

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (1/4)

- Bei den ITS-Erhebungen gibt es grundsätzlich zwei verschiedene Optionen bei den zu übermittelnden Templates an die EZB:
 - Expected Template: Wird bei jeder Übermittlung erwartet (periodenabhängig)
 - Optional Template: Ist von bestimmten Ereignissen bzw. Aktivitäten abhängig (z.B. Schwellenprüfung)

- Daher werden die Filing Indicators für die Übermittlung an die EZB benötigt.

- Aufgrund der Unterscheidung „expected“ und „optional“, gibt es für das Prüfkonzept des Filing Indicator zwei verschiedene Prüfregelarten beim Eingang der Meldung.

- Diese Prüfregelarten werden als Formalprüfungen (= zurückweisend) definiert.

- Nicht alle Melder stellen sofort auf das System mit den Filing Indicator um, daher wird bis Q2/2018 eine Übergangslösung benötigt.

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (2/4)

- Keine Auswirkungen bei Leermeldungen.
- Meldeschwellenprüfung wird vorübergehend nicht zum Prüfen/Setzen der Filing Indicators herangezogen. Sobald ein Wert in einem meldeschwellenabhängigen Template gemeldet wird, muss der Filing Indicator auf „J“ gesetzt werden.
 - Es werden immer alle Prüfregeln ausgeführt, welche sich auf das Template beziehen.
- Sollte ein Template als „expected“ bei der EZB definiert sein und es gibt hierfür aber keine Geschäfte, muss nur eine der ausgewählten Positionen aus der Prüfregel mit dem Wert „0“ befüllt werden.
- Die folgende Szenarien sind für die Übergangslösung möglich:

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (3/4)

Szenario 1:

Melder übermittelt alle notwendigen Filing Indicators mit „J“ oder „N“:

- Überprüfung, ob der gemeldete Filing Indicator mit den gemeldet Werten zusammenpasst.
 - Keine Rückfrage:
 - Filing Indicator = J, Werte sind vorhanden
 - Filing Indicator = N, Wert sind nicht vorhanden (**ACHTUNG: auch „0“ ist ein Wert**)
 - Rückfrage
 - Filing Indicator = N, Werte sind vorhanden
 - Filing Indicator = J, Werte sind nicht vorhanden

Zusätzliche Prüfung bei einem expected Template:

- Bei den expected Template wird überprüft, ob der Filing Indicator auf „J“ gesetzt ist.
- Sollten keine Werte vorhanden sein, dann muss die Zahl „0“ **in nur einer** der vorkommenden Positionen in der Prüfregel gemeldet werden. Damit wird bestätigt, dass es hier keine Geschäfte gibt.

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (4/4)

Szenario 2:

Melder übermittelt keinen Filing Indicator:

- Der Filing Indicator wird aufgrund der gemeldeten Werte gesetzt/automatisch berechnet.

Zusätzliche Prüfung bei einem expected Template:

