

Plausibilitätsprüfungen für die Statistik über Wertpapierinvestments – Konzernmeldung

Stand Januar 2025

Änderungen zur Vorgängerversion sind in rot gekennzeichnet.

Abweisenchecks

Die nachfolgenden Plausibilitätsprüfungen werden unmittelbar nach der elektronischen Einreichung der XML-Datei via Bundesbank ExtraNet durchgeführt. Ein Fehler in einer der Plausibilitätsprüfungen führt zur Abweisung der eingereichten Meldung und der Zustellung eines entsprechenden Fehlerprotokolls.

Zu einigen Beschreibungen der Prüfungen sind aus Gründen der Übersichtlichkeit die Kurznamen der betroffenen Attribute sowie die Codes der jeweiligen Ausprägungen verwendet worden. Die entsprechenden Überleitungen und Codelisten können der XML-Formatbeschreibung auf der Bundesbank-Website entnommen werden.

Nr.	Beschreibung der zu implementierenden Prüfung
BSM.00	<p>XML-Fehler (Validierung) Eine XML-Datei muss bestimmte formale Kriterien erfüllen. Nähere Informationen zum XML-Dateiformat finden Sie auf unserer Bundesbank-Website (www.bundesbank.de) unter „Service > Meldewesen > Bankenstatistik > Formate XML“</p>
BSM.06	<p>Meldetermin Der angegebene Meldetermin darf nicht nach dem aktuellen Datum bzw. vor September 2018 liegen. [Hinweis: Während der Testphase ist die Prüfung nicht aktiv]</p>
BSM.07	<p>Unbekannte Einreichernummer Die Leitzahl des Einreichers (im Unterelement <ABSENDER> der XML-Datei) muss hinterlegt sein. Die Leitzahl für MFIs und „sonstige Kreditinstitute“ ist die achtstellige Bankleitzahl mit Prüzfiffer (neunstellig) und für Rechenzentren oder andere Dienstleister die Rechenzentrums-Leitzahl (R gefolgt von acht Ziffern).</p>
BSM.08	<p>Unbekannte Meldernummer Die Leitzahl des meldepflichtigen Instituts (im Unterelement <MELDER> der XML-Datei) muss hinterlegt sein. Die Leitzahl für MFIs und „sonstige Kreditinstitute“ ist die achtstellige Bankleitzahl mit Prüzfiffer (neunstellig) und für Kapitalanlagegesellschaften die dreistellige Nummer.</p>

Nr.	Beschreibung der zu implementierenden Prüfung
WPI.06	<p>Nominalwährung/Stück Bei Prozent-Notiz und Promille-Notiz ist die Nominalwährung/Depotwährung in der Abkürzung des dreistelligen ISO-Währungsco-des anzugeben. Nutzer der WM-Gattungsdatei können das WM-Datenfeld GD171 (Depotwährung/ISO) verwenden. Informationen zur Effektennotiz enthält das WM-Datenfeld GD440. Es dürfen nur gültige ISO-Währungsco-des verwendet werden.</p>
WPI.08	<p>WP-Kurswährung (gilt nur für interne Wertpapiere) Die WP-Kurswährung ist in der Abkürzung des dreistelligen ISO-Währungsco-des (Beispiel: Euro – EUR) anzugeben, wie es das WM-Datenfeld GD172 (Abrechnungswährung/ISO) für Papiere mit Kenn-Nummern vorsieht. Es dürfen nur gültige ISO-Währungsco-des verwendet werden.</p>
WPI.13	<p>Mehrfache Meldung einer ISIN bzw. Internen WKN Jede ISIN bzw. Interne WKN darf nur einmal vorkommen. Gleiche ISINs bzw. Interne WKNs sind zusammenzuführen.</p>
WPI.14	<p>Teilaggregation Bei gleichartigen Datensätzen ist eine Teilaggregation durchzuführen, d. h. Datensätze mit identischen Primärschlüsseln (siehe XML-Formatbeschreibung) sind betragsmäßig zusammenzufassen. Gleichartige Datensätze dürfen nur einmal in der Meldung aufgeführt werden.</p>
WPI.17A WPI.17B WPI.18	<p>Gruppe Der Schlüssel (GRUPPEN_ID, UNTERNEHMEN_ID) muss einzigartig sein. Wenn zu einem Unternehmen Bestände gemeldet werden, dann muss die betroffene UNTERNEHMEN_ID auch als Unternehmensbestandteil der Konzernstruktur gemeldet werden. Die gemeldete Gruppe (im Unterelement <REP_GRUPPE> der XML-Datei) muss zur Melder-Leitzahl passen.</p>
WPI.19	<p>Sitzland des Unternehmens Für das Sitzland des Unternehmens ist der zweistellige ISO-Ländercode zu verwenden. Es dürfen nur gültige ISO Ländercodes verwendet werden.</p>
WPI.20	<p>Gruppeninterne Emission Wenn EM_GRUPPE_AUFSICHT="Ja", dann muss EM_GRUPPE_BILANZ="Ja" sein.</p>

