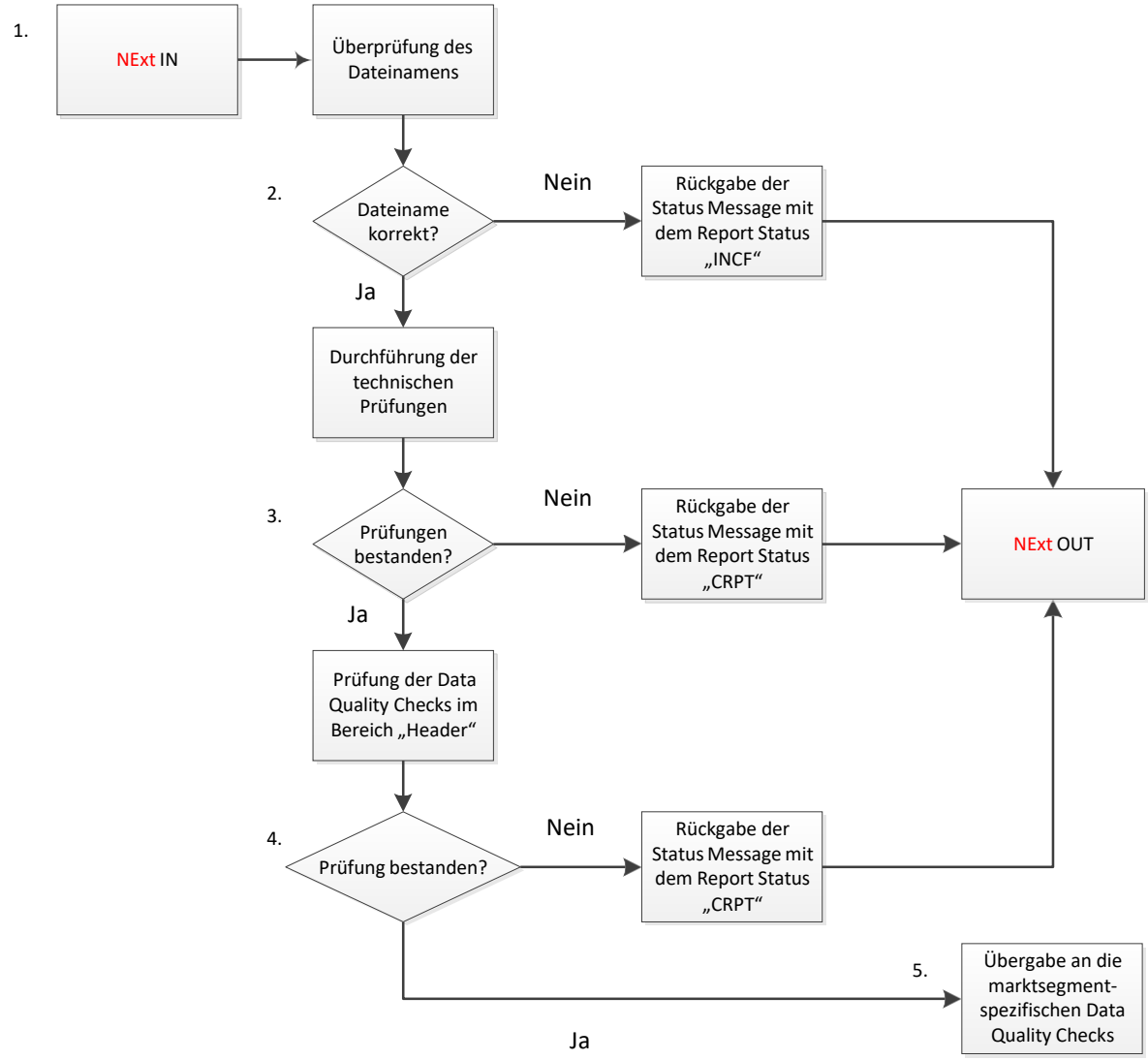
5 Hinweise zur Einreichung mehrerer Meldungen für den selben Referenztag 8