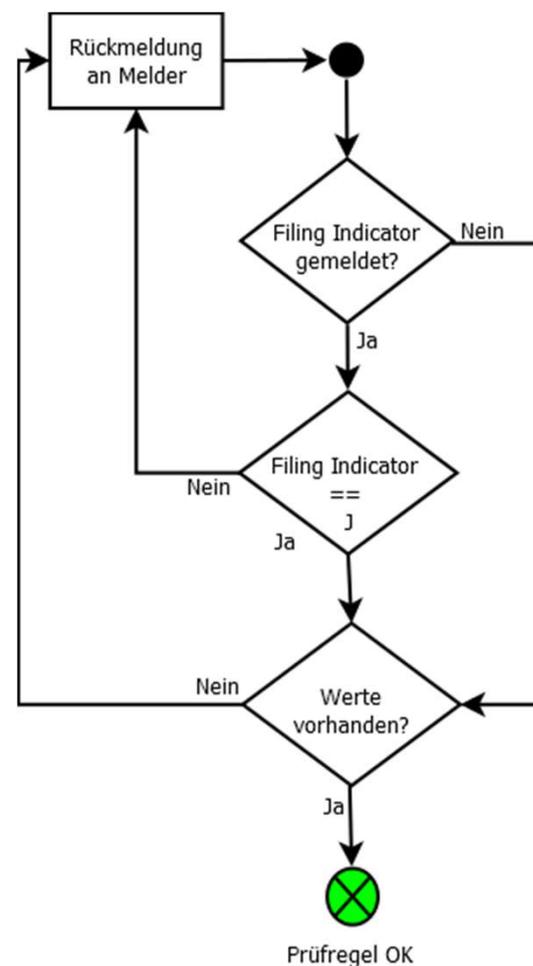
- Bei den expected Templates wird zusätzlich mittels eine Prüfregel überprüft, ob der Melder bestimmte Konzepte befüllt hat.
- Sollten keine Werte bei den expected Templates vorhanden sein, dann muss die Zahl „0“ **in nur einer** der vorkommenden Positionen in der Prüfregel gemeldet werden. Damit wird bestätigt, dass es hier keine Geschäft gibt.

Aufbau der Prüfung für Filing Indicator anhand eines Beispiels (1/2)

- **Prüfung während der Übergangslösung für „expected“ Templates:**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0101>),
  ifElse(
    <ISFINF0101> == "J",
    !isNa(<ISFIN1000000>),
    false
  ),
  !isNa(<ISFIN1000000>)
)
  
```



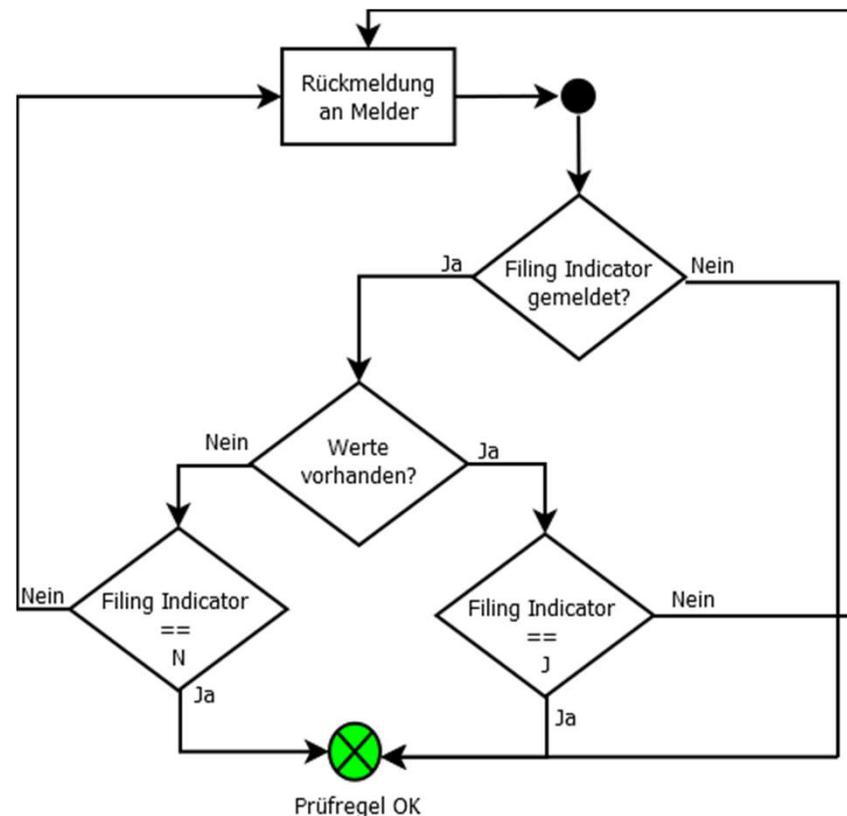
Aufbau der Prüfung für Filing Indicator anhand eines Beispiels (2/2)

- **Prüfung während der Übergangslösung für „optional“ Templates:**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0405>),
  ifElse(
    !isNa(<ISFIN0000349>),
    <ISFINF0405> == "J",
    <ISFINF0405> == "N"
  ),
  true
)
  
```

Wird kein Filing Indicator gemeldet, dann wird der Filing Indicator für den Versand errechnet.