Nr.	Beschreibung der zu implementierenden Prüfung
<p>WPI.34</p>	<p>Loss Given Default (LGD) <i>bis zum Meldetermin 201902:</i> Wenn KPTL_BRCHNNG in ("19","33","34","66","67") und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" <i>ab dem Meldetermin 201903:</i> Wenn KPTL_BRCHNNG in ("19","33","34","66","67","118") und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" <i>ab dem Meldetermin 202001:</i> Wenn RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <> "99" KPTL_BRCHNNG in ("33","34","66","67","118") und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND>0, dann dürfen LGD_NRML und LGD_ABSCHW nicht leer sein.</p> <p>WPI.35 Wenn LGD_ABSCHW und LGD_NRML nicht leer sind, dann muss LGD_ABSCHW >= LGD_NRML sein.</p>
<p>WPI.36</p>	<p>Risikogewicht <i>bis zum Meldetermin 201902:</i> Wenn KPTL_BRCHNNG in ("1","18","25","30","35","42","68") und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND>0, dann darf RSK_GWCHT nicht leer sein. <i>ab dem Meldetermin 201903:</i> Wenn KPTL_BRCHNNG in ("1","18","25","30","35","42","68","122","125") und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND>0, dann darf RSK_GWCHT nicht leer sein. <i>ab dem Meldetermin 202001:</i> Wenn RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <> "99" KPTL_BRCHNNG in ("1","20","25","35","42","68","122","125") und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND>0, dann darf RSK_GWCHT nicht leer sein.</p>
<p>WPI.37A</p> <p>WPI.37B</p>	<p>Länder-Listen (gilt nur für interne Wertpapiere) Für das Sitzland des Emittenten ist der zweistellige ISO-Ländercode zu verwenden. Es dürfen nur gültige ISO Ländercodes verwendet werden. Für den Belegenheitsort der Sicherheit ist der Code gemäß Code-Liste zu verwenden. Es dürfen nur gültige Codes verwendet werden.</p>
<p>WPI.38</p> <p>WPI.39</p> <p>WPI.40</p>	<p>Legal Entity Identifier (LEI) (gilt nur für interne Wertpapiere) Wenn EM_LEI <> "_X", dann muss die Länge von EM_LEI 20 sein und der Prüfalgorithmus ISO/IEC 7064 (MOD 97-10) muss erfolgreich durchgeführt werden. Wenn GRNTGBR_TYPE="LEI", dann muss die Länge von GRNTGBR_ID = 20 sein und der Prüfalgorithmus ISO/IEC 7064 (97-10) muss erfolgreich durchgeführt werden. Wenn EM_ID_TYPE="LEI", dann muss die Länge von EM_ID=20 sein und der Prüfalgorithmus ISO/IEC 7064 (97-10) muss erfolgreich durchgeführt werden.</p>

