

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

Zentrale
S 1

Wilhelm-Epstein-Straße 14
60431 Frankfurt am Main

Telefon: 069 9566-0
Telefax: 069 9566-3077

presse-information
@bundesbank.de
www.bundesbank.de

Datum
9. September 2011

Rundschreiben Nr. 52/2011

Emissionsstatistik für festverzinsliche Wertpapiere der Deutschen Bundesbank

hier: Befragung zur Neukonzeption

Sehr geehrte Damen und Herren,

gemäß Anordnung der Deutschen Bundesbank vom 21. Juli 2004 (Anlage 7 zur Mitteilung Nr. 8003/2004) gehören Sie zum Kreis der Meldepflichtigen zur Emissionsstatistik für festverzinsliche Wertpapiere. Wir möchten Sie bereits heute darüber informieren, dass eine grundlegende Neukonzeption dieser Statistik geplant wird. Gleichzeitig möchten wir Ihnen die Möglichkeit geben, an der Neugestaltung mitzuwirken.

Bedingt durch die starken Veränderungen am Kapitalmarkt mit einer zunehmend komplexeren Ausgestaltung der Instrumente ist eine Überarbeitung der Meldeanforderungen zur Emissionsstatistik dringend erforderlich geworden.

Die vorgesehenen Neuerungen umfassen eine Erweiterung sowohl des Kreises der zu meldenden Papiere als auch der zu meldenden Stammdaten pro Wertpapier. Die gesamte Erhebung soll grundsätzlich auf Basis des einzelnen Wertpapiers erfolgen. Demnach sollen **Angaben zu Absatz, Tilgung, Umlauf und zu Beständen zurückerworbener eigener Schuldverschreibungen, ebenso wie Kurse beziehungsweise Preise, monatlich pro Wertpapier** eingereicht werden. Ferner beabsichtigen wir, die **Angaben zu stücknotierten Papieren in Stück** und die **Angaben zu Fremdwährungsanleihen in der Emissionswährung** zu erheben.

Wir werden das künftige elektronische Einreichungsschema sowie die neugefassten Richtlinien frühzeitig bereitstellen. Als Implementierungsphase für Ihr Institut ist ein Zeitraum von etwa 12 Monaten vorgesehen. Nach derzeitigem Stand wird der **erste Berichtsmonat Juli 2013** sein. Für einen Übergangszeitraum von sechs Monaten beabsichtigen wir, eine Parallelerhebung der Daten nach altem und neuem Meldeschema durchzuführen.

Detailliertere Informationen zur Neukonzeption können Sie dem beigefügten Fragebogen entnehmen, den Sie auch als elektronisch ausfüllbares Dokument auf unserer Homepage unter www.bundesbank.de > Sachgebiete > Statistik > Meldewesen > Bankenstatistik > Emissionsstatistik finden.

Bitte senden Sie Ihre Antworten möglichst per E-Mail bis

Freitag, den 21. Oktober 2011

an uns zurück. Die entsprechende E-Mail Adresse lautet:

emissionsstatistik@bundesbank.de

Unsere Ansprechpartnerinnen sind
zu erreichen unter den Telefonnummern

Frau Sauernheimer
069 9566-2531

Frau Huck
069 9566-3604

Ihre Angaben werden wir selbstverständlich vertraulich behandeln.

Für Ihre Kooperationsbereitschaft bedanken wir uns im Voraus.

Mit freundlichen Grüßen

DEUTSCHE BUNDESBANK
Stejskal-Passler Kladny



Beglaubigt:
H. Queronie
Tarifbeschäftigte

Anlage

Fragebogen zur Neukonzeption der Emissionsstatistik

Angaben zum befragten Institut

Name Ihres Instituts:

Bankleitzahl:

Bezeichnung Ihrer Organisationseinheit:

Ansprechperson(en) für die Einreichung der Emissionsstatistik:

E-Mail:

Telefon:

Falls abweichend: Ansprechperson zur Beantwortung des Fragebogens:

E-Mail:

Telefon:

Allgemeine Informationen

In diesem Fragebogen geht es um die Neukonzeption der Emissionsstatistik für festverzinsliche Wertpapiere der Deutschen Bundesbank. Er wendet sich an alle meldepflichtigen Institute und gibt einen ersten Einblick in die geplanten Neuerungen. Gleichzeitig ermöglicht er Ihnen, bei der Ausgestaltung der Änderungen mitzuwirken.