Befüllung der Filing Indicator nach Umstieg auf FI-Konzept (1/2)

- **Nachdem alle Melder auf das neue Filing Indicator Konzept mit Q2/2018 umgestiegen sind, wird der Else-Zweig des ersten IfElse einfach durch eine FALSE ausgetauscht.**
- **Damit wird sicher gestellt, dass der Filing Indicator immer befüllt sein muss.**
- **Z.B.**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0101>),
  ifElse(
    <ISFINF0101> == "J",
    !isNa(<ISFIN1000000>),
    false
  ),
  false
)

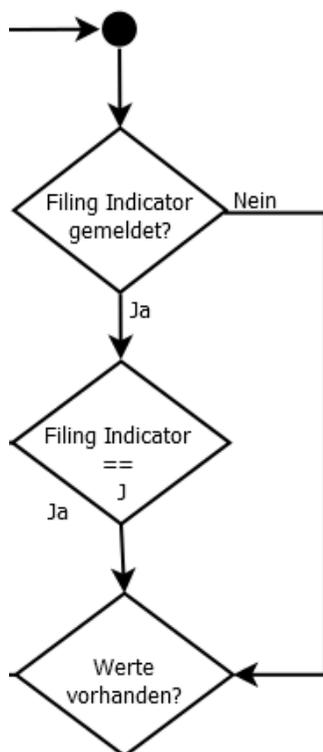
```


anstelle von ~~!isNa(<ISFIN1000000>)~~

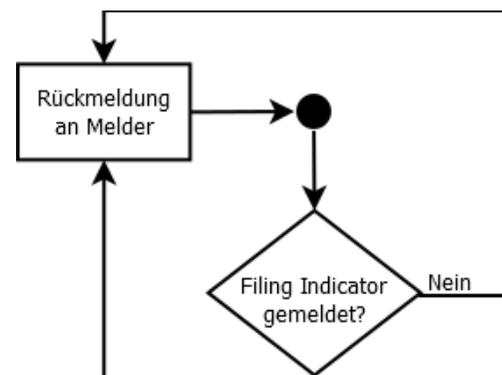
Befüllung der Filing Indicator nach Umstieg auf FI-Konzept (2/2)

- Unterschied zwischen Übergangslösung und verpflichtete Meldung des FIs

Übergangslösung:



FI-Konzept:



Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (1/4)

- Bei den ITS-Erhebungen gibt es grundsätzlich zwei verschiedene Optionen bei den zu übermittelnden Templates an die EZB:
 - Expected Template: Wird bei jeder Übermittlung erwartet (periodenabhängig)
 - Optional Template: Ist von bestimmten Ereignissen bzw. Aktivitäten abhängig (z.B. Schwellenprüfung)

- Daher werden die Filing Indicators für die Übermittlung an die EZB benötigt.

- Aufgrund der Unterscheidung „expected“ und „optional“, gibt es für das Prüfkonzept des Filing Indicator zwei verschiedene Prüfregelarten beim Eingang der Meldung.

- Diese Prüfregelarten werden als Formalprüfungen (= zurückweisend) definiert.

- Nicht alle Melder stellen sofort auf das System mit den Filing Indicator um, daher wird bis Q2/2018 eine Übergangslösung benötigt.

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (2/4)

- Keine Auswirkungen bei Leermeldungen.
- Meldeschwellenprüfung wird vorübergehend nicht zum Prüfen/Setzen der Filing Indicators herangezogen. Sobald ein Wert in einem meldeschwellenabhängigen Template gemeldet wird, muss der Filing Indicator auf „J“ gesetzt werden.
 - Es werden immer alle Prüfregeln ausgeführt, welche sich auf das Template beziehen.
