

Vorstand  
S 1  
19. Februar 2010

**Bankenstatistik**

### **Bankstatistische Meldungen und Anordnungen**

hier: Anordnung einer Statistik über Devisenhandelsumsätze und das Geschäft in OTC-Derivaten

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 Devisenhandelsumsätze und das Geschäft in OTC-Derivaten angeordnet.

### **Statistik über Devisenhandelsumsätze und das Geschäft in OTC-Derivaten**

Die Deutsche Bundesbank führt im Abstand von drei Jahren jeweils im Referenzmonat April eine Erhebung über Devisenhandelsumsätze und das Geschäft in OTC-Derivaten durch.

1. Die Erhebung wird bei monetären Finanzinstituten (MFIs) in Deutschland durchgeführt, deren kurzfristige Fremdwährungsforderungen und -verbindlichkeiten gegenüber dem Ausland zum Ende April des der Erhebung vorangehenden Kalenderjahres zusammengenommen den Gegenwert von einer Milliarde Euro überschreiten. Maßgeblich für die Berechnung des Schwellenwertes von einer Milliarde Euro sind die Angaben zum Auslandsstatus der inländischen Banken (MFIs) in den Positionen der täglich fälligen und befristeten Forderungen sowie Verbindlichkeiten bis zu 1 Jahr einschließlich. Jedes berichtspflichtige Institut erhält einen Bescheid über seine Meldepflicht.

---

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

2. Im Rahmen dieser Erhebung haben die MFIs ihre während des Referenzmonats getätigten Devisenhandelsumsätze (Spot- und Termingeschäfte) und ihre Geschäftsabschlüsse in außerbörslich gehandelten Derivaten zu melden. Darüber hinaus sind Angaben über die eingesetzten Handelssysteme zu machen. Geschäfte mit Gebietsansässigen der Mitgliedsländer der Europäischen Währungsunion sind gesondert anzugeben.
3. Die Meldungen sind nach den von der Deutschen Bundesbank vorgeschriebenen Berichtsschemata zu erstatten. Instituten, deren kurzfristige Fremdwährungsforderungen und -verbindlichkeiten den Gegenwert von zusammengekommen 10 Mrd Euro nicht überschreiten, ist es gestattet, ein vereinfachtes Meldeschema zu benutzen. Bei der Aufstellung der Meldungen sind die von der Deutschen Bundesbank erlassenen Richtlinien und Einzelstellungen zur Erhebung über Devisenhandelsumsätze und das Geschäft in OTC-Derivaten zu beachten.
4. Die Deutsche Bundesbank kann einzelne Meldepflichtige befristet oder widerruflich von einer Meldepflicht freistellen, soweit dafür besondere Gründe vorliegen und der Zweck der Meldevorschriften nicht beeinträchtigt wird.
5. Die Meldungen sind der Deutschen Bundesbank bis zum Geschäftsschluss des 30. Geschäftstages nach Ablauf des Referenzmonats April gemäß ihren Vorgaben elektronisch über das Bundesbank-ExtraNet oder in Papierform zu übermitteln.
6. Die Meldungen sind erstmalig für den Referenzmonat April 2010 zu erstatten.

DEUTSCHE BUNDESBANK  
Prof. Kotz                      Ziebarth