

1. September 2016
Final Version 1.1

Money Market Statistical Reporting

ADDITIONAL DATA QUALITY CHECKS

1. Additional Data Quality Checks applicable to the Secured segment					
Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Description	Data Quality Check Beschreibung	Error severity	Data action
ADQS100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] / COLLATERAL NOMINAL AMOUNT [COLLATERAL NOMINAL AMOUNT value] is higher than 10	Der Quotient aus NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] und NENNWERT DER SICHERHEIT [NENNWERT DER SICHERHEIT Wert] ist höher als 10 .	Warning	no data action
ADQS101		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] / COLLATERAL NOMINAL AMOUNT [COLLATERAL NOMINAL AMOUNT value] is lower than 0.1	Der Quotient aus NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] und NENNWERT DER SICHERHEIT [NENNWERT DER SICHERHEIT Wert] ist niedriger als 0,1 .	Warning	no data action
ADQS102		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 10,000,000,000 5,000,000,000 and lower than or equal to 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 10.000.000.000 5.000.000.000 und niedriger als oder gleich 20.000.000.000 .	Warning	no data action
ADQS103		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist niedriger als 1.000 .	Warning	no data action
ADQS104		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 20.000.000.000 .	Error	reject transaction
ADQS200	DEAL RATE	DEAL RATE [DEAL RATE value] is higher than ECB Marginal Lending Facility Rate [ECB Marginal Lending Facility Rate value] + 5,0 20.0 percentage points	Der ZINSSATZ DER TRANSAKTION [ZINSSATZ DER TRANSAKTION Wert] ist höher als der Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB [Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB Wert] + 5,0 20,0 Prozentpunkte .	Warning	no data action
ADQS201		DEAL RATE [DEAL RATE value] is lower than ECB Deposit Facility Rate [ECB Deposit Facility Rate value] – 5.0 percentage points	Der ZINSSATZ DER TRANSAKTION [ZINSSATZ DER TRANSAKTION Wert] ist niedriger als der Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB [Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB Wert] - 5,0 Prozentpunkte .	Warning	no data action
ADQS300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database (https://www.gleif.org/en)	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden (https://www.gleif.org/en).	Warning	no data action

Hinweis: Bitte beachten Sie, dass alle Schwellenwerte (hervorgehoben in **fett** und **rot/blau**) den aktuellen Implementierungsstand darstellen, jedoch bei Bedarf angepasst werden können.

Hinweis: Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB (Stand: 16. März 2016) = 0.25%

Hinweis: Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB (Stand 16. März 2016) = –0.40%

Hinweis: Beim NENNWERT DER SICHERHEIT in ADQS100 und ADQS101 handelt es sich um die Summe der Nennwerte aller hinterlegten Sicherheiten, sofern Transaktionen mit mehr als einer Sicherheit besichert sind.

2. Additional Data Quality Checks applicable to the Unsecured segment					
Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Description	Data Quality Check Beschreibung	Error severity	Data action
ADQU100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 10,000,000,000 5,000,000,000 and lower than or equal to 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 10.000.000.000 5.000.000.000 und niedriger als oder gleich 20.000.000.000 .	Warning	no data action
ADQU101		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist niedriger als 1.000 .	Warning	no data action
ADQU102		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 20.000.000.000 .	Error	reject transaction
ADQU200	DEAL RATE	DEAL RATE [DEAL RATE value] is higher than ECB Marginal Lending Facility Rate [ECB Marginal Lending Facility Rate value] + 5.0 percentage points	Der ZINSSATZ DER TRANSAKTION [ZINSSATZ DER TRANSAKTION Wert] ist höher als der Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB [Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB Wert] + 5,0 Prozentpunkte .	Warning	no data action
ADQU201		DEAL RATE [DEAL RATE value] is lower than ECB Deposit Facility Rate [ECB Deposit Facility Rate value] – 5.0 percentage points	Der ZINSSATZ DER TRANSAKTION [ZINSSATZ DER TRANSAKTION Wert] ist niedriger als der Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB [Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB Wert] - 5,0 Prozentpunkte .	Warning	no data action
ADQU300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database (https://www.gleif.org/en)	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden (https://www.gleif.org/en).	Warning	no data action

Hinweis: Bitte beachten Sie, dass alle Schwellenwerte (hervorgehoben in **fett** und **rot/blau**) den aktuellen Implementierungsstand darstellen, jedoch bei Bedarf angepasst werden können.