- Sollte ein Template als „expected“ bei der EZB definiert sein und es gibt hierfür aber keine Geschäfte, muss nur eine der ausgewählten Positionen aus der Prüfregel mit dem Wert „0“ befüllt werden.
- Die folgende Szenarien sind für die Übergangslösung möglich:

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (3/4)

Szenario 1:

Melder übermittelt alle notwendigen Filing Indicators mit „J“ oder „N“:

- Überprüfung, ob der gemeldete Filing Indicator mit den gemeldet Werten zusammenpasst.
 - Keine Rückfrage:
 - Filing Indicator = J, Werte sind vorhanden
 - Filing Indicator = N, Wert sind nicht vorhanden (**ACHTUNG: auch „0“ ist ein Wert**)
 - Rückfrage
 - Filing Indicator = N, Werte sind vorhanden
 - Filing Indicator = J, Werte sind nicht vorhanden

Zusätzliche Prüfung bei einem expected Template:

- Bei den expected Template wird überprüft, ob der Filing Indicator auf „J“ gesetzt ist.
- Sollten keine Werte vorhanden sein, dann muss die Zahl „0“ **in nur einer** der vorkommenden Positionen in der Prüfregel gemeldet werden. Damit wird bestätigt, dass es hier keine Geschäfte gibt.

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (4/4)

Szenario 2:

Melder übermittelt keinen Filing Indicator:

- Der Filing Indicator wird aufgrund der gemeldeten Werte gesetzt/automatisch berechnet.

Zusätzliche Prüfung bei einem expected Template:

- Bei den expected Templates wird zusätzlich mittels eine Prüfregele überprüft, ob der Melder bestimmte Konzepte befüllt hat.
- Sollten keine Werte bei den expected Templates vorhanden sein, dann muss die Zahl „0“ **in nur einer** der vorkommenden Positionen in der Prüfregele gemeldet werden. Damit wird bestätigt, dass es hier keine Geschäft gibt.

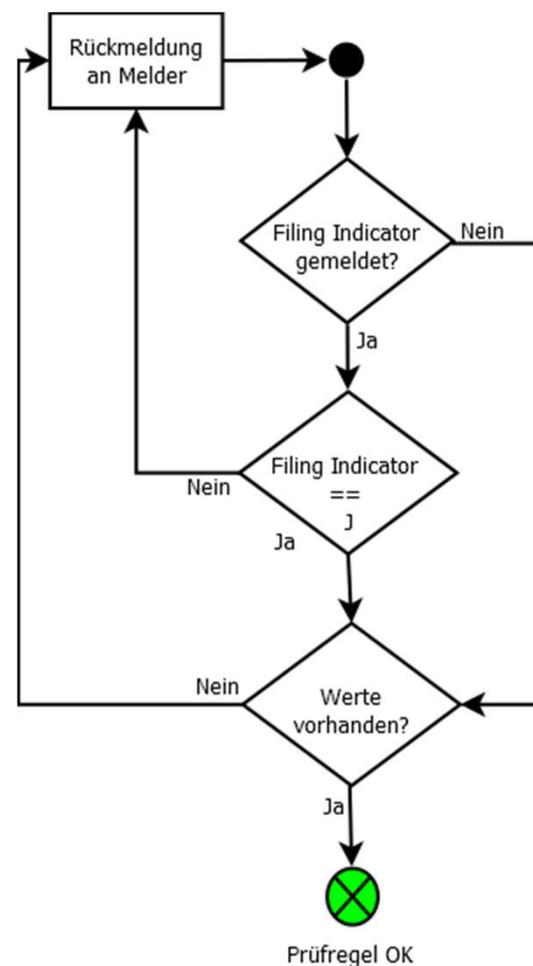
Aufbau der Prüfung für Filing Indicator anhand eines Beispiels (1/2)

- **Prüfung während der Übergangslösung für „expected“ Templates:**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0101>),
  ifElse(
    <ISFINF0101> == "J",
    !isNa(<ISFIN1000000>),
    false
  ),
  !isNa(<ISFIN1000000>)
)