6 Dateinamenkonventionen für Meldungen 9

7 Technische Rahmenbedingungen 9

1 Überprüfung technischer Anforderungen

1.1 Ablaufdiagramm



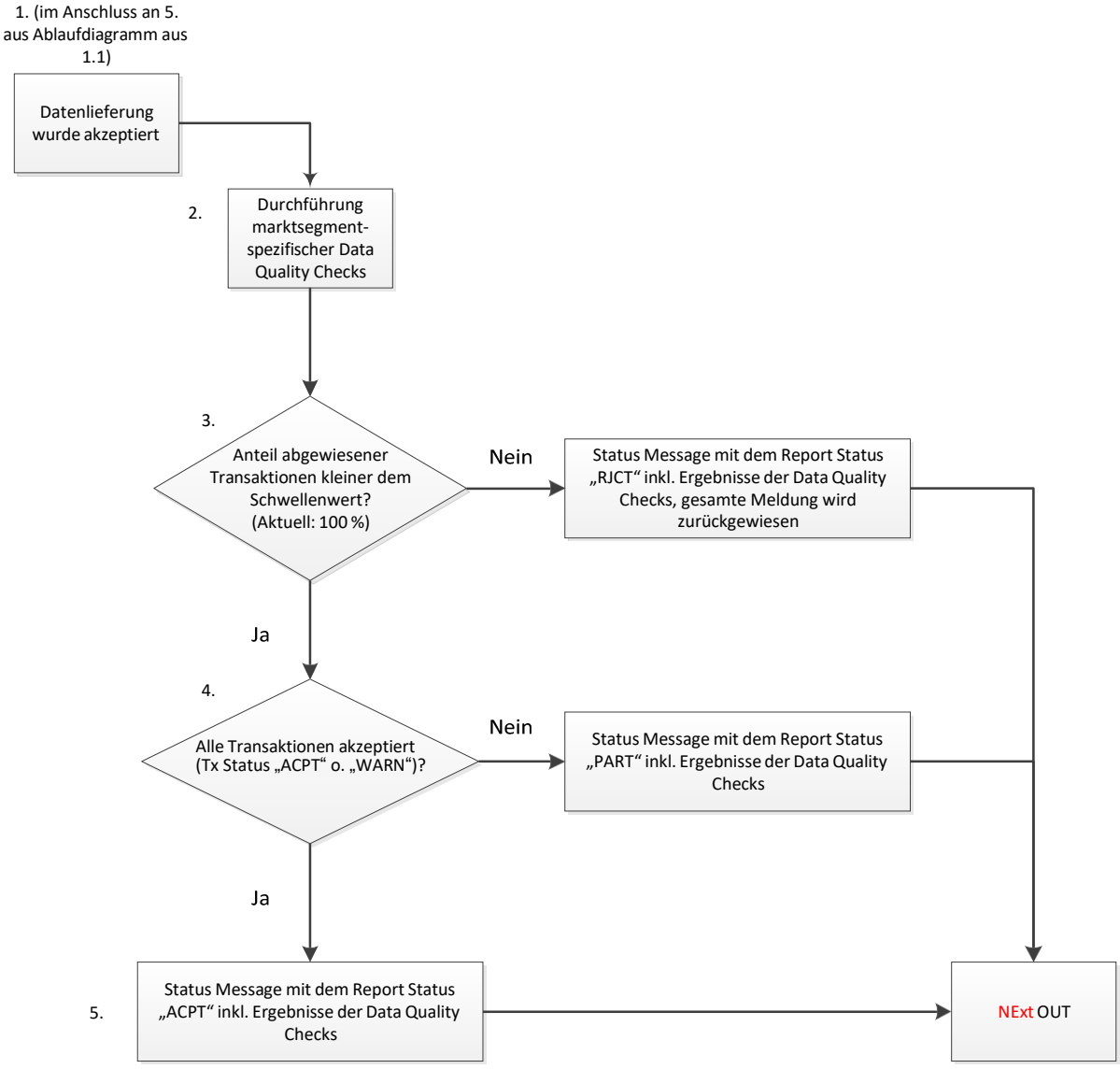
1.2 Erläuterung

1. NExt 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, da in diesem Fall die gemeldeten Transaktionen nicht von der Bundesbank gelesen und entsprechend auch nicht verarbeitet werden konnten.

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, da in diesem Fall die gemeldeten Transaktionen nicht von der Bundesbank gelesen und entsprechend auch nicht verarbeitet werden konnten.
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 mit der Severity „Error“ aus dem Bereich „Header“, wirdebenfalls 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 mit der Severity „Error“ aus dem Bereich „Header“ verletzt, wird die Meldung, wie in Kapitel 2 dargestellt, den marktsegmentspezifischen Data Quality Checks unterzogen.

2 Überprüfung marktsegmentspezifischer Data Quality Checks

2.1 Ablaufdiagramm



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 marktsegmentspezifischen Data Quality Checks werden durchgeführt.
3. Es wird geprüft, ob der Anteil der fehlerhaften Transaktionen an der Gesamtheit der Transaktionen pro Meldung gleich oder 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. 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, da in diesem Fall die gemeldeten Transaktionen nicht von der Bundesbank gelesen und entsprechend auch nicht verarbeitet werden konnten.

4. 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: Geldmarktstatistik | Deutsche Bundesbank.

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

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

   Die 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 der PTI betroffener Transaktionen nur über eine Cancellation „CANC“ – dabei werden alle Transaktionen dieser PTI storniert – 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.

5. Sind in einer Meldung alle Transaktionen korrekt ausgewiesen oder beinhalten lediglich Warnings (Transaction Status „ACPT“ oder „WARN“), 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**“.

4 Hinweis zu Korrekturen und Nachlieferungen

Sowohl Korrekturen als auch Nachlieferungen können entweder in eine eigene (auch taggleiche) Meldung oder in die reguläre Meldung des darauffolgenden Tages integriert werden. Dabei ist es unerheblich, ob es sich um einzelne Transaktionen oder ein gesamtes Marktsegment handelt.