Hinweis: Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB (Stand: 16. März 2016) = 0.25%

Hinweis: Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB (Stand 16. März 2016) = –0.40%

3. Additional Data Quality Checks applicable to the FX Swap segment

Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Description	Data Quality Check Beschreibung	Error severity	Data Action
ADQF100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 10,000,000,000 5,000,000,000 and lower than or equal to 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 10.000.000.000 5.000.000.000 und niedriger als oder gleich 20.000.000.000 .	Warning	no data action
ADQF101		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist niedriger als 1.000 .	Warning	no data action
ADQF102		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 20.000.000.000 .	Error	reject transaction
ADQF200	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE [FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE value] is higher than [Official exchange rate for the currency pair for the particular day as announced by the ECB] * 1.5	Der DEISENKASSAKURS [DEISENKASSAKURS Wert] ist höher als [von der EZB für den jeweiligen Tag veröffentlichter Wechselkurs des betreffenden Währungspaares] * 1,5 .	Warning	no data action
ADQF201		FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE [FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE value] is lower than [Official exchange rate for the currency pair for the particular day as announced by the ECB] * 0.5	Der DEISENKASSAKURS [DEISENKASSAKURS Wert] ist niedriger als [von der EZB für den jeweiligen Tag veröffentlichter Wechselkurs des betreffenden Währungspaares] * 0,5 .	Warning	no data action
ADQF300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database (https://www.gleif.org/en)	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden (https://www.gleif.org/en).	Warning	no data action

Hinweis: Bitte beachten Sie, dass alle Schwellenwerte (hervorgehoben in **fett** und **rot/blau**) den aktuellen Implementierungsstand darstellen, jedoch bei Bedarf angepasst werden können.

4. Additional Data Quality Checks applicable to the OIS segment					
Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Description	Data Quality Check Beschreibung	Error severity	Data Action
ADQO100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 10,000,000,000 5,000,000,000 and lower than or equal to 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 10.000.000.000 5.000.000.000 und niedriger als oder gleich 20.000.000.000 .	Warning	no data action
ADQO101		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist niedriger als 1.000 .	Warning	no data action
ADQO102		TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 20,000,000,000	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 20.000.000.000 .	Error	reject transaction
ADQO200	FIXED INTEREST RATE	FIXED INTEREST RATE [FIXED INTEREST RATE value] is higher than ECB Marginal Lending Facility Rate [ECB Marginal Lending Facility Rate value] + 5.0 percentage points	Der FESTE ZINSSATZ [FESTER ZINSSATZ Wert] ist höher als der Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB [Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB Wert] + 5,0 Prozentpunkte .	Warning	no data action
ADQO201		FIXED INTEREST RATE [FIXED INTEREST RATE value] is lower than ECB Deposit Facility Rate [ECB Deposit Facility Rate value] – 5.0 percentage points	Der FESTE ZINSSATZ [FESTER ZINSSATZ Wert] ist niedriger als der Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB [Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB Wert] - 5,0 Prozentpunkte .	Warning	no data action
ADQO300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database (https://www.gleif.org/en)	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden (https://www.gleif.org/en).	Warning	no data action

Hinweis: Bitte beachten Sie, dass alle Schwellenwerte (hervorgehoben in **fett** und **rot/blau**) den aktuellen Implementierungsstand darstellen, jedoch bei Bedarf angepasst werden können.

Hinweis: Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB (Stand: 16. März 2016) = 0.25%

Hinweis: Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB (Stand 16. März 2016) = –0.40%