

An alle Banken (MFIs)  
und an die Rechenzentralen der  
Sparkassen und Kreditgenossenschaften

## Rundschreiben Nr. 50/2016

### Monatliche Bilanzstatistik

hier: Berichtspflichten für Banken (MFIs), die an den gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften des Eurosystems (GLRG) teilnehmen

Sehr geehrte Damen und Herren,

Banken (MFIs), die nicht an einem der Geschäfte der ersten Serie (GLRG-1) und/oder an dem ersten Geschäft der zweiten Serie (GLRG-II) teilgenommen haben und nicht beabsichtigen, an einem der drei verbleibenden GLRG-II-Geschäfte teilzunehmen, sind von dem vorliegenden Rundschreiben nicht betroffen.

Alle anderen Banken (MFIs) bitten wir, folgende Hinweise zu beachten:

### 1. GLRG-II: Ende der Einreichungsfrist für die Berichtsperiode von 2/2015 bis 01/2016

Das für die Teilnahme an allen GLRG-II-Geschäften einzureichende Erste Meldeschema Y2 umfasst immer die Berichtsperiode vom 1. Februar 2015 (mit Ultimo-Stand 31. Januar 2015) bis 31. Januar 2016. Für eine erstmalige Teilnahme an dem GLRG-II-Geschäft im September (GLRG-II.2) ist das Erste Meldeschema spätestens bis 5. September 2016, 15:30 Uhr über das elektronische „Allgemeine Meldeportal Statistik“ (AMS) einzureichen. Diese Frist betrifft auch diejenigen Institute, die bereits an dem ersten GLRG-II-Geschäft (GLRG-II.1) teilgenommen haben, bei denen der Datenstand des bereits eingereichten Ersten Meldeschemas Y2 aber aufgrund von Datenrevisionen nicht mehr korrekt ist (s. a. Punkt 3 dieses Schreibens).

Bitte beachten Sie, dass im AMS als „Meldezeitraum“ für das Erste Meldeschema Y2 **immer 01.2016** (und nicht der aktuelle Kalendermonat) auszuwählen ist; andernfalls wird Ihre Meldung nicht verarbeitet.

Wir weisen vorsorglich darauf hin, dass eine **nachträgliche Einreichung des Meldeschemas nicht zulässig** ist. Eine Teilnahme ist dann erst wieder zum dritten Geschäft der GLRG-II-Serie im Dezember 2016 möglich. Den entsprechenden Einreichungstermin können Sie der ersten Zeile des Dokuments "Unverbindlicher Zeitplan für die zweite Serie der gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäfte (GLRG II)" (<http://www.bundesbank.de/glr2> > „GLRG-II-Kalender“ auf dem rechten Teil der Seite) entnehmen.

## **2. GLRG-II: Hinweise bei erstmaliger Teilnahme**

Alle weiteren Informationen zu GLRG-II-Geschäften entnehmen Sie bitte dem Bundesbank-Rundschreiben Nr. 29/2016 (<http://www.bundesbank.de/glr2> > Download-Bereich am Ende der Seite, Kundeninformationen, Dokument „Bilanzstatistik Rundschreiben Nr. 29/2016 sowie den Anlagen 1 und 2 und Ergänzungen“).

## **3. GLRG-II: Korrekturen für bereits eingereichte Y2-Meldebögen**

Gemäß dem Dokument "Unverbindlicher Zeitplan für die zweite Serie der gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäfte (GLRG II)" sind zu dem unter Punkt 1 genannten Termin Y2-Meldebögen „im Einklang mit den Meldedaten zur monatlichen Bilanzstatistik der Banken für den Meldetermin Juli 2016 stehenden Datenstand“ einzureichen. Das bedeutet für alle Institute, welche bereits einen Y2-Meldebogen für den Berichtszeitraum 1. Februar 2015 bis 31. Januar 2016 (Erstes Meldeschema) eingereicht haben, dass ggf. ein revidierter Y2-Meldebogen bis zum 05.09.2016, 15:30 Uhr über die Korrekturfunktion im AMS einzureichen ist. Für einen Korrekturbedarf könnten z.B. (rückwirkende) Korrekturen der monatlichen Bilanzstatistik (BISTA) bis einschließlich BISTA-Berichtsmonat Juli 2016 ursächlich sein. Sofern aufgrund neuer Erkenntnisse (z. B. der internen Revision oder der Wirtschaftsprüfer) zusätzlich auch Korrekturen der Meldungen zur monatlichen Bilanzstatistik einzureichen sind, bitten wir Sie, uns vorab per E-Mail an [extranet-S100@bundesbank.de](mailto:extranet-S100@bundesbank.de) sowie [statistik-glr2@bundesbank.de](mailto:statistik-glr2@bundesbank.de) zu informieren, um in diesem Fall das weitere Verfahren abzustimmen. Die E-Mail ist in der Betreffzeile mit „Y2- MFI-Code der betroffenen Bank – Rückwirkende BISTA-Korrekturen (Zeitraum der Korrekturen)“ zu kennzeichnen.

Institute, welche von der Regelung unter Punkt 5.2.1.2 des Bundesbank-Rundschreibens Nr. 29/2016 Gebrauch gemacht haben („Datenübernahme als Substitut für die Einreichung des Ersten Meldeschemas Y2“) und rückwirkenden Korrekturbedarf sehen, bitten wir uns ebenfalls per E-Mail an **statistik-glr@bundesbank.de** zu informieren. Die E-Mail ist in der Betreffzeile mit Y1 / Y2 – MFI-Code der betroffenen Bank – Rückwirkender Korrekturbedarf (Zeitraum der Korrekturen) zu kennzeichnen. Im Falle eines Korrekturbedarfs, der ab dem 01.09.2016 festgestellt wird, der den Meldezeitraum des Ersten Meldeschemas 2/2015-1/2016 betrifft und bei dem das betroffene Institut die Berechnungsoption (siehe vorgenannten Punkt 5.2.1.2. des Rundschreibens Nr. 29/2016) genutzt haben, ist ein Y2-Meldeschema für den Zeitraum 2/2015 bis 1/2016 einzureichen; die Einreichung der vier dreimonatigen Y1-Meldeschemata für den korrespondierenden Zeitraum ist nicht erforderlich.

#### **4. GLRG-II: Bereinigung von Wechselkursschwankungen (Zeile 321 des Meldeschemas Y2)**

Auf der Internetseite unter **<http://www.bundesbank.de/glr2>** > Downloadbereich > Kundeninformationen > Dokument „Ergänzung zum Rundschreiben Nr. 29/2016: GLRG-II-Ausfüllhilfe Wechselkursanpassungen (Y2 Zeile 321)“ finden Sie als Hilfestellung zur näherungsweise Ermittlung des Einflusses der Wechselkursschwankungen eine Exceldatei. Bitte beachten Sie die gesonderten Hinweise in der zugehörigen pdf-Datei. Vorsorglich weisen wir darauf hin, dass sich die Angaben des Vordrucks R11 aus dem Auslandsstatus der Banken **nur auf das Eurowährungsgebiet** (und nicht auf das gesamte Ausland) beziehen.

#### **5. GLRG-II: Auswirkungen von rechtlichen Fusionen seit Einreichung des Y2-Meldebogens**

Alle Institute, welche seit dem 17. Juni 2016 rechtlich fusioniert haben, verweisen wir nochmals auf Punkt 7.2 des Bundesbank-Rundschreibens Nr. 29/2016 und bitten – sofern noch nicht erfolgt – um Kontaktaufnahme via E-Mail an **statistik-glr@bundesbank.de**. Die E-Mail ist in der Betreffzeile mit „Y2 – MFI-Codes der betroffenen Banken – Fusion“ zu kennzeichnen. Dies gilt auch für Institute, welche beabsichtigen, an GLRG-II.3 teilzunehmen und im weiteren Jahresverlauf rechtlich fusionieren werden.

## 6. GLRG-1: Ende der Berichtspflicht

Die vormals unter <http://www.bundesbank.de/glrgs> bekanntgegebenen Einreichungstermine für Y1-Meldungen für den Zeitraum nach der Durchführung des GLRG-1.8 der ersten Serie sind hinfällig. Mit Beschluss der EZB (EZB/2016/11) vom 28.04.2016 wurde Artikel 8, Absatz 4 der Verordnung (EZB/2014/34) entsprechend angepasst (<http://www.bundesbank.de/glrgs> > „GLRG-I-Rechtsakt“ auf dem rechten Teil der Seite). Für Termine nach dem per 04.2016 endenden Berichtszeitraum sind keine Y1-Meldungen mehr einzureichen (d. h. es sind bereits für den Berichtszeitraum 1. Mai bis 31. Juli 2016 (07.2016) keine Meldungen mehr im AMS zu erfassen).

Vorsorglich weisen wir darauf hin, dass wir uns das Recht vorbehalten, Korrekturen<sup>1</sup> für die Berichtszeiträume von 04.2014 bis 04.2016 anzufordern, sofern noch keine vollständige Rückzahlung aller ausstehenden Volumina erfolgt ist.

Mit freundlichen Grüßen

Deutsche Bundesbank  
Brunken Lengelsen



Beglaubigt:  
*S. Perilli*  
Tarifbeschäftigte

<sup>1</sup> Ursächlich dafür könnten beispielsweise Prüfbemerkungen aus den noch ausstehenden Prüfberichten sein.