Nr.	Beschreibung der zu implementierenden Prüfung
WPI.41 WPI.42	Primäre Vermögenswert-Klassifizierung (gilt nur für interne Wertpapiere) Wenn WPART in ("F_31","F_32"), dann muss VRMGNSWRT_KLSSFZRNNG mit "D" beginnen. Wenn WPART in ("F_511","F_512","F_52"), dann muss VRMGNSWRT_KLSSFZRNNG mit "E" oder "F" beginnen.
WPI.43 WPI.44	Datum nach Laufzeitbeginn (gilt nur für interne Wertpapiere) Das Datum des Wertpapierstatus darf nicht vor dem Laufzeitbeginn liegen. Das Datum der Rückstände für das Instrument darf nicht vor dem Laufzeitbeginn liegen.
WPI.45 WPI.46	Rückstände für das Instrument (gilt nur für interne Wertpapiere) Wenn WPART mit "F_51" beginnt, dann muss RCKSTND=0 sein. Wenn RCKSTND nicht leer ist, dann muss RCKSTND>=0 sein.
WPI.47	Buchwert Wenn EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND>0, dann darf BUCHWERT nicht leer sein.
WPI.48	Art der Wertminderung Wenn WRTMNRNG_KMLRT>0, dann dürfen WRTMNRNG_ART und BWRTNG_WRTMNRNG nicht ="0" sein.
WPI.49	Kumulierte Rückflüsse seit Ausfall Wenn AUSFALL_STTS_EM nicht in ("18","19","20"), dann muss RCKFLSS_KMLRT="0" sein.
WPI.50	Wert der Forderungsposition (Exposure at Default) Wenn PORTFOLIO_AUFSICHT = "2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND>0, dann darf FRDRNG_WRT nicht leer sein.
WPI.51 WPI.52 WPI.53	Forderungsklasse Wenn RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <>"99" und KPTL_BRCHNNG <> "99" und PORTFOLIO_AUFSICHT="2" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="Nein" und BESTAND >= 0, dann muss FRDRNG_KLSS <> 0 sein. Wenn KPTL_BRCHNNG nicht in ("0","42"), dann muss FRDRNG_KLSS in ("0","51","52","53","54","55","56","57","58","59","60","61") sein. bis zum Meldetermin 201912: Wenn KPTL_BRCHNNG in "42", dann muss FRDRNG_KLSS in ("0","1","2","3","4","5","6","7","8","9","10","11","12","13","14","15","16","17") ab dem Meldetermin 202001: Wenn KPTL_BRCHNNG in "42", dann muss FRDRNG_KLSS in ("0","1","2","3","4","5","6","7","8","9","10","11","12","13","14","16","17","57") sein.

Nr.	Beschreibung der zu implementierenden Prüfung
WPI.54A WPI.54B	Ansatz zur Berechnung des Kapitals für Aufsichtszwecke Die Codes "118", "122" und "125" für das Attribut KPTL_BRCHNNG sollen erst ab dem Meldetermin 201903 gemeldet werden Die Codes "18", "19" und "30" für das Attribut KPTL_BRCHNNG sollen nur bis zum Meldetermin 201912 gemeldet werden.
WPI.54C	Forderungsklasse <i>ab dem Meldetermin 202001</i> Der Code "15" für das Attribut FRDRNG_KLSS soll nur bis zum Meldetermin 201912 gemeldet werden. <i>ab dem Meldetermin 202501</i> Die Codes („18“, „19“, „20“, „21“, „22“, „23“, „24“, „25“, „26“, „27“, „28“, „29“, „30“, „31“, „62“, „63“, „64“, „65“, „66“, „67“, „68“, „69“, „70“, „71“) für das Attribut FRDRNG_KLSS dürfen erst ab Meldetermin 202501 gemeldet werden. <i>bis zum Meldetermin 202502</i> Die Codes „7“, „14“, „59“ und „61“ für das Attribut FRDRNG_KLSS können nur bis zum Meldetermin 202502 (einschließlich) gemeldet werden.

Einlesenchecks

Die nachfolgenden Plausibilitätsprüfungen werden nach der elektronischen Einreichung der XML-Datei via Bundesbank ExtraNet manuell durchgeführt. Ein Fehler in einer der Plausibilitätsprüfungen führt zu einer inhaltlichen Rückfrage zur eingereichten Meldung.

Zu einigen Beschreibungen der Prüfungen sind aus Gründen der Übersichtlichkeit die Kurznamen der betroffenen Attribute sowie die Codes der jeweiligen Ausprägungen verwendet worden. Die entsprechenden Überleitungen und Codelisten können der [XML-Formatbeschreibung](#) auf der Bundesbank-Website entnommen werden.

Hinweis: Bei den unten aufgeführten Einlesenchecks handelt es sich nicht um neue Plausibilitätsprüfungen, sondern lediglich um die erstmalige Veröffentlichung. Die Checks werden bereits größtenteils seit der Umstellung der Konzernstatistik (Meldetermin 201809) durchgeführt.

Nr.	Beschreibung der zu implementierenden Prüfung
K01	Abgleich der Zugehörigkeit der gemeldeten Gebernummern zum Konzern mit unserer internen Unternehmensdatenbank (RIAD).
K03	Abgleich des Sitzlandes der gemeldeten Gebernummern des Konzerns mit RIAD.
K04	Abgleich des Rechnungslegungsstandards der gemeldeten Gebernummern des Konzerns mit RIAD.

