



BANCO DE PORTUGAL
EUROSISTEMA

Workshop Reportes de Supervisão

2. Balanço das submissões dos reportes ITS

Centro de Competência Técnica BI/AI

Departamento de Sistemas de Informação

19 de novembro 2020

Agenda

1. Estatísticas das submissões realizadas pelas instituições

2. Balanço anual dos reportes

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte



Agenda

1. Estatísticas das submissões realizadas pelas instituições

2. Balanço anual dos reportes

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte



1. Estatísticas das submissões realizadas pelas Instituições

Resumo

25 025
Ficheiros Recebidos

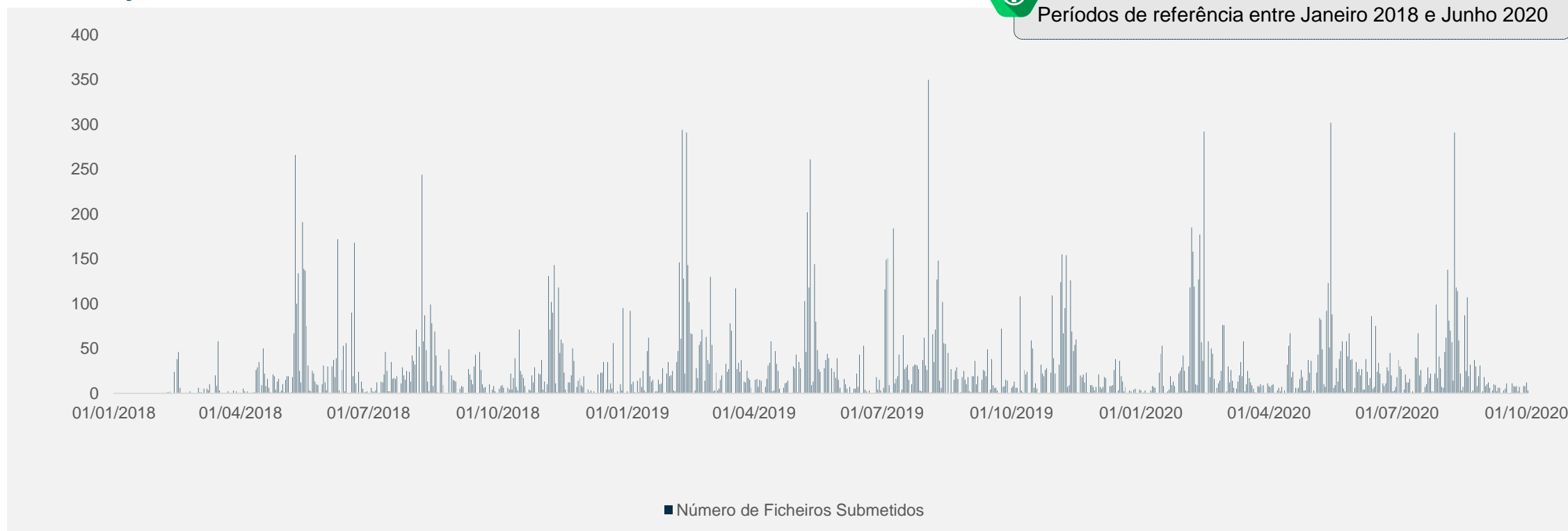
23 088
Ficheiros XBRL

1 937
Ficheiros CSV/XML

13 036
Enviados para o BCE

Gráfico 1.1

Distribuição dos ficheiros submetidos



Fonte: BdP



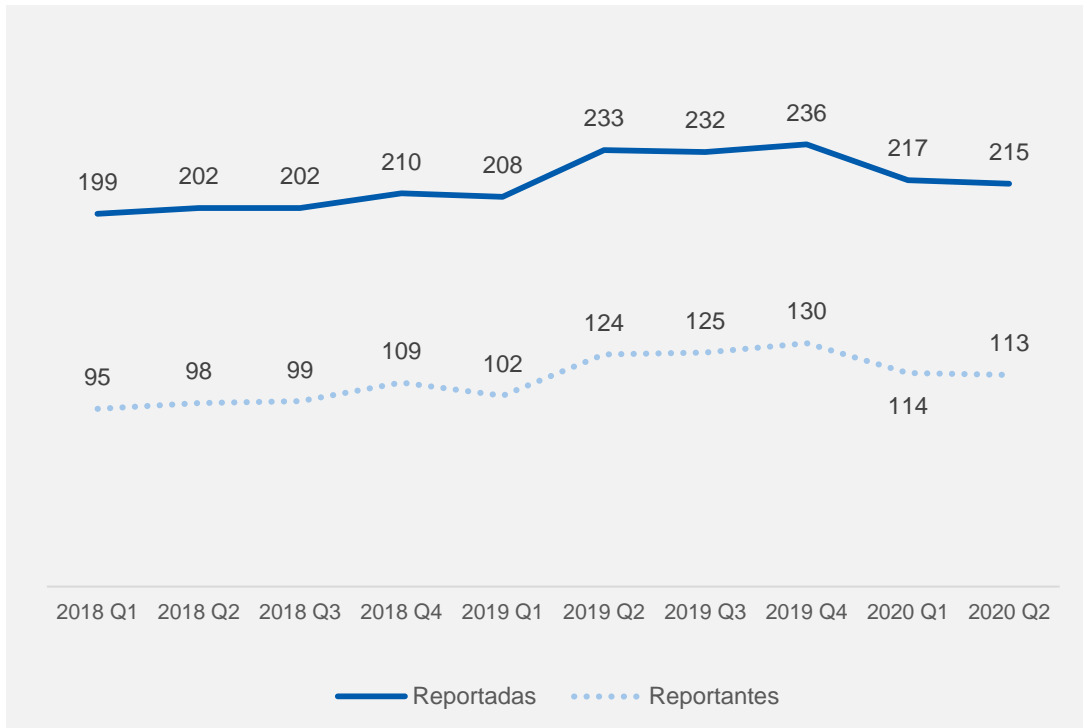
1. Estatísticas das submissões realizadas pelas Instituições