Der Fragebogen ist in vier Themenbereiche gegliedert:

Der erste Abschnitt beschäftigt sich mit der Frage, ob Papiere, die bislang noch nicht oder nur eingeschränkt der Meldepflicht zur Emissionsstatistik unterlagen, im Rahmen der Neukonzeption einbezogen werden können. Der zweite Teil enthält Fragen im Zusammenhang mit der geplanten Erweiterung der Stammdaten, während im dritten Abschnitt Änderungen bei Einzel- und Sammelmeldungen zur Diskussion gestellt werden. Der vierte Abschnitt gibt Ihnen die Möglichkeit, die Kosten der beabsichtigten Neuerungen einzuschätzen.

Für allgemeine Erläuterungen und Hinweise, die in den vorderen Blöcken des Fragebogens keinen Platz finden, steht Ihnen der Abschnitt „Sonstige Anmerkungen“ zur Verfügung.

Wir bitten Sie, den ausgefüllten Fragebogen möglichst per E-Mail bis

Freitag, den 21. Oktober 2011

an uns zurückzusenden. Die entsprechende E-Mail Adresse lautet:

emissionsstatistik@bundesbank.de

Unsere Ansprechpartnerinnen sind
zu erreichen unter den Telefonnummern

Frau Sauernheimer
069 9566-2531

Frau Huck
069 9566-3604

I. Kreis der meldepflichtigen Papiere

Wir planen, zusätzlich zu den bislang meldepflichtigen Emissionen, in Zukunft auch Daten auf Basis des einzelnen Wertpapiers für **Namenspapiere** (die bisher nur in der Sammelmeldung anzugeben waren) und für **Genuss-Scheine** zu erheben.

Das Schlüsselmerkmal in der Emissionsstatistik wird für alle meldepflichtigen Papiere die International Securities Identification Number (ISIN) sein.

Fragenblock I

Namenspapiere (nur auszufüllen, falls Ihr Institut Namenspapiere begibt):

Kann Ihr Institut Namenspapiere auf Einzelwertpapierbasis melden?

- Ja.
- Nein, aus folgendem Grund:

Wie viele Namenspapiere begibt Ihr Institut durchschnittlich pro Jahr?

Stück

Genuss-Scheine:

Begibt Ihr Institut eigene Genuss-Scheine?

- Ja.
- Nein.

Falls ja:

Wie viele Genuss-Scheine Ihres Instituts befanden sich per Ende August 2011 im Umlauf?

Anzahl der ISINs:

Umlauf der Genuss-Scheine in Euro:

Schuldverschreibungen inländischer Nichtbanken:

Ist Ihr Institut in die Begebung von Schuldverschreibungen inländischer Nichtbanken involviert?

- Ja.
 Nein.

Falls ja:

Wie viele Emissionen inländischer Nichtbanken werden von Ihrem Institut durchschnittlich pro Jahr betreut?

Stück

Über welche der folgenden Angaben zu diesen Emissionen verfügt Ihr Institut?

- ISIN
 weitere Stammdaten (gem. Meldebogen A, z. B. Zinssatz, Laufzeit etc.)
 Absatz
 Tilgung
 Umlauf
 Kurse/Preise
 Wir verfügen über keine dieser Angaben.

Commercial Paper inländischer Nichtbanken:

Ist Ihr Institut in die Auflegung von Commercial Paper-Programmen inländischer Nichtbanken involviert?

- Ja.
 Nein.

Falls ja:

Wie viele Commercial Paper inländischer Nichtbanken (Anzahl der Tranchen) werden von Ihrem Institut durchschnittlich pro Jahr betreut?

Stück

Über welche der folgenden Angaben zu den einzelnen Tranchen verfügt Ihr Institut?

- ISIN
- weitere Stammdaten (gem. Meldebogen A, z. B. Zinssatz, Laufzeit etc.)
- Absatz
- Tilgung
- Umlauf
- Kurse/Preise
- Wir verfügen über keine dieser Angaben.

