

Vorstand
S 1
19. Februar 2010

Bankenstatistik

Bankstatistische Meldungen und Anordnungen

hier: Anordnung einer Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

Im Hinblick auf die Anforderungen der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich auf dem Gebiet der internationalen Banken- und Finanzmarktstatistik, zu deren Wahrnehmung die Deutsche Bundesbank auf Grund ihrer Beteiligung an der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich verpflichtet ist, werden gemäß § 18 des Gesetzes über die Deutsche Bundesbank in der Fassung der Bekanntmachung vom 22. Oktober 1992 (BGBl. I S. 1782), zuletzt geändert durch Art. 12 des Gesetzes zur Neuordnung und Modernisierung des Bundesdienstrechts vom 5. Februar 2009 (BGBl. I S. 160 ff.) Meldepflichten für eine Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate angeordnet.

Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

Die Deutsche Bundesbank führt zu den Erhebungsstichtagen 30. Juni und 31. Dezember eine von der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich konzipierte Erhebung über den Bestand der konzernweit außerbörslich gehandelten Derivate durch.

1. Die Erhebung wird bei Kreditinstituten (§ 1 Abs. 1 KWG) durchgeführt, die als Mutterunternehmen eines Konzerns mit Sitz im Inland zur Aufstellung eines Konzernabschlusses nach §§ 290, 340 i HGB verpflichtet sind und die in ihrem Konzernabschluss für das der Erhebung vorangehende Jahr einen Nominalbetrag aller ausstehenden OTC-Derivate von mehr als 1 000 Mrd Euro oder einen Nominalbetrag ausstehender Kreditderivate von mehr als 100 Mrd Euro ausweisen. Jedes berichtspflichtige Institut erhält einen Bescheid über seine Meldepflicht.
2. Im Rahmen dieser Erhebung haben die Institute über die zum Stichtag ausstehenden zins-, währungs-, aktien- und rohstoffbezogenen Kontrakte sowie über den Stand der abgeschlossenen Kreditderivate zu berichten. Anzugeben sind die Nominalwerte sowie die positiven und negativen Bruttomarktwerte der Kontrakte. Darüber hinaus

Telefon	Termin	Vordr.	Vorgang	Überholt
069 9566-2219 oder 069 9566-0	Veröffentlicht im Bundesanzeiger Nr. 41 vom 16. März 2010			

sind Wiederbeschaffungswerte unter Berücksichtigung bilateraler Aufrechnungsvereinbarungen zu melden.

3. Die Meldungen sind nach den von der Deutschen Bundesbank vorgeschriebenen Berichtsschemata zu erstatten. Bei der Aufstellung der Meldungen sind die von der Bundesbank erlassenen Richtlinien und Einzelstellungennahmen zur Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate zu beachten.
4. Die Meldungen sind der Deutschen Bundesbank bis zum Geschäftsschluss des 40. Geschäftstages nach dem jeweiligen Erhebungsstichtag gemäß ihren Vorgaben elektronisch über das Bundesbank-ExtraNet oder in Papierform zu übermitteln.
5. Die gemeldeten Einzelangaben werden der Bundesanstalt für Finanzdienstleistungsaufsicht zur Verfügung gestellt.

Die Meldungen sind erstmalig für den Erhebungsstichtag 30. Juni 2011 zu erstatten.

DEUTSCHE BUNDESBANK
Prof. Kotz Ziebarth