Instituições e Frameworks

113
Reportantes

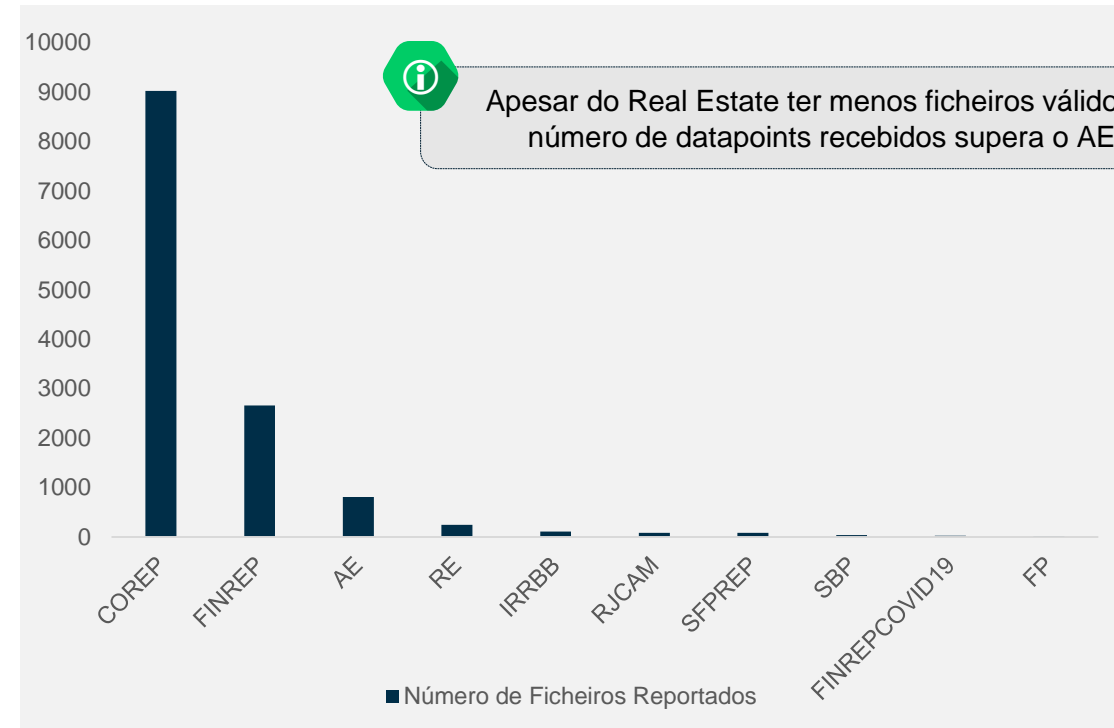
215
Reportadas

Gráfico 1.2
Distribuição por período de referência



Fonte: BdP

Gráfico 1.3
Distribuição por Framework



Fonte: BdP

1. Estatísticas das submissões realizadas pelas Instituições

Módulos

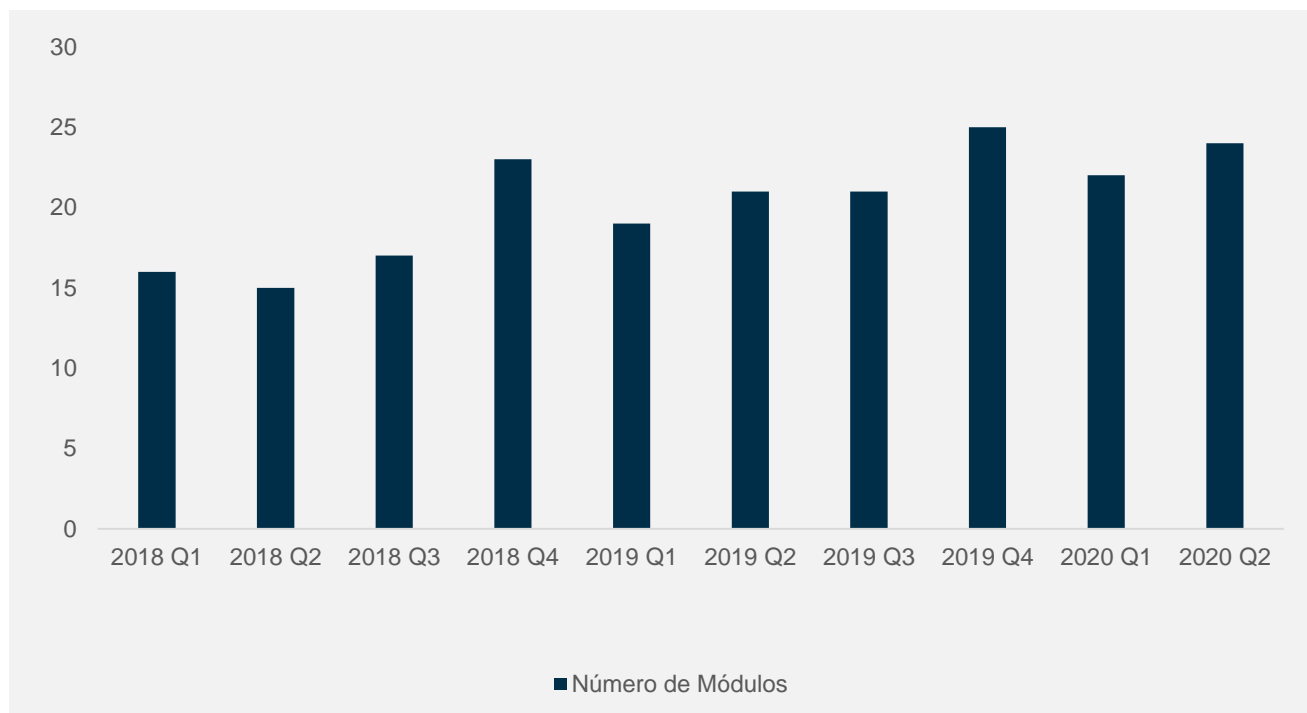
41
Módulos Ativos

7
Módulos BdP

34
Módulos EBA

Gráfico 1.4

Distribuição por período de referência



Fonte: BdP

- A Dezembro de 2018 iniciou-se o reporte do IRRBB e a desmultiplicação do COREP em OF e LR.
- A Junho de 2019 inicia-se o reporte do SFPREP.
- A junho de 2020 inicia-se o reporte dos módulos relativos ao RJCAM e COVID19.
- **Para o período de referência Junho 2020, estavam 41 Módulos Ativos, mais 8 que no período homólogo.**

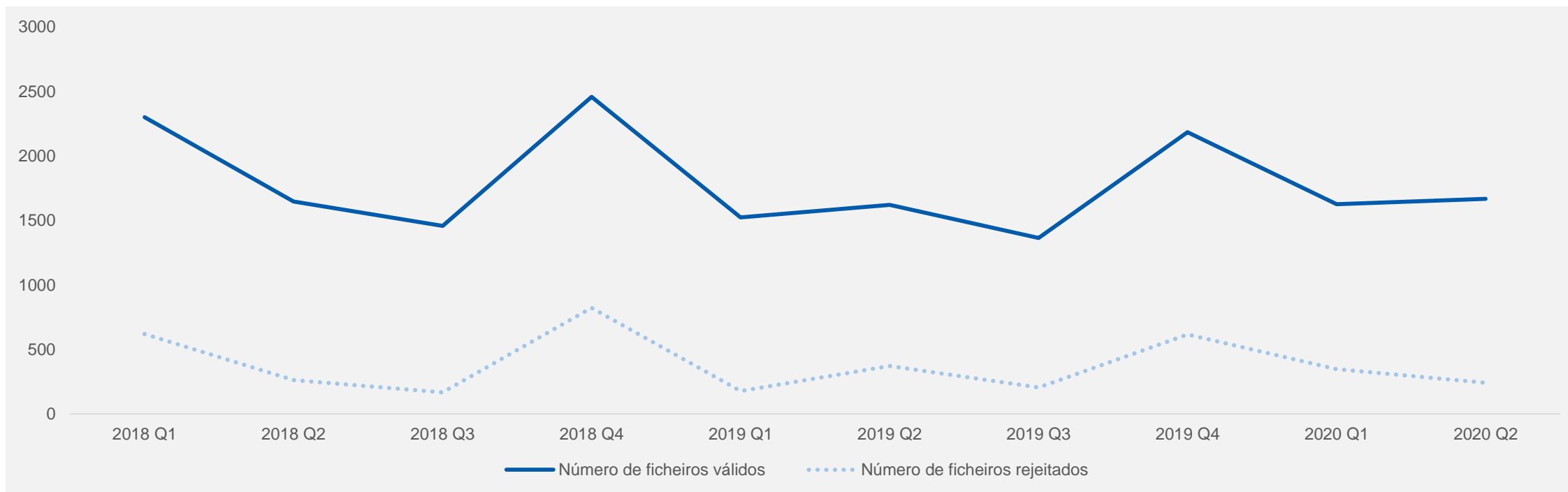


1. Estatísticas das submissões realizadas pelas Instituições

Estado

Gráfico 1.5

Distribuição por período de referência e estado



Fonte: BdP



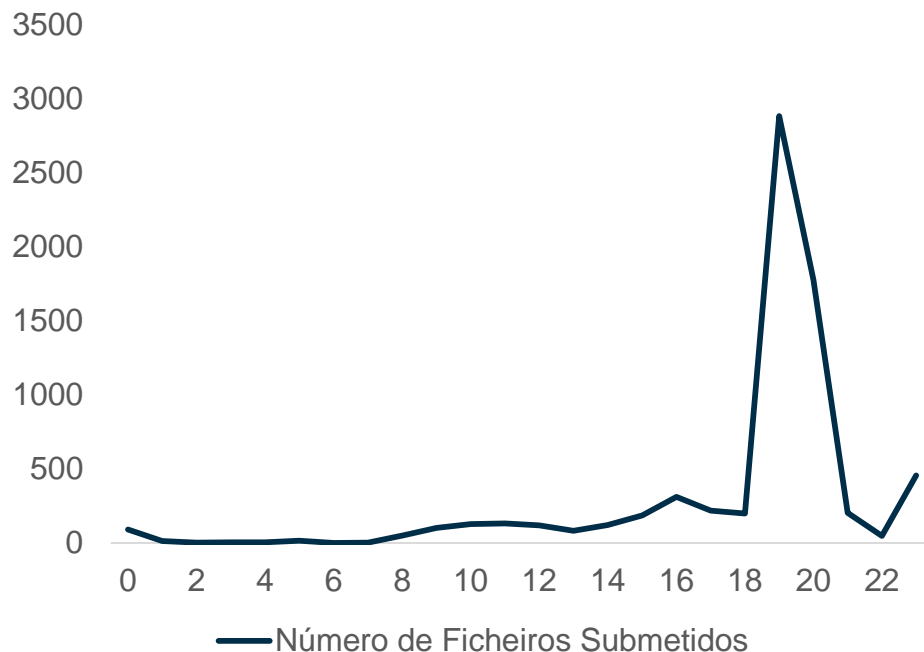
1. Estatísticas das submissões realizadas pelas Instituições

Tempo de Resposta

PRD
10
Média de Horas

CRT
2
Média de Horas

Gráfico 1.6
Distribuição das Submissões ao longo do dia



Fonte: BdP



No ambiente de produção os processamentos são noturnos, pelo que as respostas são enviadas tipicamente sempre no dia seguinte ao dia da submissão.

