

Qualitäts-/Plausibilitätsprüfungen für die Statistik über Wertpapierinvestments

Stand Januar 2013

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
1	<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>	ja
2	<p>Absender muss bekannt sein 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 Prüfziffer (neunstellig) und für Rechenzentren oder andere Dienstleister die Rechenzentrums-Leitzahl (R gefolgt von acht Ziffern).</p>	ja
3	<p>Meldepflichtiges Institut muss bekannt sein 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 Prüfziffer (neunstellig) und für Kapitalanlagegesellschaften die dreistellige Nummer.</p>	ja
4	<p>Meldetermin Der angegebene Meldetermin darf nicht nach dem aktuellen bzw. vor Januar 2013 liegen.</p>	ja
5	<p>entfällt</p>	
6	<p>Nominalwährung/Stück Bei Prozent-Notiz und Promille-Notiz ist die Nominalwährung/Depotwährung in der Abkürzung des dreistelligen ISO-Währungscode 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-Währungscode verwendet werden. Ein Verzeichnis der Währungen mit Abkürzungen nach ISO-Währungscode findet sich in der Statistischen Sonderveröffentlichung 1, Statistik der Banken und Sonstigen Finanzinstitute - Richtlinien und Kundensystematik.</p>	ja

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
7	<p>Sektor-Land Für das Sitzland des Deponenten ist der zweistellige ISO-Ländercode zu verwenden. Es dürfen nur gültige ISO-Ländercodes verwendet werden. Ein Verzeichnis der Länder mit Abkürzungen nach ISO-Ländercodes findet sich in der Statistischen Sonderveröffentlichung 1, Statistik der Banken und Sonstigen Finanzinstitute - Richtlinien und Kundensystematik.</p>	ja
8	<p>WP-Kurswährung (gilt nur für Wertpapiere ohne offizielle ISIN) Die WP-Kurswährung ist in der Abkürzung des dreistelligen ISO-Währungscode (Beispiel: Euro – EUR) anzugeben, wie es das WM-Datenfeld GD172 (Abrechnungswährung/ISO) für Papiere mit Kenn-Nummern vorsieht. Es dürfen nur gültige ISO-Währungscode verwendet werden. Ein Verzeichnis der Währungen mit Abkürzungen nach ISO-Währungscode findet sich in der Statistischen Sonderveröffentlichung 1, Statistik der Banken und Sonstigen Finanzinstitute - Richtlinien und Kundensystematik.</p>	ja
9 10	<p>WP-Laufzeit (gilt nur für Wertpapiere ohne offizielle ISIN) Hier ist die Ursprungslaufzeit mit Hilfe von Laufzeitbeginn (Emissionstag) und Laufzeitende (Tilgungstermin) anzugeben. Es dürfen nur Wertpapiere mit gültigen Laufzeiten angegeben werden. Eine ungültige WP-Laufzeit liegt vor, wenn - das Laufzeitende vor dem Laufzeitbeginn bzw. vor dem Meldestichtag oder - der Laufzeitbeginn nach dem Meldestichtag liegt.</p>	ja
11 12	<p>Kombination der Felder Sektor und Sektor-Land - Werden die Sektoren für Eigenbestände angegeben (1221, 1222, 1223, 1224), so kann das Sitzland des Deponenten immer nur „Deutschland (DE)“ sein. Ist das Sektor-Land in diesen Fällen ungleich DE, dann liegt ein Fehler vor. - Die Sektoren 1215 (ausländische Zentralbanken), 1225 (ausländische Banken) und 1228 (ausländische Zentralverwahrer) können nie „Deutschland (DE)“ als Sitzland des Deponenten aufweisen. Ist das Sektor-Land in diesen Fällen DE, dann liegt ein Fehler vor.</p>	ja
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>	ja