```



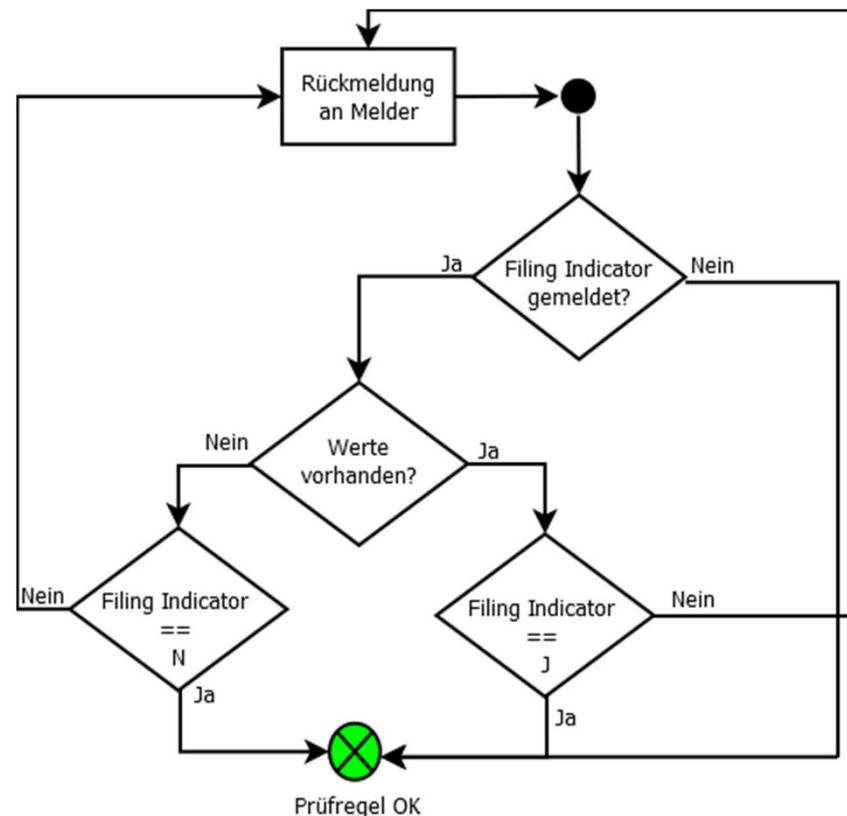
Aufbau der Prüfung für Filing Indicator anhand eines Beispiels (2/2)

- **Prüfung während der Übergangslösung für „optional“ Templates:**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0405>),
  ifElse(
    !isNa(<ISFIN0000349>),
    <ISFINF0405> == "J",
    <ISFINF0405> == "N"
  ),
  true
)
  
```

Wird kein Filing Indicator gemeldet, dann wird der Filing Indicator für den Versand errechnet.



Befüllung der Filing Indicator nach Umstieg auf FI-Konzept (1/2)

- **Nachdem alle Melder auf das neue Filing Indicator Konzept mit Q2/2018 umgestiegen sind, wird der Else-Zweig des ersten IfElse einfach durch eine FALSE ausgetauscht.**
- **Damit wird sicher gestellt, dass der Filing Indicator immer befüllt sein muss.**
- **Z.B.**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0101>),
  ifElse(
    <ISFINF0101> == "J",
    !isNa(<ISFIN1000000>),
    false
  ),
  false
)

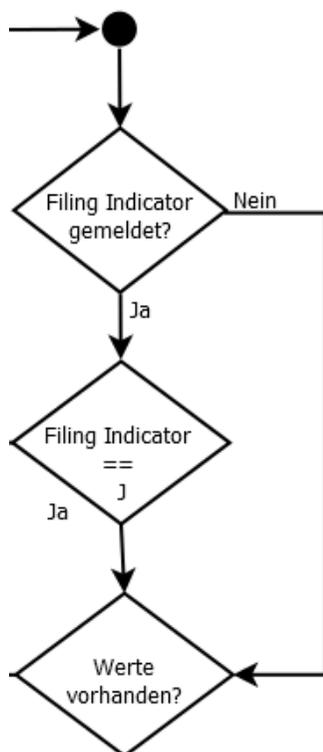
```