Gráfico 1.7
Submissões em Ambiente de Testes

O ambiente de testes pode ter momentos de indisponibilidade devido a testes internos.



Fonte: BdP

Agenda

1. Estatísticas das submissões realizadas pelas instituições

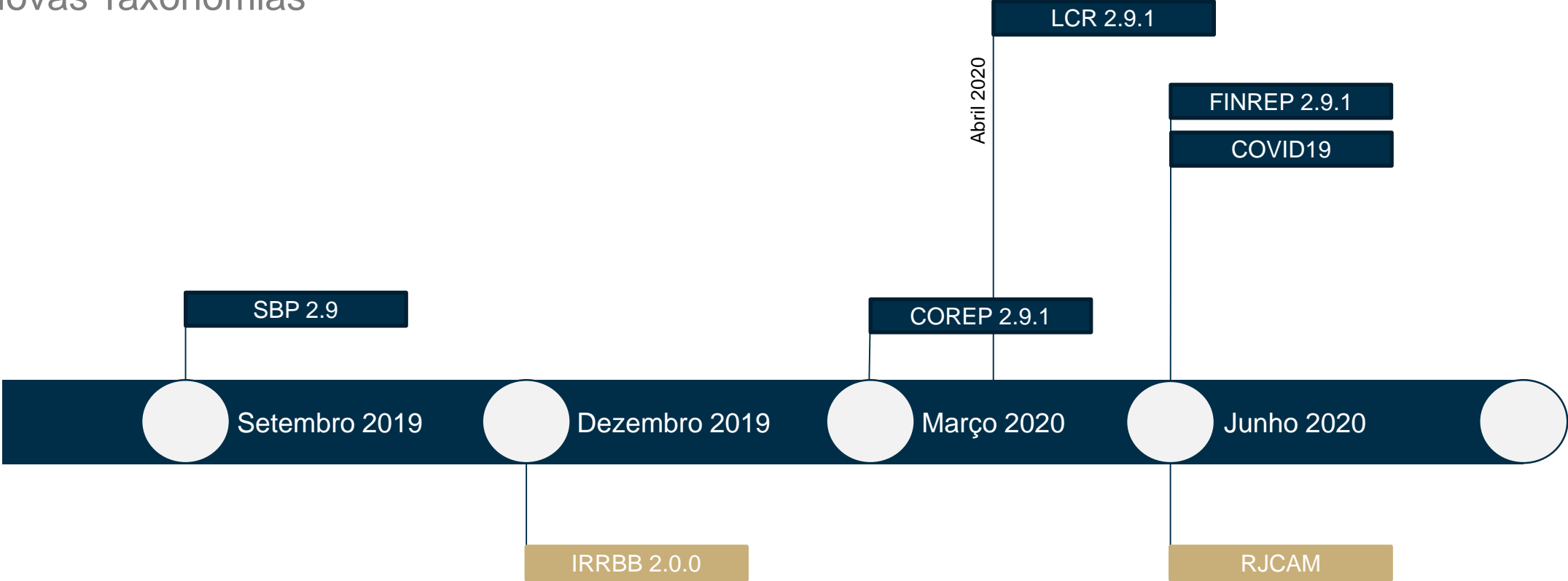
2. Balanço anual dos reportes

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte



2. Balanço anual dos reportes

Novas Taxonomias



2. Balanço anual dos reportes

Setembro 2019

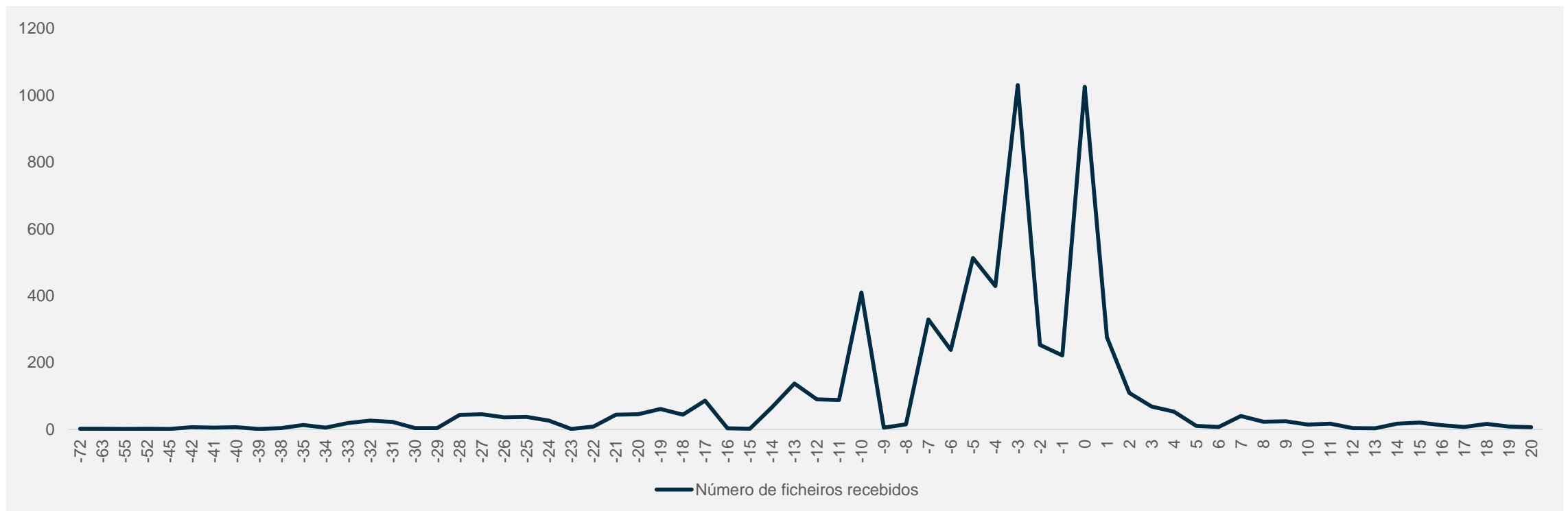


Junho 2020

Até reporte ser aceite

Gráfico 2.1

Distribuição das tentativas até 1º válido



Fonte: BdP



2. Balanço anual dos reportes

Até reporte ser aceite

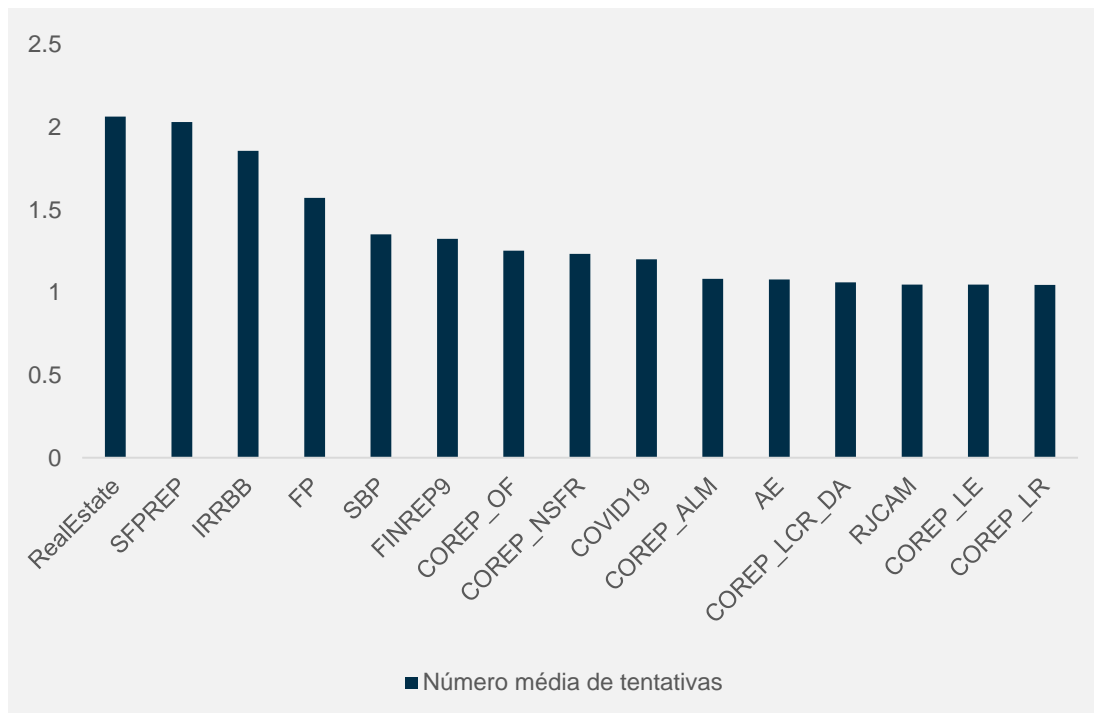
Setembro 2019



Junho 2020

Gráfico 2.2

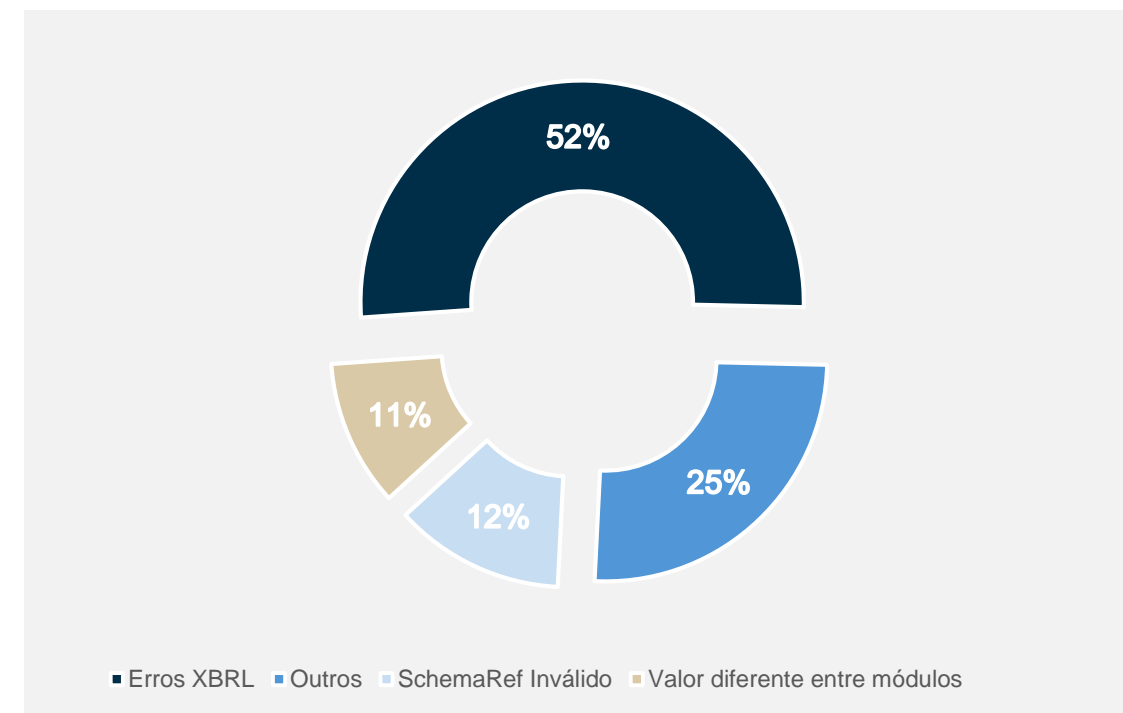
Número de tentativas por módulo



Fonte: BdP

Gráfico 2.3

Principais erros até ao 1º válido



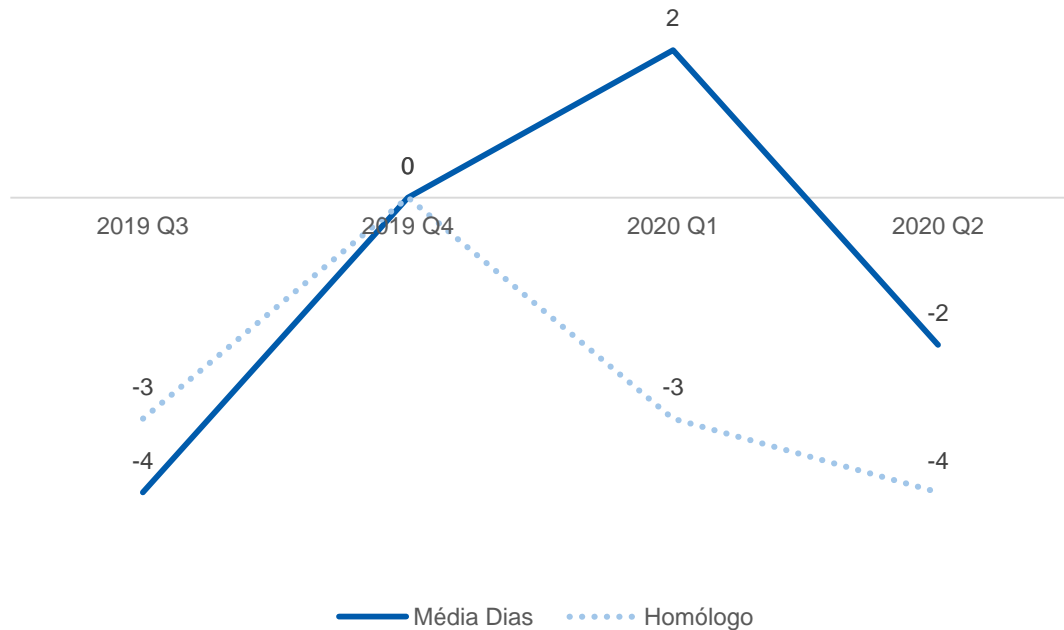
Fonte: BdP



2. Balanço anual dos reportes

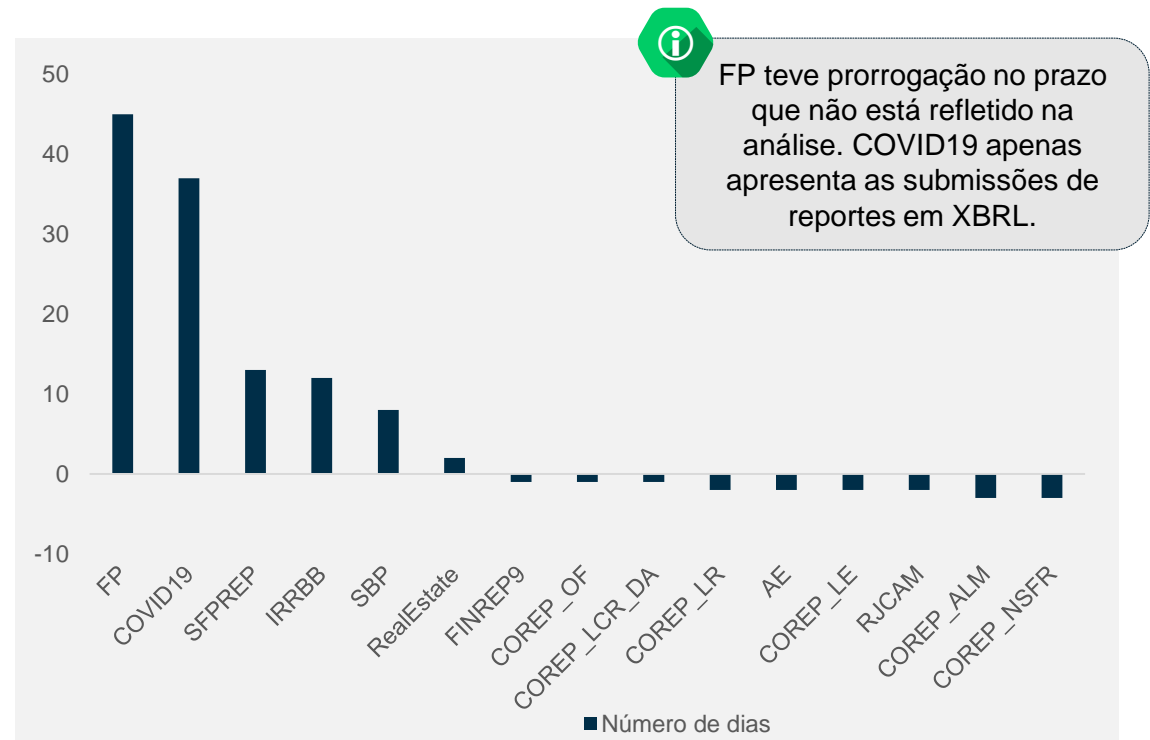
1º Reporte Válido

Gráfico 2.4
Distribuição prazo de reporte



Fonte: BdP

Gráfico 2.5
Distribuição do prazo relativamente ao módulo



2. Balanço anual dos reportes

Setembro 2019

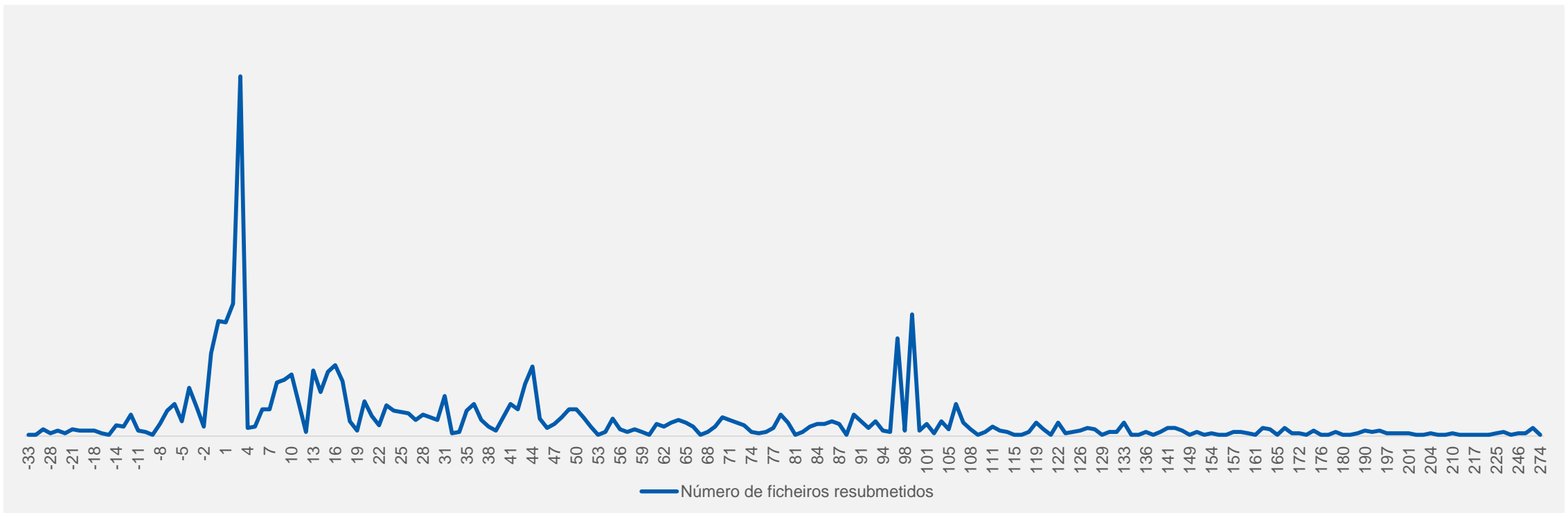


Junho 2020

Após Primeiro Válido

Gráfico 2.6

Distribuição de resubmissões válidas face ao prazo de reporte



Fonte: BdP



2. Balanço anual dos reportes

Após Primeiro Válido

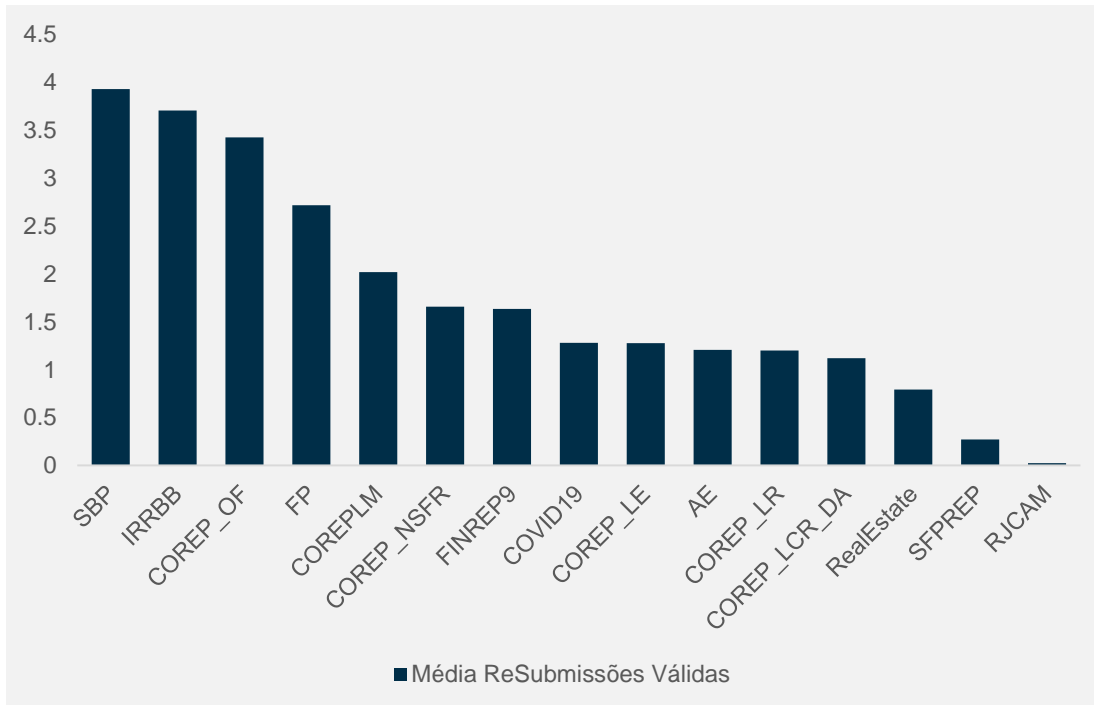
Setembro 2019



Junho 2020

Gráfico 2.7

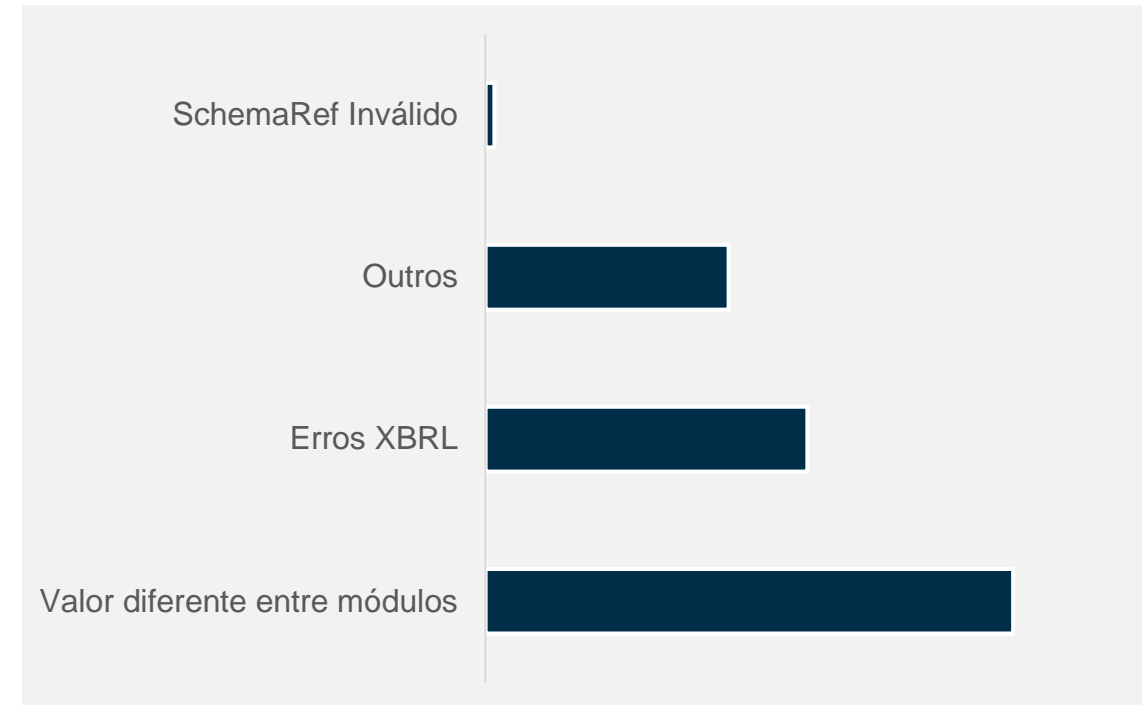
Média de Resubmissões Válidas por período de referência



Fonte: BdP

Gráfico 2.8

Principais Erros em resubmissões



Agenda

1. Estatísticas das submissões realizadas pelas instituições

2. Balanço anual dos reportes

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte



3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

Resumo

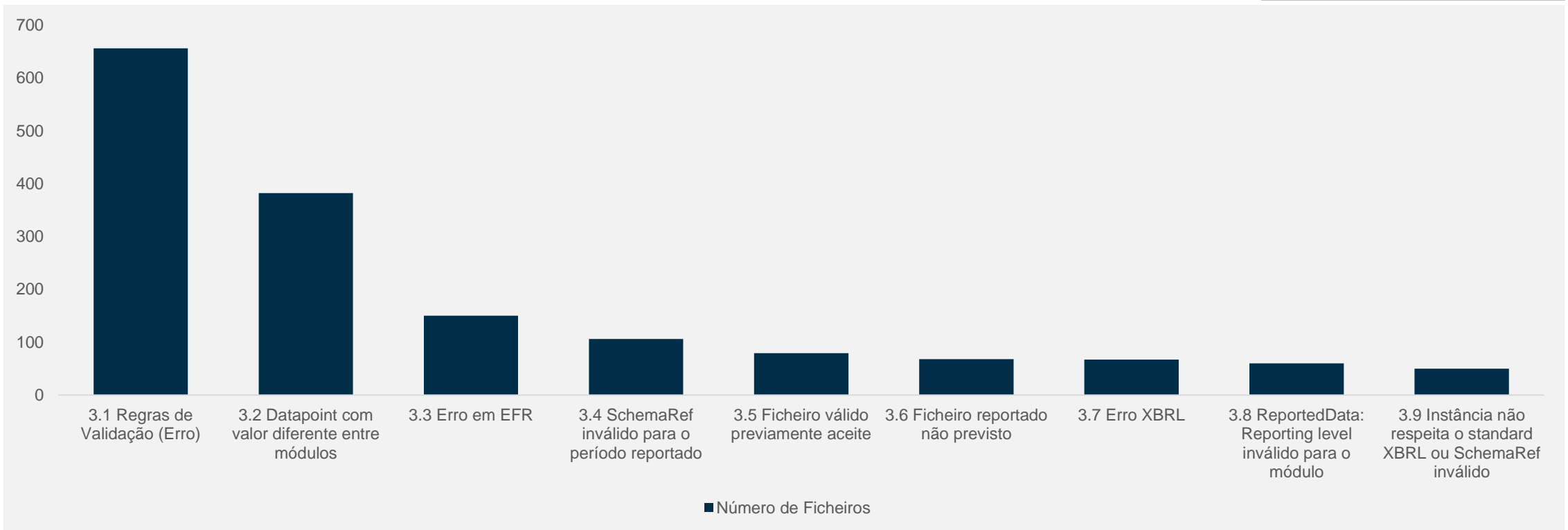
Gráfico 3.1

Distribuição dos principais erros

Setembro 2019



Junho 2020

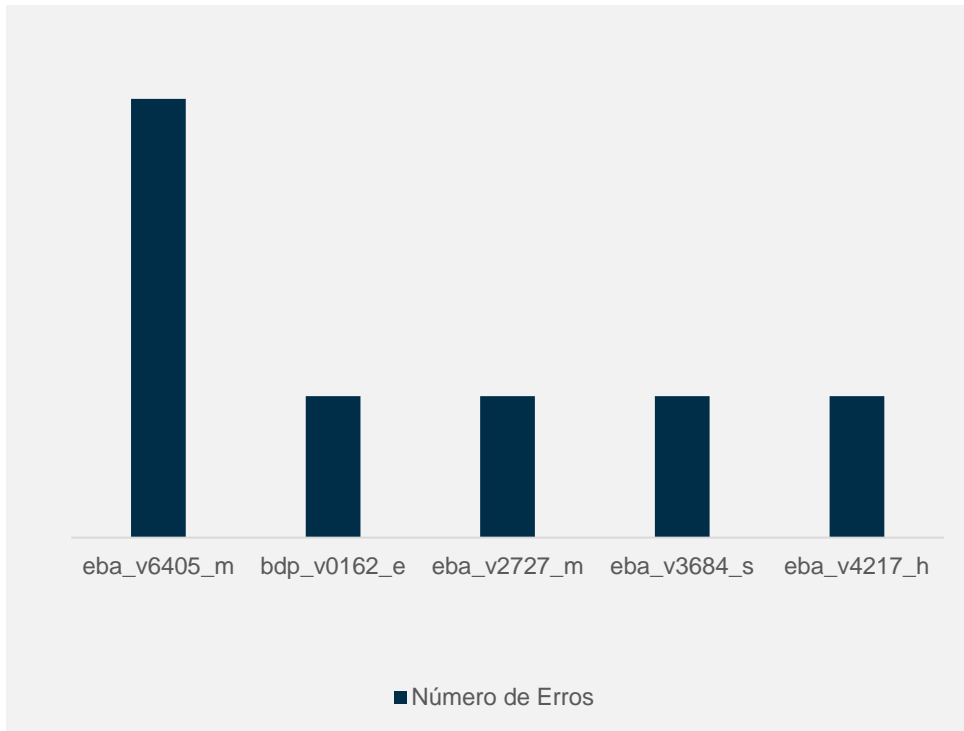


3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.1. Regras de Validação (Erro)

Gráfico 3.2

Regras de Validação com maior incidência



Fonte: BdP



Maioria dos erros em regras de validação são nos módulos FINREP e COREP_OF



Os dois tipos de regra com mais erros são “Manual” e “Sign”

Causa

- Ficheiro não cumpre regras de validação definidas na taxonomia XBRL.

Ação

- Identificação da fórmula avaliada no ficheiro de resposta;
- Resposta enviada pelo BdP permite identificação das coordenadas envolvidas na fórmula, valores reportados e motivo do erro;
- Consulta do documento de regras de validação publicado com o modelo de comunicação e atualizado sempre que necessário.

Regra v6405_m:

$\{C\ 04.00, r226\} = \min(4 / 3 * \{C\ 01.00, r015\}, \{C\ 01.00, r010\})$

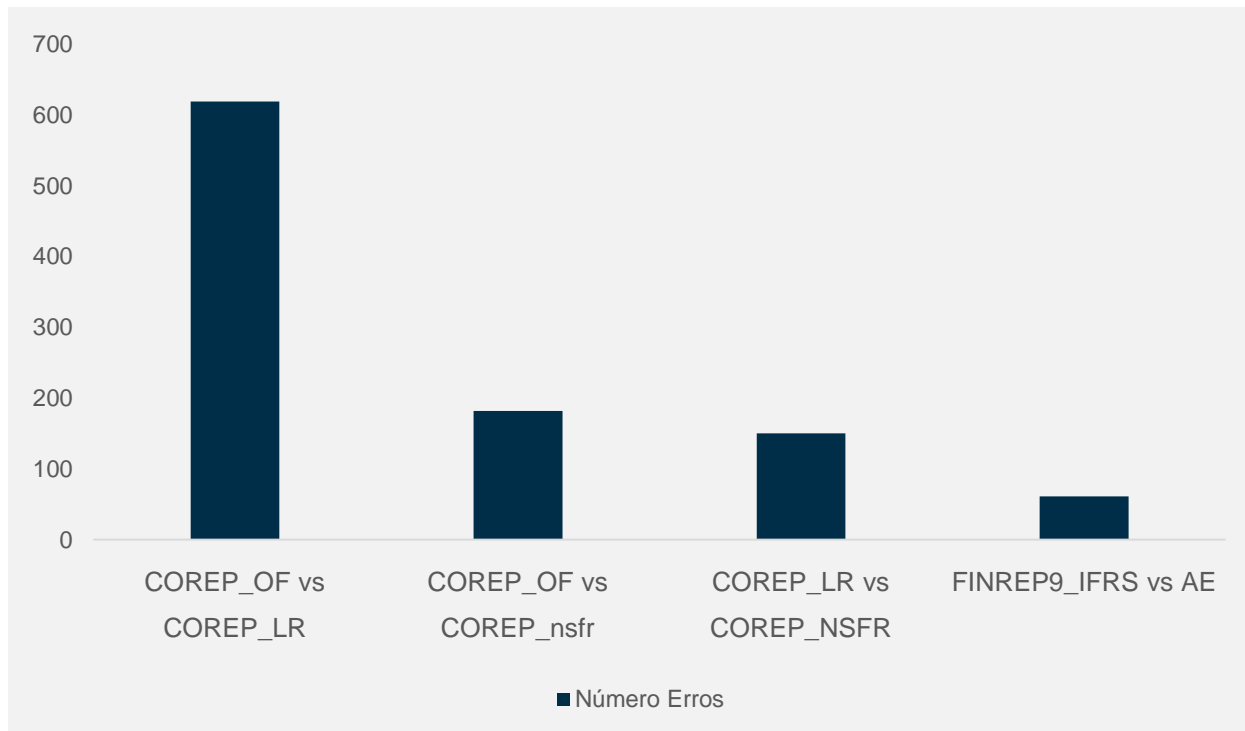


3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.2. Datapoint com valor diferente entre módulos

Gráfico 3.3

Módulo com maior incidência do erro



Fonte: BdP

Causa

- O mesmo datapoint pode existir em diferentes módulos.
- Este erro surge quando os valores não inconsistentes entre módulos;
- Implica que pelo menos um módulo esteja válido em sistema.

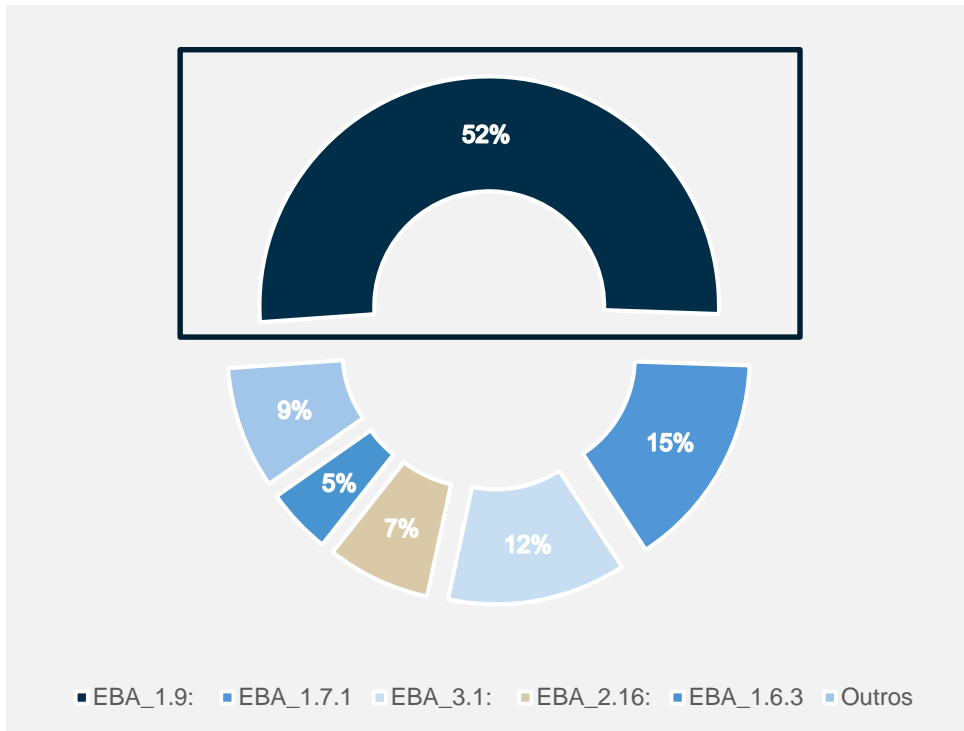
Ação

- Resubmeter ficheiros com os valores consistentes.
- Quando se pretende substituir um valor de datapoint que existe em diversos módulos, é necessário solicitar a rejeição manual dos módulos ao ITS Suporte. **Devem ser reenviados todos os módulos que foram rejeitados.**

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.3. Erro em EFR

Gráfico 3.4
Distribuição dos Erros EFR



Fonte: BdP

EFR 1.9 - XML-XBRL

Causa

- O ficheiro não cumpre as regras XML-XBRL.

Exemplos não exaustivos:

- The context has not been assigned an id value
- No value is assigned to an item
- Dimensional validation failed
- The value 'eba_CT:x2' of the item 'eba_met:ei219' is invalid.
One of { eba_CT:x10, ... , eba_CT:x5 } can be specified.
- The measure has not been set a value.

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.3. Erro em EFR

Regra EFR 1.9

No value is assigned to an item;

Causa

- Envio de métricas “vazias”:

```
<eba_met:mi237 contextRef="c-1" decimals="2" unitRef="u-01"/>
```

Ação

- A métrica é do tipo “monetário”, como tal é necessário reportar um valor monetário válido:
- Caso se pretenda reportar o valor “0” deve preencher-se o valor na declaração da métrica;
- Caso não se pretenda reportar nenhum valor não se deve reportar o facto;



A alteração de versões de datapoints entre versões de taxonomia pode levar a instituição a reportar hipercubos que não são válidos na nova versão.

Regra EFR 1.9

Dimensional validation failed

Causa

- Hipercubo inválido: combinação de dimensões e membros não é válida na taxonomia.
- O ficheiro de resposta identifica o contexto e métrica envolvidos no erro.

Ação

- Analisar se o contexto e métrica têm correspondência a um conceito na taxonomia vigente.
- A própria resposta identifica o membro errado:

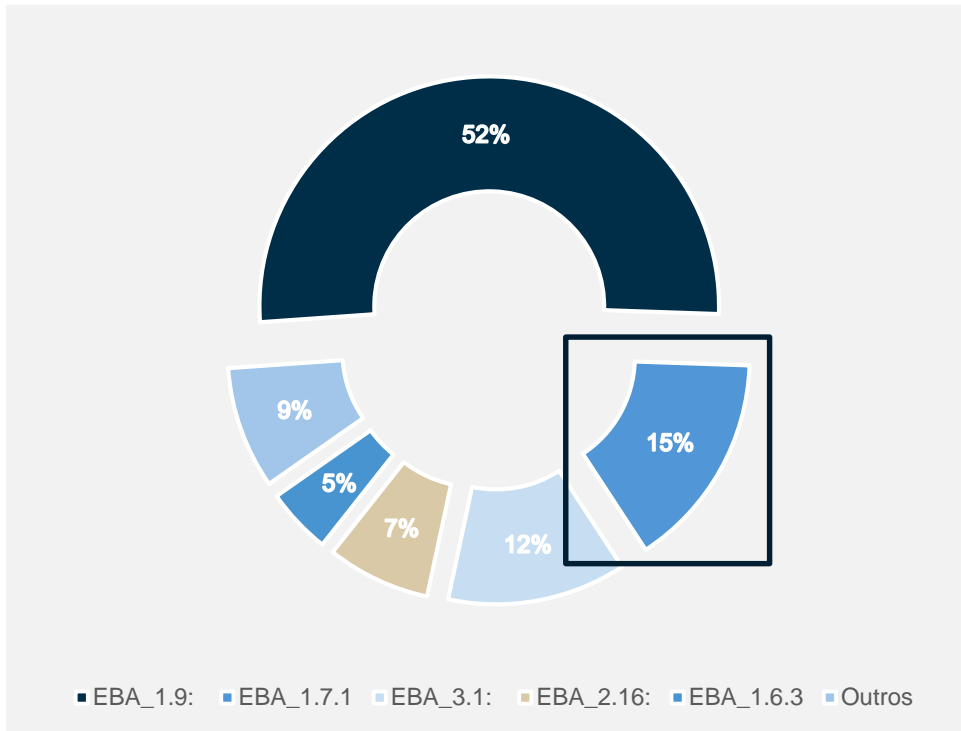
Invalid domain member : dimension = eba_dim:EXC, member = eba_EC:x19



3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.3. Erro em EFR

Gráfico 3.5
Distribuição dos Erros EFR



Fonte: BdP

EFR 1.7.1 – Facto não referenciado por Filing Indicator

Causa

- Envio de um datapoint que corresponde a uma tabela para a qual não está a ser declarado Filing Indicator;

Ação

- Identificar os pontos no ficheiro de resposta e confirmar se a categorização está correta;
- Caso se pretenda reportar o ponto, declarar o *Filing Indicator* para a tabela a que o ponto pertence.

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

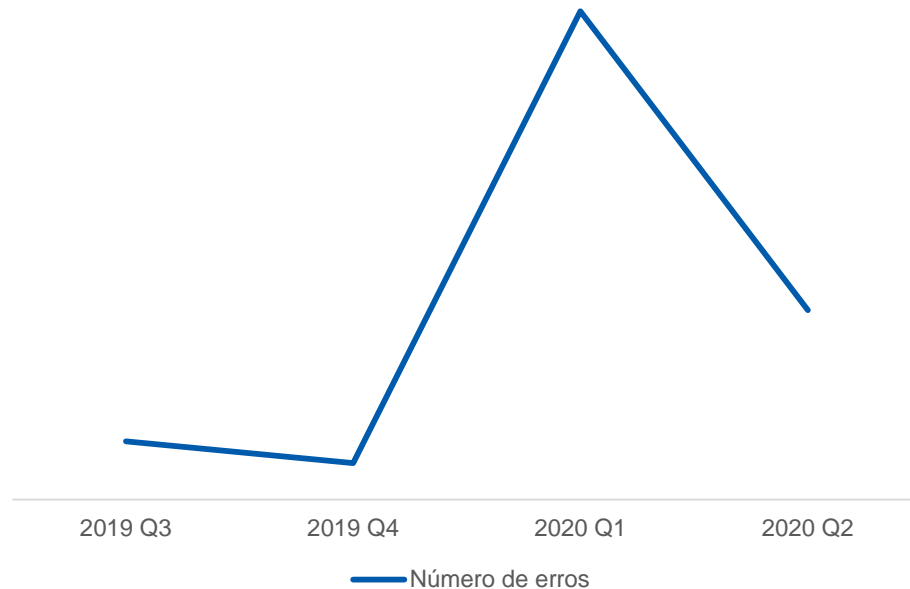
3.4. SchemaRef Inválido para período reportado



Aumento do número de erros está associado a alterações de taxonomia.

Gráfico 3.6

Distribuição por data de referência



Fonte: BdP

Causa

- SchemaRef que identifica a versão do módulo a que diz respeito o ficheiro não é coerente com o período reportado.

Ação

- Alterar o SchemaRef e resubmeter o ficheiro.
- SchemaRef pode ser consultado no DPM, taxonomia e modelo de comunicação.
- O SchemaRef das taxonomias muda para permitir o seu versionamento. Sempre que há mudanças de taxonomia, o SchemaRef altera-se.



3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.5

Ficheiro válido previamente aceite

Causa

- Foi reportado anteriormente um ficheiro Válido;
- O ficheiro que está a ser reportado apresenta erros nas regras de validação;

Ação

- É necessário corrigir todos os erros existentes para conseguir substituir o ficheiro anterior.

3.6

Ficheiro reportado não previsto

Causa

- Não existe obrigação de reporte para a instituição, módulo e período de referência.

Ação

- Entrar em contacto com o ITS Suporte.

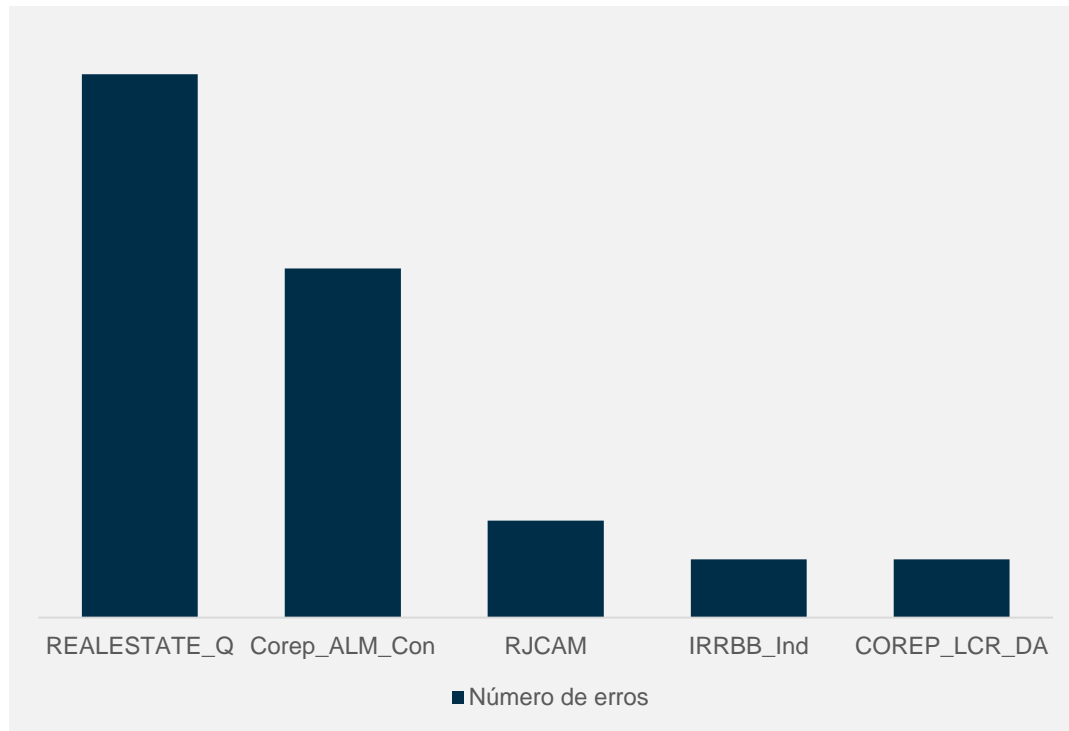


3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.7. Erro XBRL

Gráfico 2.4

Distribuição por módulo



Fonte: BdP

Causa

- Erros que não permitem uma avaliação correta do ficheiro por não ser um ficheiro XBRL válido.

Listagem não exaustiva:

- "4.52874184020402E-03" does not parse as a decimal value;
- "43738" does not parse as a date value,
- ii363!: 6 fraction digits found in "0.169381" where maximum fraction digits 0 was expected;
- Attribute "unitRef" in namespace "" is not permitted for element "bi100059"

3. Tipos de erros mais frequentes na submissão do reporte

3.8

Reporting Level Inválido para Módulo

Causa

- Base de consolidação reportada não é consistente com a do módulo.

Ação

- Corrigir e submeter novamente o ficheiro.

Domínio	Membro	Código XBRL
Scope of consolidation	Individual	eba_SC:x6
Scope of consolidation	Consolidated	eba_SC:x7

3.9

Instância não respeita o standard XBRL ou SchemaRef inválido

Causa

- O processo de validação é interrompido quando acontece um erro grave, como por exemplo:
 - Documentos inválidos (ficheiro XML não válido) ou truncados;
 - Problemas de formatação;
 - Problemas de *encoding* dos ficheiros.

Ação

- Implica uma análise manual. Sugere-se validar se o ficheiro submetido é um ficheiro XML válido.





In God we trust; all others must bring data.

William Edwards Deming