Sehen Sie nachfolgendes **Beispiel** zur Verdeutlichung der Möglichkeiten zur Korrektur von Transaktionen sowie der Nachlieferung von Transaktionen und Meldungen.

Einreichung der Meldungen für Tag T:

Transaktionen	Marktsegment	Versand	Report Status
NEWT von Tag T	auth.012.001.02	T+1 04:30 Uhr	ACPT
NEWT von Tag T	auth.013.001.02	T+0 19:30 Uhr	PART
NEWT von Tag T	auth.014.001.02	Nicht versendet	n/a
NEWT von Tag T	auth.015.001.02	T+0 22:15 Uhr	CRPT

Nachlieferungen für Marktsegment „auth.012.001.02“, „auth.014.001.02“ und „auth.015.001.02“ sowie Korrekturen für Marktsegment „auth.013.001.02“:

Variante A
(taggleiche Nachlieferung und Korrektur)

weitere NEWT von Tag T	auth.012.001.02	T+1 06:00 Uhr	ACPT
CORR für NEWT von Tag T	auth.013.001.02	T+1 06:00 Uhr	ACPT
NEWT von Tag T	auth.014.001.02	T+1 08:30 Uhr	ACPT
NEWT von Tag T	auth.015.001.02	T+0 23:00 Uhr	ACPT

Variante B
(Nachlieferung und Korrektur mit regulärer Meldung des darauffolgenden Handelstags)

weitere NEWT von Tag T + NEWT von Tag T+1	auth.012.001.02	T+2 04:30 Uhr	ACPT
CORR für NEWT von Tag T + NEWT von Tag T+1	auth.013.001.02	T+1 19:30 Uhr	ACPT
NEWT von Tag T + NEWT von Tag T+1	auth.014.001.02	T+2 02:45 Uhr	ACPT
NEWT von Tag T + NEWT von Tag T+1	auth.015.001.02	T+1 22:15 Uhr	ACPT

5 Hinweise zur Einreichung mehrerer Meldungen für den selben Referenztag

Grundsätzlich sind alle berichtspflichtigen Transaktionen eines Referenztages gesammelt in einer Meldung je Marktsegment und Institut einzureichen. Ausnahmen hiervon stellen folgende **Beispiele** dar:

- Korrekturmeldungen im Rahmen von strukturellen Meldeproblemen bzw. von abgewiesenen Transaktionen unabhängig von der regulären Meldung
- verspätete Meldungen, welche unabhängig der Einreichungsfrist eingereicht werden
- taggleiche Nachmeldung initial fehlender Transaktionen
- [insbesondere für **€STR-relevante Transaktionen**] Teileinreichungen am Vorabend

Das kontinuierliche Melden von Einzeltransaktionen im Laufe des Tages (**tick-by-tick reporting**) ist **nicht zulässig**.

Sofern für einen Referenztag mehrere Meldungen eingereicht werden ist zu beachten, dass alle weiteren Meldungen **ergänzend zu vorher eingegangenen akzeptierten Meldungen („ACPT“, „PART“, siehe Kapitel 2 und 3) verarbeitet** werden. Entsprechend darf bei mehrfacher Einreichung lediglich das Delta an Transaktionen in den nachfolgenden Meldungen enthalten sein. Es findet kein Überschreiben von (teilweise) akzeptierten Meldungen für denselben Referenztag statt.

Beispiel: Werden bis 7:00 Uhr an Tag T+1 zwei Meldungen mit derselben PTI und dem Reported Transaction Status „NEWT“ eingereicht, wird diese PTI bei der zweiten Einreichung abgewiesen (Transaction Status = „RJCT“).

Um bei mehrfacher Einreichung die **richtige Reihenfolge** der eingegangenen Meldungen zu gewährleisten, dürfen weitere Meldungen frühestens nach Erhalt der Status Message (fachliche Quittung der Geldmarktstatistik) oder nach einer Wartezeit von 30 Minuten eingereicht werden. Die weiteren Meldungen müssen außerdem zwingend über einen **eindeutigen Business Message Identifier** sowie eine **laufende Nummer im Dateinamen** verfügen.

Beispiel:

Lfd. Nr. der Meldungen	Business Message Identifier	Lfd. Nr. im Dateinamen
1	13_2024_05_02_a	.0001
2	13_2024_05_02_b	.0002

Um eine Überlastung der Systeme zu verhindern, lässt der **technische Check "MAX_REPORTS"** im Zeitraum von 7:00 bis 18:00 Uhr maximal 20 (teilweise) akzeptierte Meldungen und von 18:00 bis 7:00 Uhr maximal 5 (teilweise) akzeptierte Meldungen je Marktsegment und berichtspflichtigem Institut zu. Darüber hinaus bitten wir, während des Wartungsfensters täglich zwischen 9:30 und 12:00 Uhr von der Einreichung von Meldungen abzusehen.

6 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 Overnight Index-Swaps

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

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

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

Eine Dateiendung ist **nicht** anzufügen.

7 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 Daten und Statistik
Geldmarktstatistik-Hotline: 069 9566-37630