anstelle von ~~!isNa(<ISFIN1000000>)~~

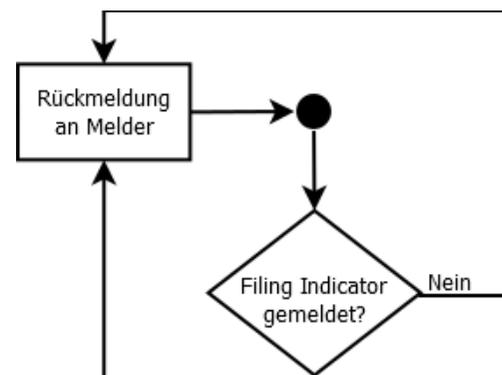
Befüllung der Filing Indicator nach Umstieg auf FI-Konzept (2/2)

- Unterschied zwischen Übergangslösung und verpflichtete Meldung des FIs

Übergangslösung:



FI-Konzept:



Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (1/4)

- Bei den ITS-Erhebungen gibt es grundsätzlich zwei verschiedene Optionen bei den zu übermittelnden Templates an die EZB:
 - Expected Template: Wird bei jeder Übermittlung erwartet (periodenabhängig)
 - Optional Template: Ist von bestimmten Ereignissen bzw. Aktivitäten abhängig (z.B. Schwellenprüfung)

- Daher werden die Filing Indicators für die Übermittlung an die EZB benötigt.

- Aufgrund der Unterscheidung „expected“ und „optional“, gibt es für das Prüfkonzept des Filing Indicator zwei verschiedene Prüfregelarten beim Eingang der Meldung.

- Diese Prüfregelarten werden als Formalprüfungen (= zurückweisend) definiert.

- Nicht alle Melder stellen sofort auf das System mit den Filing Indicator um, daher wird bis Q2/2018 eine Übergangslösung benötigt.

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (2/4)

- Keine Auswirkungen bei Leermeldungen.
- Meldeschwellenprüfung wird vorübergehend nicht zum Prüfen/Setzen der Filing Indicators herangezogen. Sobald ein Wert in einem meldeschwellenabhängigen Template gemeldet wird, muss der Filing Indicator auf „J“ gesetzt werden.
 - Es werden immer alle Prüfregeln ausgeführt, welche sich auf das Template beziehen.
- Sollte ein Template als „expected“ bei der EZB definiert sein und es gibt hierfür aber keine Geschäfte, muss nur eine der ausgewählten Positionen aus der Prüfregel mit dem Wert „0“ befüllt werden.
- Die folgende Szenarien sind für die Übergangslösung möglich:

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (3/4)

Szenario 1:

Melder übermittelt alle notwendigen Filing Indicators mit „J“ oder „N“:

- Überprüfung, ob der gemeldete Filing Indicator mit den gemeldet Werten zusammenpasst.
 - Keine Rückfrage:
 - Filing Indicator = J, Werte sind vorhanden
 - Filing Indicator = N, Wert sind nicht vorhanden (**ACHTUNG: auch „0“ ist ein Wert**)
 - Rückfrage
 - Filing Indicator = N, Werte sind vorhanden
 - Filing Indicator = J, Werte sind nicht vorhanden

Zusätzliche Prüfung bei einem expected Template:

- Bei den expected Template wird überprüft, ob der Filing Indicator auf „J“ gesetzt ist.
- Sollten keine Werte vorhanden sein, dann muss die Zahl „0“ **in nur einer** der vorkommenden Positionen in der Prüfregel gemeldet werden. Damit wird bestätigt, dass es hier keine Geschäfte gibt.