14	Teilaggregation Bei gleichartigen Datensätzen ist eine Teilaggregation durchzuführen, d. h. alle Wertpapiere, bei denen die Datenfelder „Sektor“, „Sektor-Land“ und die zugehörigen Bestandselemente (B, B-, V und E) identisch sind, sind im Datenfeld „Depotbestand“ betragsmäßig zusammenzufassen. Gleichartige Datensätze dürfen nur einmal in der Meldung aufgeführt werden.	ja
15	Sektorangaben zu den Eigenbeständen Bei der Meldung der Eigenbestände kann jeder ISIN nur einer der Sektoren 1221, 1222, 1223 oder 1224 zugeordnet werden.	ja
16	Saldierung Pro Datensatz darf nur eines der Bestandselemente „B“ oder „B-“ auftreten, d. h. es ist eine Saldierung erforderlich. Dies gilt auch für die neuen Bestandselemente H, H-, BW, BW- und HBW, HBW-.	ja
50 51	Inhalt einer aktuellen Meldung Im Falle einer aktuellen Meldung zu Kundendepots müssen sich die sektoralen Angaben unter „Anzahl der Kundendepots nach Sektoren“ auch unter der „Gliederung des Wertpapiers nach Sektor und Sitzland des Deponenten“ finden lassen und vice versa (da Leerdepots nicht zu melden sind!).	ja
52	Existenz bzw. Meldepflicht der gemeldeten ISINs Es dürfen nur existierende bzw. meldepflichtige ISINs gemeldet werden. Dies wird anhand eines Abgleichs mit einer Stamm- und Kursdatenbank sichergestellt.	empfohlen
53	Bundesbankinterne Prüfung	
54	Bundesbankinterne Prüfung	
55	Abgleich der Angabe Nominalwährung/Stück mit einer Stamm- und Kursdatenbank Es wird die Übereinstimmung der Angabe Nominalwährung/Stück mit der entsprechenden Angabe in einer Stamm- und Kursdatenbank abgestimmt. Damit soll ausgeschlossen werden, dass z. B. ein in DM gemeldetes Wertpapier bereits auf Euro (ISO-Währungscode "EUR") umgestellt bzw. eine prozentnotierte Aktie zwischenzeitlich stücknotiert (Abkürzung „XXX“) ist. Nutzer der WM-Gattungsdatei können das WM-Datenfeld GD171 (Depotwährung/ISO) verwenden. Informationen zur Effektennotiz enthält das WM-Datenfeld GD440.	empfohlen

56	<p>Überprüfung der Wertpapiere ohne offizielle ISIN (Interne WKN) „Interne WKN“ dürfen nur dann gemeldet werden, wenn sie sich im Eigenbestand (Sektor 1221, 1222, 1223 oder 1224) der meldepflichtigen Bank befinden. Die Wertpapiere dürfen nur dann als „Interne WKN“ gekennzeichnet werden, wenn sie keine offizielle ISIN besitzen. Es wird daher überprüft, ob die gemeldeten Wertpapiere eine offizielle ISIN besitzen.</p>	ja
57	<p>Institut/Sektor-Kombinationen, die unplausibel erscheinen Es wird überprüft, ob die gemeldeten Sektoren für das jeweilige meldepflichtige Institut plausibel erscheinen.</p>	
58	<p>Institut/Sektor-Kombinationen, die erwartet werden Es wird überprüft, ob die Sektoren, die für das jeweilige meldepflichtige Institut erwartet werden, vorhanden sind.</p>	
59	<p>Anzeige von unplausiblen Länder-Angaben Es wird überprüft, ob die gemeldeten Sektor-Länder plausibel erscheinen.</p>	
60	<p>Bundesbankinterne Prüfung</p>	
61	<p>Abgleich mit den Transaktionen aus der Zahlungsbilanzstatistik Diese Prüfung wird von Seiten der Zahlungsbilanzstatistik im Hause der Bundesbank durchgeführt. Es erfolgt ein Abgleich der Bestandsveränderungen aus der Statistik über Wertpapierinvestments mit den AWW-Meldungen auf ISIN-Ebene.</p>	
62	<p>Bestandselemente „B-, V und E“ Mit den Bestandselementen „B-, V und E“ gemeldete Bestände werden ab einem bestimmten Schwellenwert gesondert überprüft.</p>	
63	<p>Umlauf- und Unterbringungsrechnung Die gemeldeten Wertpapierbestände insgesamt werden je ISIN dem jeweiligen Emissionsvolumen gegenübergestellt. Eine Unplausibilität liegt u. a. dann vor, wenn die gemeldeten Bestände das Emissionsvolumen überschreiten.</p>	

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
64	<p>Abgleich mit den Eigenbeständen aus der Bilanzstatistik Die Kurswerte der Sektoren 1221, 1223 und 1224 in der Statistik über Wertpapierinvestments werden mit den Buchwerten der monatlichen Bilanzstatistik (HV11, Anlage E1 und E2) im Hause der Bundesbank abgestimmt. Hierzu werden Kurswerte aus Wplinvest zu Buchwerten in BISTA ins Verhältnis gesetzt. Eine Unplausibilität liegt vor, wenn Grenzwerte, innerhalb derer sich das Verhältnis bewegen darf, über- bzw. unterschritten werden.</p> <p>Abgleich mit der Emissionsstatistik Im Rahmen der Emissionsstatistik für festverzinsliche Wertpapiere wird in Position 800 der Sammelmeldung A (darunter im Eigenbestand des Emittenten) der Nominalbetrag der eigenen zurückgekauften Schuldverschreibungen aufgeführt. Die Nominalwerte des Sektors 1222 werden mit diesem Betrag abgestimmt. Eine Unplausibilität liegt vor, wenn Grenzwerte, innerhalb derer sich das Verhältnis bewegen darf, über- bzw. unterschritten werden.</p>	
65	<p>Vorquartalsvergleich Die Veränderungen des aktuellen Bestands im Vergleich zum Vortermine werden im Hause der Bundesbank überprüft.</p>	