Verfügbarkeit der ISIN:

Liegt Ihnen für jedes bisher zu meldende Wertpapier sowie für Genuss-Scheine und Namenspapiere eine ISIN vor?

- Ja.
- Nein, insbesondere bei folgenden Wertpapierkategorien beantragen wir keine ISIN:

Falls nein:

- Diese Wertpapierkategorien verfügen bei uns über eine interne -stellige Identifikationsnummer.

II. Erweiterung der zu erhebenden Stammdaten

Es ist vorgesehen, in Zukunft zusätzliche Stammdaten zum einzelnen Wertpapier zu erheben, die bisher nicht Gegenstand des Meldebogen A waren. Dabei geht es unter anderem um folgende Merkmale:

Stück- / Prozentnotierung, Typ und Underlying von strukturierten Produkten¹, CFI-Code (Classification of Financial Instruments Code), Nachrangigkeit, Poolfaktor, Privatplatzierung und Ratinginformationen.

Fragenblock II

Wertpapierklassifizierung:

Können Sie die von Ihrem Institut begebenen Wertpapiere gemäß folgender Wertpapierklassifizierungen einstufen?

Pfandbriefe, Commercial Paper, Zertifikate, Optionsscheine, Optionsanleihen, Wandelschuldverschreibungen, Aktienanleihen, Genuss-Scheine, übrige Schuldverschreibungen

- Ja.
- Nein, folgende Klassifizierungen können wir nicht angeben:

Können Sie den CFI-Code der von Ihnen begebenen Wertpapiere angeben?

- Ja.
- Nein, der CFI-Code liegt uns nicht vor.

¹ Zumeist „Zertifikate“ in Form von „Anlageprodukten“ (z. B. Themen-, Strategie-, Index-, Sprint-, (Teil)Bonus-, Outperformance-, Discount-, Kapitalgarantie (100%)-Zertifikate, Aktienanleihen) oder „Hebelprodukten“ (z. B. Knock-Outs, Optionsscheine).

Strukturierte Produkte (nur auszufüllen, falls Ihr Institut strukturierte Produkte begibt):

Können Sie die von Ihrem Institut emittierten strukturierten Produkte grundsätzlich in Anlage- oder Hebelprodukte einteilen?

- Ja.
- Nein, wir unterscheiden folgende Kategorien:

Können Sie die von Ihrem Institut emittierten strukturierten Produkte nach folgenden Basiswerten differenzieren:

Indizes, Wertpapiere, Rohstoffe, Währungen, Futures, Zinssätze

- Ja.
- Nein, wir unterscheiden folgende Kategorien:

Ratinginformationen:

Verfügen Sie über Informationen zu Ratingeinstufungen der einzelnen von Ihrem Institut begebenen Wertpapiere?

- Ja, für alle Wertpapiere.
- Nur für einen Teil der Wertpapiere, etwa %.
- Nein.

Wenn Sie über Ratingeinstufungen verfügen, von welchen Agenturen erhalten Sie die Informationen?

III. Umstellung der Einzelmeldung / Sammelmeldung

Wir beabsichtigen, zusätzlich zu den Angaben über Absatz und Tilgung in Zukunft auch monatlich die Höhe des Umlaufs und die Bestände zurückerworbener eigener Schuldverschreibungen auf Basis des einzelnen Wertpapiers zu erheben.

Weiter ist geplant, sowohl Nominalwert- als auch Kurswertbetrachtungen in der Emissionsstatistik darzustellen. Aus diesem Grund erwägen wir, neben dem nominalen Umlauf des einzelnen Wertpapiers auch Kurs- beziehungsweise Preisangaben in die Meldeanforderungen aufzunehmen. Diese Angaben sollen auch zum Tilgungszeitpunkt in die Erhebung einfließen.

Die Einzelmeldung wird sich bei stücknotierten Papieren und bei Anleihen, die in einer Fremdwährung denominated sind, von den übrigen Papieren inhaltlich unterscheiden:

- Bei stücknotierten Papieren beabsichtigen wir, alle Angaben in Stück zu erfragen.
- Bei Fremdwährungsanleihen beabsichtigen wir, alle Angaben in der Emissionswährung zuzüglich des von Ihnen herangezogenen Devisenkurses zu erfragen.

Zu Ihrer Entlastung sehen wir im Gegenzug vor, auf Sammelmeldungen grundsätzlich zu verzichten.

Fragenblock III

Stücknotierte Wertpapiere:

Halten Sie Stückzahlen solcher Papiere für Absatz, Tilgung, Umlauf, Emissionsvolumen und für den Bestand zurückerworbener eigener Schuldverschreibungen in Ihrer Datenbank vor?

- Ja.
- Nein, Stückzahlen liegen uns nur für folgende Angaben vor:
- | | |
|---|---|
| <input type="checkbox"/> Absatz | <input type="checkbox"/> Tilgung |
| <input type="checkbox"/> Umlauf | <input type="checkbox"/> Emissionsvolumen |
| <input type="checkbox"/> Bestand zurückerworbener eigener Schuldverschreibungen | |
- Nein, in unserer Datenbank werden ausschließlich Beträge erfasst.

Schuldverschreibungen in Fremdwahrung:

Halten Sie bei diesen Papieren Angaben in Emissionswahrung zu Absatz, Tilgung, Umlauf, Emissionsvolumen und zum Bestand zuruckerworbener eigener Schuldverschreibungen in Ihrer Datenbank vor?

- Ja.
- Nein, Fremdwahrungsbetrage liegen uns nur fur folgende Angaben vor:
- | | |
|--|---|
| <input type="checkbox"/> Absatz | <input type="checkbox"/> Tilgung |
| <input type="checkbox"/> Umlauf | <input type="checkbox"/> Emissionsvolumen |
| <input type="checkbox"/> Bestand zuruckerworbener eigener Schuldverschreibungen | |
- Nein, in unserer Datenbank werden ausschlielich Euro-Betrage erfasst.

Halten Sie ebenfalls die fur die Bewertung Ihrer Fremdwahrungspapiere herangezogenen Devisenkurse zum Ultimo des Monats sowie zum Emissions- und Tilgungstermin vor?

- Ja.
- Nein.

Kurse/Preise:

Ist es Ihnen grundsatzlich moglich, monatlich fur jedes Ihrer umlaufenden Wertpapiere (inklusive der Fremdwahrungsanleihen) einen Kurs beziehungsweise Preis zu melden?

- Ja.
- Nein, aus folgendem Grund:

In welcher Wahrung liegen Ihnen die Preise stucknotierter Wertpapiere, die nicht in Euro denominated sind, vor?

- Die Preise liegen uns sowohl in Euro als auch in Fremdwahrung vor.
- Die Preise liegen uns nur in Fremdwahrung vor.
- Die Preise liegen uns nur in Euro vor.
- Unser Institut hat bislang keine stucknotierten Wertpapiere in Fremdwahrung begeben.

IV. Einschätzung der Kosten / Implementierungsaufwand

Fragenblock IV

Hier können Sie eine Einstufung der Kosten nach folgendem Schema vornehmen:

- (1) Niedrige Kosten, wenig Implementierungsaufwand
- (2) Mittlere Kosten, mittlerer Implementierungsaufwand
- (3) Erhebliche Kosten, großer Implementierungsaufwand

Wie schätzen Sie die Implementierungskosten für die verschiedenen Neuerungen ein?

Bitte tragen Sie die entsprechenden Ziffern gemäß Ihrer Einschätzung in die nachfolgenden Kästchen ein:

Abgabe von Meldungen auf Einzelwertpapierbasis für folgende Wertpapiere:

- Namenspapiere
- Genuss-Scheine
- Commercial Paper inländischer Nichtbanken

Erweiterung der Stammdaten um:

- Einteilung strukturierter Produkte in Anlage- und Hebelprodukte
- Einteilung strukturierter Produkte nach Basiswerten
- Bereitstellung von Ratinginformationen

Umstellung der Einzelmeldung auf:

- Angaben in Stück bei stücknotierten Papieren
- Angaben in Emissionswährung bei in Fremdwährung denominierten Papieren
- Angabe des Umlaufs auf Basis des einzelnen Wertpapiers
- Kurs- und Preisangaben auf Basis des einzelnen Wertpapiers
- Angaben zu Beständen zurückerworbener eigener Schuldverschreibungen auf Basis des einzelnen Wertpapiers

V. Sonstige Anmerkungen