K06	Prüfung der Vollständigkeit der gemeldeten Gebernummern (Zu-/Abgänge).
K12	Prüfung, ob es sich bei den gemeldeten Wertpapieren ggf. um konzerninterne Emissionen handelt (Abgleich mit dem LEI).
K16	Wenn LSTNG_STTS in "1", "11" und/oder DT_LSTNG_STTS nicht leer oder STNDNG_STTS in "3","4","5","8","9" und/oder DT_STNDNG_STTS nicht leer oder WRTMNRNG_ART <> 0 oder BWRTNG_WRTMNRNG <> 0 oder WRTMNRNG_KMLRT <> 0 oder ZTWRT_KMLRT <> 0 oder RCKFLSS_KMLRT <> 0 dann muss WPART in "F_31", "F_32" sein.
K17	Wenn LGD_ABSCHW nicht leer ist, muss $0 \leq \text{LGD_ABSCHW} \leq 1,2$.
K18	Wenn LGD_NRML nicht leer ist, muss $0 \leq \text{LGD_NRML} \leq 1,2$.
K19A	Wenn LSTNG_STTS=1, dann darf DT_LSTNG_STTS nicht leer sein oder wenn $\text{LSTNG_STTTS} <> \text{LSTNG_STTS}$ (Vortermine) UND $\text{LSTNGS_STTUS} <> 0$, dann darf DT_LSTNG_STTS nicht leer sein.
K19B	Wenn AUSFALL_STTS_EM in "18","19","20", dann darf DT_AUSFALL_STTS_EM nicht leer sein, oder wenn $\text{AUSFALL_STTS_EM} <> \text{AUSFALL_STTS_EM}$ (Vortermine) UND $\text{AUSFALL_STTS_EM} <> 0$, dann darf DT_AUSFALL_STTS_EM nicht leer sein. DT_AUSFALL_STTS_EM keinen Wert enthalten, wenn $\text{AUSFALL_STTS_EM} = 0$.
K19C	Wenn AUSFALL_STTS_INSTRMNT in "18","19","20" ist, dann darf DT_AUSFALL_STTS_INSTRMNT nicht leer sein oder wenn $\text{AUSFALL_STTS_INSTRMNT} <> \text{AUSFALL_STTS_INSTRMNT}$ (Vortermine) UND $\text{AUSFALL_STTS_INSTRMNT} <> 0$, dann darf DT_AUSFALL_STTS_INSTRMNT nicht leer sein. DT_AUSFALL_STTS_INSTRMNT keinen Wert enthalten, wenn $\text{AUSFALL_STTS_INSTRMNT} = 0$.
K19D	Wenn STNDNG_STTS in "3","4","5","9", dann darf DT_STNDNG_STTS nicht leer sein oder wenn $\text{STNDNG_STTS} <> \text{STNDNG_STTS}$ (Vortermine) UND $\text{STNDNG_STTS} <> 0$, dann darf DT_STNDNG_STTS nicht leer sein.
K19E	Wenn $\text{WPSTATUS} <> \text{WPSTATUS}$ (Vortermine), dann muss $\text{DT_WPSTATUS} <> \text{WPSTATUS}$ (Vortermine) sein.
K19F	Wenn $\text{RCKSTND} <> 0$, dann darf DT_RCKSTND nicht leer sein oder wenn $\text{RCKSTND} <> \text{RCKSTND}$ (Vortermine), dann darf DT_RCKSTND nicht leer sein.
K19G	Wenn $\text{UNTERNEHMENSTATUS} = 100$, dann darf DT_UNTERNEHMENSTATUS nicht leer sein (i. d. R. Gründungsdatum des Unternehmens) oder wenn $\text{UNTERNEHMENSTATUS} <> \text{UNTERNEHMENSTATUS}$ (Vortermine), dann darf DT_UNTERNEHMENSTATUS nicht leer sein (i. d. R. das Datum, zu dem die Änderung eingetreten ist).
K19H	Wenn DT_AUSFALL_STTS_INSTRMNT gemeldet wird, dann muss $\text{DT_AUSFALL_STTS_INSTRMNT} \geq \text{Emissionsdatum}$ sein.
K20	Wenn $\text{VERBRFG_ART} = 0$, muss $\text{BLGNHT_ORT} = 0$; wenn $\text{VERBRFG_ART} \neq 0$, muss $\text{BLGNHT_ORT} \neq 0$.
K21	Vorterminevergleich der gemeldeten Stammdaten (z. B. Gruppeninterne Emission, Rechnungslegungsstandard).
K30A	Wenn $\text{WRTMNRNG_KMLRT} > 0$, dann muss WPART in ("F_31","F_32") sein.
K30B	ACCMLTD_IMPRMNT muss $\leq \text{NML_VL}$ (in EUR) sein.

K31	Wenn RCHNNGSLGNG_STNDRD_UNTERNEHMEN "2","3", dann muss RCHNNGSLGNG_KLSSFKTN "0","2","4","6","8","41","49","99" und WRTMNDRNG_ART in "0","23","24","25","57" sein. Wenn RCHNNGSLGNG_STNDRD_UNTERNEHMEN "1", dann muss RCHNNGSLGNG_KLSSFKTN "0","3","7","9","13","15","47","49","99" und WRTMNDRNG_ART in "0","21","26" sein.
K32	Wenn PORTFOLIO_AUFSICHT=2 und BESTAND > 0 und EM_GRUPPE_AUFSICHT="NEIN" und BUCHWERT <> 0 und RCHNNGSLGNG_KLSSFKTN <> 99 und KPTL_BRCHNNG <> 99, dann muss FRDRNG_WRT <> 0 sein.
K33A (Zusammen- legung mit WPI.52 und WPI.53)	<i>bis zum Meldetermin 202412</i> Wenn KPTL_BRCHNNG = "42", dann muss FRDRNG_KLSS in "0","1","2","3","4","5","6","7","8","9","10","11","12","13","14","15","16","17" Wenn KPTL_BRCHNNG "1","18","19","25","30","118","122","125", dann muss FRDRNG_KLSS in "0","15","57". Wenn KPTL_BRCHNNG "20","33","34","35","66","67","68", dann muss FRDRNG_KLSS "0","51","52","53","54","55","56","58","59","60","61" <i>ab dem Meldetermin 202501 und bis Meldetermin 202502</i> Wenn KPTL_BRCHNNG = "42", dann muss FRDRNG_KLSS in "0","1","2","3","4","5","6","7","8","9","10","11","12","13","14","16","17","18","19","20","21","22","23","24","25","26","27","28","29","30","31". Wenn KPTL_BRCHNNG "1","18","19","25","30","118","122","125", dann muss FRDRNG_KLSS in "0","15","57". Wenn KPTL_BRCHNNG "20","33","34","35","66","67","68", dann muss FRDRNG_KLSS "0","51","52","53","54","55","56","58","59","60","61","62","63","64","65","66","67","68","69","70","71". <i>ab dem Meldetermin 202503</i> Wenn KPTL_BRCHNNG = "42", dann muss FRDRNG_KLSS in "0","1","2","3","4","5","6","8","9","10","11","12","13","16","17","18","19","20","21","22","23","24","25","26","27","28","29","30","31". Wenn KPTL_BRCHNNG "1","18","19","25","30","118","122","125", dann muss FRDRNG_KLSS in "0","15","57". Wenn KPTL_BRCHNNG "20","33","34","35","66","67","68", dann muss FRDRNG_KLSS "0","51","52","53","54","55","56","58","60","62","63","64","65","66","67","68","69","70","71".
K33B	<i>ab Meldetermin 202503</i> FRDRNG_KLSS darf nicht in „17“, „59“, „60“, „61“, „62“, „63“, „64“, „65“, „66“, „67“ sein.
K34	Ableich von Buch- und Kurswert.
K35	Prüfung der eindeutigen Zuordnung einer konzerninternen ISIN zu einem Konzern.
K40A	Wenn BESTAND>0 und EM_GRUPPE_AUFSICHT="NEIN", dann darf BUCHWERT nicht leer sein und muss QUELLE_BELASTUNG <> "0" und RCHNNGSLGNG_KLSSFKTN <> "0" sein.
K40B1	Wenn BESTAND>0 und RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <> "2", "3", "99" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="NEIN" und WPART = "F_31", "F_32", dann muss LSTNG_STTS <> "0" und STNDNG_STTS <> "0" und AUSFALL_STTS_EM<> "0" und AUSFALL_STTS_INSTRMNT <> "0" sein.
K40B2	Wenn BESTAND>0 und RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <> "2", "3", "4", "7", "41", "47", "99" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="NEIN" und WPART = "F_31", "F_32", dann muss WRTMNDRNG_ART <> "0" und BWRTNG_WRTMNDRNG <> "0" sein.

K40C1	Wenn BESTAND>0 und RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <> "99" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="NEIN" und PORTFOLIO_AUFSICHT = "2", dann muss KPTL_BRCHNNG <> "0" sein.
K40C2	Wenn BESTAND>0 und RCHNNGSLGNGS_KLSSFKTN <> "99" und EM_GRUPPE_AUFSICHT="NEIN", PORTFOLIO_AUFSICHT <> "0" sein.
K56	Prüfung, ob die Meldung eines Wertpapiers als konzerninterne Emission unplausibel ist.