

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

22. Oktober 2014

Rundschreiben Nr. 62/2014

Bilanzstatistik

hier: Berichtspflichten für Banken (MFIs), die an den gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften (GLRGs) des Eurosystems mit vierjähriger Laufzeit und vorzeitiger Rückzahlungsoption teilnehmen

- Informationen zur elektronischen Einreichung der Meldedaten für die Berichtsperiode August 2014 bis Oktober 2014

Sehr geehrte Damen und Herren,

mit den Bundesbank-Rundschreiben Nr. 45/2014¹ vom 23. Juli 2014 und Nr. 51/2014² vom 20. August 2014 hatten wir die zur monatlichen Bilanzstatistik (BISTA) meldepflichtigen Banken (MFIs) über technische Umsetzungsfragen zu den Berichtspflichten, die sich für die Teilnehmer an den GLRGs ergeben, informiert.

¹

http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Bundesbank/Aufgaben_und_Organisation/Rundschreiben/2014/2014_07_23_rs_45.pdf?__blob=publicationFile

²

http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Bundesbank/Aufgaben_und_Organisation/Rundschreiben/2014/2014_08_20_rs_51.pdf?__blob=publicationFile

Die Deutsche Bundesbank stellt alle relevanten Informationen zu den GLRGs auf ihrer Internetseite unter „Aufgaben > Geldpolitik > Offenmarktgeschäfte > Gezielte längerfristige Refinanzierungsgeschäfte“³ bereit⁴. Die Seite wird laufend aktualisiert.

Banken (MFIs), die nicht an den GLRGs teilnehmen, sind von dem vorliegenden Rundschreiben nicht betroffen. Wir bitten diese Banken (MFIs) lediglich, den „Antwortbogen zur Teilnahme an den GLRGs des Eurosystems“⁵ – sofern noch nicht geschehen – mit einem „nein“ versehen an die Bundesbank zurück zu faxen.

1 Erforderliche Bilanzdaten im Rahmen des zweiten GLRGs

1.1 GLRG-1-Teilnehmer

GLRG-1-Teilnehmer sind Banken (MFIs), die im August 2014 bereits Y1-Meldeschemata für die Berichtsperioden bzw. -zeiträume⁶ „Mai 2013 bis April 2014“ und „Mai 2014 bis Juli 2014“ eingereicht hatten. Die Bundesbank teilte diesen Banken im Nachgang ein GLRG-Kreditlimit mit, aufgrund dessen sie ein Gebot für das erste GLRG abgaben, das maximal in Höhe des GLRG-Kreditlimits⁷ zugeteilt wurde.

GLRG-1-Teilnehmer müssen bis **spätestens 20. November 2014, 15:30 Uhr** über das elektronische Meldeportal AMS (siehe Punkt 3.1) einen Y1-Meldebogen einreichen, der die Berichtsperiode

1. August 2014 (mit Ultimo-Stand 31.07.2014) bis 31. Oktober 2014

(technische Anmerkungen zur Befüllung des Y1-Meldeschemas: „Stand Ende (letzter erfasster Berichtsmonat)“ ⇒ „10.2014“; Kennziffer 906 = „3“)

umfasst.

³ http://www.bundesbank.de/Navigation/DE/Aufgaben/Geldpolitik/Offenmarktgeschaeft/Gezielte_laengerfristige_Refinanzierungsgeschaeft/gezielte_laengerfristige_refinanzierungsgeschaeft.html; siehe insbesondere die Besonderen Geschäftsbedingungen der Deutschen Bundesbank für GLRGs: http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Geldpolitik/glr_g_bedingungen.pdf?__blob=publicationFile

⁴ Die EZB stellt unter „Monetary Policy > Instruments > Open market operations > Targeted LTROs“ (<http://www.ecb.europa.eu/mopo/implement/omo/html/index.en.html>) ebenfalls Informationen zu den GLRGs bereit.

⁵ http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Geldpolitik/glr_g_antwortbogen_ittro.pdf?__blob=publicationFile; bei dem Antwortbogen handelt es sich um eine Anlage zur Kundeninformation der Bundesbank an die geldpolitischen Geschäftspartner vom 11. Juli 2014 (http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Aufgaben/Geldpolitik/glr_g_kundenanschreiben_2014_07_11.pdf?__blob=publicationFile)

⁶ nachfolgend: Berichtsperioden

⁷ Im ersten GLRG nicht genutzte Teile des Kreditlimits können im zweiten GLRG abgerufen werden.

1.2 GLRG-1-Melder

GLRG-1-Melder sind Banken (MFIs), die im August 2014 bereits Y1-Meldeschemata für die Berichtsperioden „Mai 2013 bis April 2014“ und „Mai 2014 bis Juli 2014“ eingereicht und im Nachgang durch die Bundesbank ein GLRG-Kreditlimit mitgeteilt bekommen, die aber anschließend im Rahmen der Bietungsphase kein (gültiges) GLRG-1-Gebot abgegeben haben.

GLRG-1-Melder, die nun am zweiten GLRG teilnehmen möchten, müssen bis **spätestens 20. November 2014, 15:30 Uhr** die gleiche Meldung einreichen wie die GLRG-1-Teilnehmer (siehe vorstehend).

GLRG-1-Melder, die auch am zweiten GLRG nicht teilnehmen möchten, reichen für die aktuelle und für alle zukünftigen Berichtsperioden keine weiteren Y1-Meldungen ein.⁸

1.3 GLRG-2-Melder

GLRG-2-Melder sind Banken (MFIs), die im Vorfeld des ersten GLRG im August 2014 noch keine Y1-Meldeschemata eingereicht haben, nun aber beabsichtigen, an dem zweiten GLRG teilzunehmen. Diese Banken müssen bis **spätestens 20. November 2014, 15:30 Uhr** über das o. g. elektronische Meldeportal AMS **drei** Y1-Meldebögen für folgende Zeiträume einreichen.

- **(A): 1. Mai 2013 (mit Ultimo-Stand 30.04.2013) bis 30. April 2014** (technische Anmerkungen zur Befüllung des Y1-Meldeschemas: „Stand Ende (letzter erfasster Berichtsmonat)“ ⇒ „4.2014“; Kennziffer 906 = „12“)
- **(B): 1. Mai 2014 (mit Ultimo-Stand 30.04.2014) bis 31. Juli 2014** (technische Anmerkungen zur Befüllung des Y1-Meldeschemas: „Stand Ende (letzter erfasster Berichtsmonat)“ ⇒ „7.2014“; Kennziffer 906 = „3“)
- **(C): 1. August 2014 (mit Ultimo-Stand 31.07.2014) bis 31. Oktober 2014** (technische Anmerkungen zur Befüllung des Y1-Meldeschemas: „Stand Ende (letzter erfasster Berichtsmonat)“ ⇒ „10.2014“; Kennziffer 906 = „3“)

Die Teilmeldungen (A) und (B) können ab sofort (wir empfehlen noch im Oktober 2014) über AMS gemeldet werden.

Wir bitten alle GLRG-2-Melder – sofern noch nicht geschehen – die Bundesbank möglichst umgehend durch Rücksendung des „Antwortbogens zur Teilnahme an den GLRGs des Eurosystems“ (siehe Fußnote 5) über ihr Teilnahmeinteresse an dem zweiten GLRG zu informieren.

⁸ Eine Meldepflicht würde sich (rückwirkend) ergeben, wenn sich eine Bank entschließen sollte, an den GLRG-Geschäften 3 bis 8 teilzunehmen, ohne an den ersten beiden GLRGs teilgenommen zu haben.

Dies ermöglicht der Bundesbank eine – ggf. erforderliche – frühzeitige Kontaktaufnahme mit dem Institut. Wir weisen darauf hin, dass eine Interessensbekundung keine Teilnahmeverpflichtung darstellt.

1.4 Meldung revidierter Daten

Sollte sich Korrekturbedarf zu Y1-Meldungen ergeben, die bereits an die Deutsche Bundesbank versendet wurden, so bitten wir Folgendes zu beachten:

- **Korrekturen zu Y1-Meldungen für die zurückliegenden Berichtsperioden „Mai 2013 bis April 2014“ und „Mai 2014 bis Juli 2014“** sind von GLRG-1-Meldern händisch auf dem PDF-Ausdruck, der in dem Meldeportal AMS, Rubrik „Erstellte Meldungen“ bereitsteht, vorzunehmen. Die korrigierte Meldung ist als E-Mail-Anhang an **bista-s100@bundesbank.de** zu übersenden, wobei die E-Mail in der Betreffzeile mit „Y1 – MFI-Code – Termin – Korrektur“⁹ zu kennzeichnen ist. GLRG-2-Melder korrigieren o. g. Meldungen ausschließlich im Meldeportal AMS.
- **Korrekturen zu Y1-Meldungen für den aktuellen Meldetermin „August 2014 bis Oktober 2014“** nehmen GLRG-Melder ausschließlich über die Korrekturfunktion (im Menüpunkt „Erstellte Meldungen“) des Meldeportals AMS vor.

1.5 Fusionen

Banken (MFIs), die erstmals am zweiten GLRG teilnehmen möchten und sich in einem Fusionsprozess befinden, der zwar rechtlich aber noch nicht „meldetechnisch“ abgeschlossen wurde¹⁰, bitten wir um möglichst baldige Kontaktaufnahme via E-Mail an **bista-s100@bundesbank.de**. Die E-Mail ist in der Betreffzeile mit „Y1 – MFI-Codes der betroffenen Bank – 2014-10 – Fusion“¹¹ zu kennzeichnen.

1.6 Zukünftige Berichtsperioden und Einreichungsfristen

Bis zur Endfälligkeit der acht GLRGs am 26. September 2018 sind in den Monaten Februar, Mai, August, November Y1-Meldeschemata einzureichen.¹² Die Meldungen umfassen jeweils ein Quartal (bestehend aus den drei abgeschlossenen Monaten, die dem Einreichungsmonat vorausgehen).¹³

⁹ Beispiel: „Y1 – DE09999 – 2014-04 – Korrektur“

¹⁰ D. h. für einen Übergangszeitraum werden noch getrennte bankstatistische Meldungen eingereicht.

¹¹ Beispiel: „Y1 – DE09998 / DE09999 – 2014-10 – Fusion“

¹² Eine Abweichung ergibt sich für die letzte Berichtsperiode im Jahr 2018.

¹³ Das letzte im Jahr 2018 einzureichende Y1-Meldeschema umfasst nur zwei Berichtsmonate.

Die genauen Einreichungsfristen zu den einzelnen Meldeterminen werden wir in einem gesonderten Rundschreiben bekanntgeben, sobald die EZB hierzu detaillierte Informationen veröffentlicht hat.

2 Anmerkungen zur Befüllung des Meldeschemas Y1

Nachfolgend finden Sie einige Erläuterungen zu Fragen, die wir im Zusammenhang mit der Durchführung der GLRGs wiederholt erhalten haben.

- Das Meldeschema Y1 ist **vollständig auszufüllen**; dies gilt insbesondere für die Zeilen 210, 220 und 200. Es gelten die Formalprüfungen der Anlage 2 des o. g. Rundschreibens Nr. 45/2014. Die elektronische Übermittlung der in der AMS-Erfassungsmaske Y1 eingetragenen Daten ist erst dann möglich, wenn alle Y1-internen Formalprüfungen erfüllt sind.
- Für die meisten Banken (MFIs) dürfte es zweckmäßig sein, die Befüllung des Meldeschemas Y1 durch Umformung der in Anlage 2 des o. g. Rundschreibens Nr. 45/2014 genannten **Gleichungs-Nummern 19 bzw. 21** vorzunehmen. Nach **Umformung des Terms** ergibt sich $Y1.200/0x = Y1.400/0x - Y1.100/0x - Y1.300/0x$. Die nun auf der rechten Seite der Gleichung stehenden Zeilen-Nummern dürften von vielen – insbesondere kleineren – Banken (MFIs) vollständig aufgrund von BISTA-Daten befüllt werden können. Zur Befüllung der Zeile 200, aber auch der zugehörigen Zeilen 210 und 220, verweisen wir insbesondere auf Anlage II, 4. Definitionen, b) „Anrechenbare Nettokreditvergabe“ des Beschlusses der Europäischen Zentralbank vom 29. Juli 2014 über Maßnahmen im Zusammenhang mit gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften (EZB/2013/34)¹⁴.
- Das Meldeschema Y1 enthält die Kennziffern 901, 902, 903, 905 und 906. In einigen Formalprüfungen der Anlage 2 des Rundschreibens Nr. 45/2014 wird, nach dem **Zusatz: „gilt für folgende Kennzifferausprägungen:“**, ebenfalls auf – teilweise gleichlautende – Kennziffern verwiesen. Bitte beachten Sie, dass sich die Kennziffern in diesen Fällen nicht auf das Meldeschema Y1, sondern auf das **im jeweiligen Fall betroffene BISTA-Meldeschema beziehen**. Dies soll an einem Beispiel verdeutlicht werden: Die Gleichungs-Nummer 27, Spalte „rechte Seite“ enthält die Beschreibung „P1.114/04 + P1.114/05 + P1.414/04 + P1.414/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = alle; 906 = alle“; die genannten Kennziffern 904, 905 und 906 beziehen sich auf das BISTA-Meldeschema P1 und nicht auf das Meldeschema Y1.

¹⁴ http://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/PDF/?uri=OJ:JOL_2014_258_R_0006&from=DE

- In den Summenzeilen 200 und 300 sind **kumulierte Werte über die gesamte Berichtsperiode**¹⁵ einzutragen; z. B. „Summe der Bewertungskorrekturen über die Anzahl der Monate“ für die Anwahlpositionen Y1.322/01 und Y1.322/02. In den Abschnitten mit den Summenzeilen 100 und 400 sind **Stände** zum Beginn (Ultimo vor Beginn der Berichtsperiode) bzw. zum Ende der Berichtsperiode zu melden.
- Die Zeilen 130 und 430 des Meldeschemas Y1 haben einen **optionalen** Charakter. Werden dort Werte eingetragen, können die in Anlage 2 zum o. g. Rundschreiben Nr. 45/2014 vorgegebenen **Plausibilitätsprüfungen nur sehr eingeschränkt genutzt werden**. In diesen Fällen muss die Datenqualität anhand der bei der jeweiligen Bank (MFI) hausintern verfügbaren Daten sichergestellt werden; die Bundesbank wird in diesen Fällen zusätzliche Unterlagen anfordern.

3 Technische Voraussetzungen und organisatorische Rahmenbedingungen der Dateneinreichung

3.1 Elektronische Einreichung der Bilanzdaten

Die Einreichung des Meldeschemas Y1 erfolgt elektronisch über das „Allgemeine Meldeportal Statistik“ (AMS) der Deutschen Bundesbank. AMS bietet die Möglichkeit, Daten online zu erfassen und an die Deutsche Bundesbank zu übermitteln. Eine Kurzanleitung zur Y1-Meldungseinreichung über das AMS finden Sie in der Anlage zum o. g. Rundschreiben Nr. 51/2014.

3.2 Dritteinreichungen

Banken (MFIs) können im AMS auch Meldedaten für Dritte einreichen. Eine telefonische Hilfeleistung bei der Einrichtung erhalten Sie unter den Telefon-Nummern 069/9566-2350 bzw. -2351. Bitte beachten Sie, dass Banken, die für sie verbindliche Meldedaten durch einen „Dienstleister“ einreichen lassen möchten, im Vorfeld der Datenübermittlung eine „Zurechnungserklärung zur elektronischen Einreichung (bank)statistischer Meldungen über das ExtraNet der Deutschen Bundesbank“¹⁶ abgeben müssen.

3.3 Besonderheiten für GLRG-Bietergruppen mit deutschen GLRG-Leitinstituten

Bezüglich der Einreichungswege für die Meldedaten der „ausländischen Gruppenmitglieder einer GLRG-Gruppe mit deutschem Leitinstitut“¹⁷ und der „aggregierten GLRG-Gruppenmeldung

¹⁵ Zur Länge der Berichtsperiode vgl. die Y1-Kennziffer 906.

¹⁶ https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Service/Meldewesen/Bankenstatistik/XML/zurechnungserklaerung.pdf?__blob=publicationFile

¹⁷ Y1: Kennziffer 905, Kennzifferausprägung = 2; Kennziffer 902 = Angabe des MFI-Codes des bietungsberechtigten Leitinstituts

des deutschen Leitinstituts“¹⁸ wird die Deutsche Bundesbank direkt Kontakt mit den betroffenen GLRG-Leitinstitutionen aufnehmen.

3.4 Anmerkungen zu technischen Anforderungen

3.4.1 Verwendete Internet-Browser

Im Rahmen der ersten Dateneinreichungsphase im August 2014 traten im AMS vereinzelt Probleme bei der Bearbeitung und Versendung der erstellten Y1-Meldungen auf. Im Nachgang wurde die AMS-Software von der Bundesbank weiterentwickelt. Beachten Sie zusätzlich folgende Hinweise:

- Bei Verwendung älterer Browser-Versionen traten gelegentlich Probleme bei der Erstellung bzw. Versendung von Y1-Meldungen auf. In diesen Fällen empfehlen wir, entweder eine aktuelle Version oder alternative Browser zu verwenden.
- Die JavaScript-Funktion des Browsers muss aktiviert sein.¹⁹
- Bei Verwendung des Internet Explorers traten gelegentlich Probleme bei der Anzeige des Y1-Meldeschemas auf, wenn der Zoommodus²⁰ einen zu hohen Wert hatte; wir empfehlen die Einstellung von 100 %.

3.4.2 Voraussetzungen für die elektronische Dateneinreichung über AMS

Zur elektronischen Einreichung des Meldeschemas Y1 benötigen MitarbeiterInnen der GLRG-Teilnehmerbanken eine Zugriffsberechtigung auf das AMS (Benutzername (UserID) und Passwort). Wir legen allen zuständigen Meldewesen-MitarbeiterInnen nahe zu prüfen, ob sie über die im o. g. Rundschreiben Nr. 51/2014, Abschnitt „Technische Voraussetzungen für die elektronische Dateneinreichung über AMS“ beschriebenen Zugriffsrechte verfügen. Sollte dies nicht der Fall sein, so empfehlen wir eine schnellstmögliche Registrierung.

¹⁸ Y1: Kennziffer 905, Kennzifferausprägung = 4; Kennziffer 902 = Angabe des MFI-Codes des bietungsberechtigten Leitinstituts

¹⁹ Beispielhaft:

Beim Internet Explorer 8 bitte über Extras > Internetoptionen > Sicherheit > Zone „Internet“ auswählen > Stufe anpassen > das Häkchen bei Active Scripting auf „Aktivieren“ setzen.

Beim Mozilla Firefox 17 bitte über Extras > Einstellungen > Inhalt > das Häkchen bei „JavaScript aktivieren“ setzen.

Kann aufgrund von fehlenden Berechtigungen JavaScript nicht selbständig aktiviert werden, kontaktieren Sie bitte ihre zuständige IT-Abteilung.

²⁰ Beim Internet Explorer 8: Ansicht > Zoom > 100 %

3.4.3 Technische Voraussetzungen für die Teilnahme an Offenmarktgeschäften des Eurosystems

GLRG-2-Melder, die bislang nicht über das OffenMarkt Tender Operations-System (OMTOS) der Bundesbank an Offenmarktgeschäften des Eurosystems teilgenommen haben, sollten möglichst umgehend prüfen, ob sie die erforderlichen technischen Voraussetzungen (PM-Konto, Sicherheitenkonto, etc.) erfüllen.²¹

3.5 Fristgerechte Dateneinreichung

Bitte beachten Sie, dass eine **verspätete Einreichung des bzw. der Meldeschema(ta)s nicht möglich** ist. Wir empfehlen daher eine frühzeitige Datenübermittlung an die Bundesbank. Bei auftretenden (technischen) Problemen im Rahmen der Dateneinreichung wenden Sie sich bitte **vor Ablauf der Einreichungsfrist** an die E-Mail-Adresse **extranet-s100@bundesbank.de** bzw. die Fax-Nummer **[+49] 69 / 9566-50-9843**.

Mit freundlichen Grüßen

Deutsche Bundesbank
Michalik-Ringenaldus Conrad



Beglaubigt:
M. Bayer
Tarifbeschäftigte

²¹ Ansprechpartner zu Fragen finden Sie auf unserer Internetseite unter http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Service/Services_Banken_Unternehmen/OMTOS/omtos_ansprechpartner.pdf?__blob=publicationFile