



**EUROPEAN CENTRAL BANK**  
**EUROSYSTEM**

Directorate General Statistics

**ECB-UNRESTRICTED**

4 June 2024

Version 3.2

# Money Market Statistical Reporting

## ADDITIONAL DATA QUALITY CHECKS

Valid from 01/07/2024

## 1. Additional Data Quality Checks applicable to the Secured segment

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

**Note:** The COLLATERAL NOMINAL AMOUNT in ADQS100 and ADQS101 takes into account the total sum of the nominal amount of all pieces of collateral in case of transactions with more than one collateral pledged

## 2. Additional Data Quality Checks applicable to the Unsecured segment

Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Beschreibung	Data Quality Check Description	Error severity	Data action
ADQU100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als 5.000.000.000 und niedriger als oder gleich <b>15.000.000.000</b> .	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than 5,000,000,000 and lower than or equal to <b>15,000,000,000</b>	Warning	no data action
ADQU101		Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] beträgt weniger als 1.000.	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Warning	no data action
ADQU102		Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als <b>15.000.000.000</b> .	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than <b>15,000,000,000</b>	Error	reject transaction
ADQU200	DEAL RATE	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.	DEAL RATE [DEAL RATE value] is higher than ECB Marginal Lending Facility Rate [ECB Marginal Lending Facility Rate value] + 5.0 percentage points	Warning	no data action
ADQU201		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.	DEAL RATE [DEAL RATE value] is lower than ECB Deposit Facility Rate [ECB Deposit Facility Rate value] – 5.0 percentage points	Warning	no data action
ADQU300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden ( <a href="https://www.gleif.org/en">https://www.gleif.org/en</a> ).	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database ( <a href="https://www.gleif.org/en">https://www.gleif.org/en</a> )	Warning	no data action

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

Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Beschreibung	Data Quality Check Description	Error severity	Data Action
ADQF100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als <b>12.000.000.000</b> und niedriger als oder gleich <b>45.000.000.000</b> .	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than <b>12,000,000,000</b> and lower than or equal to <b>45,000,000,000</b>	Warning	no data action
ADQF101		Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] beträgt weniger als 1.000.	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Warning	no data action
ADQF102		Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als <b>45.000.000.000</b> .	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than <b>45,000,000,000</b>	Error	reject transaction
ADQF200	FOREIGN EXCHANGE SPOT RATE	Der DEISENKASSAKURS [DEISENKASSAKURS Wert] ist höher als [von der EZB für den jeweiligen Tag veröffentlichter Wechselkurs des betreffenden Währungspaares] * 1,5.	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	Warning	no data action
ADQF201		Der DEISENKASSAKURS [DEISENKASSAKURS Wert] ist niedriger als [von der EZB für den jeweiligen Tag veröffentlichter Wechselkurs des betreffenden Währungspaares] * 0,5.	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	Warning	no data action
ADQF300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden ( <a href="https://www.gleif.org/en">https://www.gleif.org/en</a> ).	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database ( <a href="https://www.gleif.org/en">https://www.gleif.org/en</a> )	Warning	no data action

#### 4. Additional Data Quality Checks applicable to the OIS segment

Data Quality Check Identifier	Field name	Data Quality Check Beschreibung	Data Quality Check Description	Error severity	Data Action
ADQO100	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT	Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als <b>30.000.000.000</b> und niedriger als oder gleich <b>300.000.000.000</b> .	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than <b>30,000,000,000</b> and lower than or equal to <b>300,000,000,000</b>	Warning	no data action
ADQO101		Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] beträgt weniger als 1.000.	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is lower than 1,000	Warning	no data action
ADQO102		Der NENNWERT DER TRANSAKTION [NENNWERT DER TRANSAKTION Wert] ist höher als <b>300.000.000.000</b> .	TRANSACTION NOMINAL AMOUNT [TRANSACTION NOMINAL AMOUNT value] is higher than <b>300,000,000,000</b>	Error	reject transaction
ADQO200	FIXED INTEREST RATE	Der FESTE ZINSSATZ [FESTER ZINSSATZ Wert] ist höher als der Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB [Zinssatz der Spitzenrefinanzierungsfazilität der EZB Wert] + 5,0 Prozentpunkte.	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	Warning	no data action
ADQO201		Der FESTE ZINSSATZ [FESTER ZINSSATZ Wert] ist niedriger als der Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB [Zinssatz der Einlagenfazilität der EZB Wert] - 5,0 Prozentpunkte.	FIXED INTEREST RATE [FIXED INTEREST RATE value] is lower than ECB Deposit Facility Rate [ECB Deposit Facility Rate value] – 5.0 percentage points	Warning	no data action
ADQO300	COUNTERPARTY IDENTIFICATION	Der für die GEGENPARTEI angegebene LEI [GEGENPARTEI Wert] ist nicht in der Referenzdatenbank vorhanden ( <a href="https://www.gleif.org/en">https://www.gleif.org/en</a> ).	COUNTERPARTY IDENTIFICATION [COUNTERPARTY IDENTIFICATION value] is present and does not exist in the LEI referential database ( <a href="https://www.gleif.org/en">https://www.gleif.org/en</a> )	Warning	no data action