Befüllung Filing Indicator Übergangslösung (4/4)

Szenario 2:

Melder übermittelt keinen Filing Indicator:

- Der Filing Indicator wird aufgrund der gemeldeten Werte gesetzt/automatisch berechnet.

Zusätzliche Prüfung bei einem expected Template:

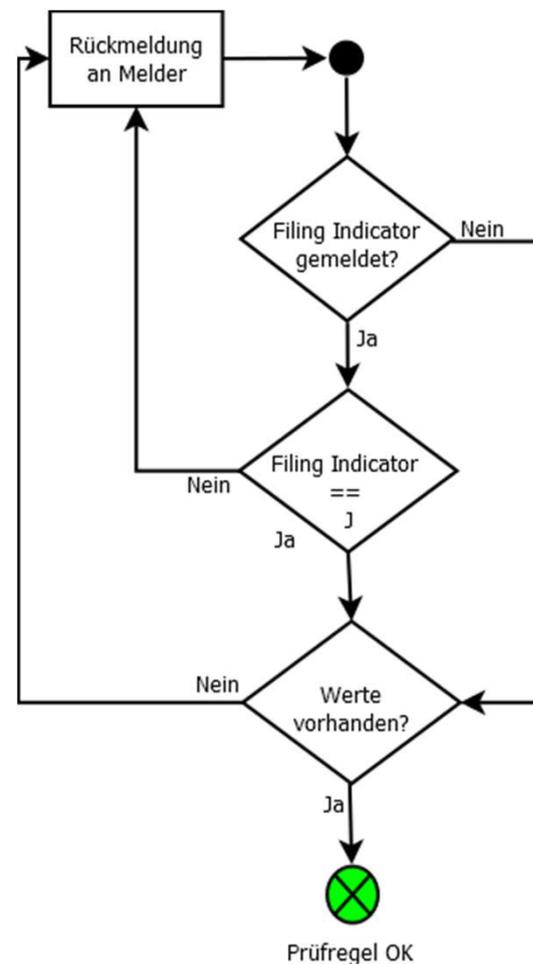
- Bei den expected Templates wird zusätzlich mittels eine Prüfregel überprüft, ob der Melder bestimmte Konzepte befüllt hat.
- Sollten keine Werte bei den expected Templates vorhanden sein, dann muss die Zahl „0“ **in nur einer** der vorkommenden Positionen in der Prüfregel gemeldet werden. Damit wird bestätigt, dass es hier keine Geschäft gibt.

Aufbau der Prüfung für Filing Indicator anhand eines Beispiels (1/2)

- **Prüfung während der Übergangslösung für „expected“ Templates:**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0101>),
  ifElse(
    <ISFINF0101> == "J",
    !isNa(<ISFIN1000000>),
    false
  ),
  !isNa(<ISFIN1000000>)
)
  
```



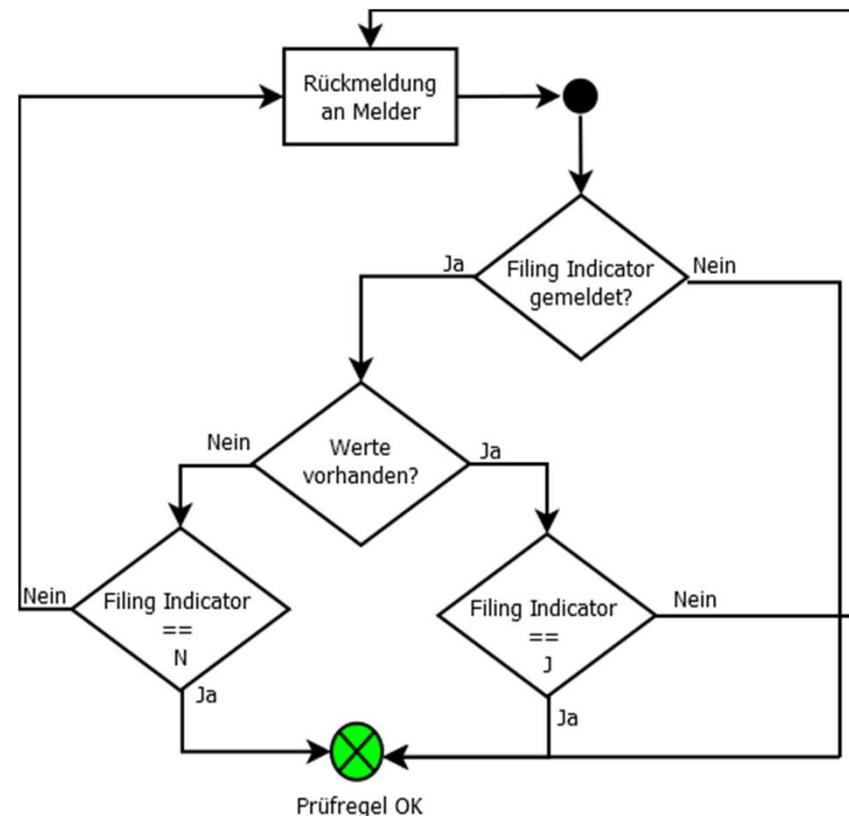
Aufbau der Prüfung für Filing Indicator anhand eines Beispiels (2/2)

- **Prüfung während der Übergangslösung für „optional“ Templates:**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0405>),
  ifElse(
    !isNa(<ISFIN0000349>),
    <ISFINF0405> == "J",
    <ISFINF0405> == "N"
  ),
  true
)
  
```

Wird kein Filing Indicator gemeldet, dann wird der Filing Indicator für den Versand errechnet.



Befüllung der Filing Indicator nach Umstieg auf FI-Konzept (1/2)

- **Nachdem alle Melder auf das neue Filing Indicator Konzept mit Q2/2018 umgestiegen sind, wird der Else-Zweig des ersten IfElse einfach durch eine FALSE ausgetauscht.**
- **Damit wird sicher gestellt, dass der Filing Indicator immer befüllt sein muss.**
- **Z.B.**

```

ifElse(
  !isNa(<ISFINF0101>),
  ifElse(
    <ISFINF0101> == "J",
    !isNa(<ISFIN1000000>),
    false
  ),
  false
)

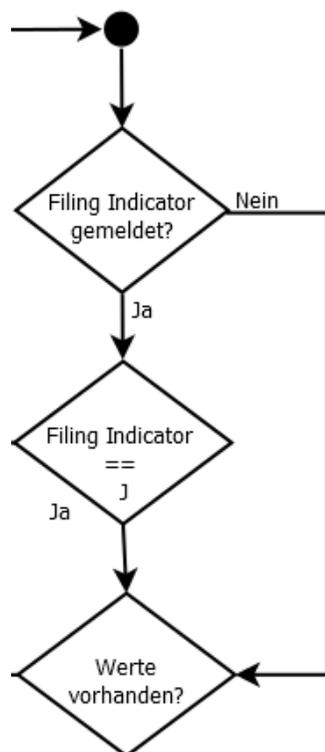
```


anstelle von ~~!isNa(<ISFIN1000000>)~~

Befüllung der Filing Indicator nach Umstieg auf FI-Konzept (2/2)

- Unterschied zwischen Übergangslösung und verpflichtete Meldung des FIs

Übergangslösung:



FI-Konzept:

