

Statistik der Banken und sonstigen Finanzinstitute Richtlinien

Statistische Sonderveröffentlichung 1
Januar 2019

Deutsche Bundesbank
Wilhelm-Epstein-Straße 14
60431 Frankfurt am Main

Postfach 10 06 02
60006 Frankfurt am Main

Tel.: 069 9566-3447
E-Mail: Statistik-S1@bundesbank.de

Angaben nach § 5 Telemediengesetz finden sich unter
www.bundesbank.de/impressum

Publizistische Verwertung nur mit Quellenangabe gestattet.

Diese aktualisierte Fassung ist nur im Internet verfügbar.

Wesentliche Änderungen gegenüber der Fassung vom Juli 2018 sind durch seitliche senkrechte Linien gekennzeichnet.

Die Statistische Sonderveröffentlichung Statistik der Banken und sonstigen Finanzinstitute Richtlinien erscheint halbjährlich und wird aufgrund von § 18 des Gesetzes über die Deutsche Bundesbank veröffentlicht.

■ Inhalt

■ Vorbemerkungen	7
■ Allgemeine Richtlinien	9
■ Monatliche Bilanzstatistik	35
Richtlinien zur monatlichen Bilanzstatistik	36
Richtlinien zu den einzelnen Positionen des Hauptvordrucks	37
Richtlinien zu den Anlagen zur monatlichen Bilanzstatistik	70
Ergänzende Richtlinien für die Meldungen der Bausparkassen zur monatlichen Bilanzstatistik	107
Hinweise zu den Meldungen zur monatlichen Bilanzstatistik über die Auslandsfilialen inländischer Banken (MFIs)	111
Hinweise zu den Meldungen zur monatlichen Bilanzstatistik über die Auslandstöchter inländischer Banken (MFIs)	113
Meldungen	114
Anordnungen	175
■ Kreditnehmerstatistik	183
Richtlinien zur Kreditnehmerstatistik	184
Anlage (Branchengliederung)	189
Übersicht der Vordruckzeilen	242
Meldungen	246
Anordnungen	253
■ Auslandsstatus der Banken (MFIs)	257
Richtlinien zum Auslandsstatus der Banken	258
Richtlinien zum monatlichen Auslandsstatus der inländischen Banken (MFIs)	263
Richtlinien zum Auslandsstatus der Auslandsfilialen	275
Richtlinien zum Auslandsstatus der Auslandstöchter	279
Meldungen	283
Anordnungen	299
■ Kreditdatenstatistik (AnaCredit)	303
Richtlinien zur Kreditdatenstatistik (AnaCredit)	304
Meldungen	421
Anordnung	429

Allgemeine
Richtlinien

Monatliche
Bilanzstatistik

Kreditnehmer-
statistik

Auslandsstatus

Kreditdaten-
statistik

MFI-Zinsstatistik

Geldmarkt-
statistik

Emissions-
statistik

Statistik über
Wertpapier-
investments

Zahlungs-
verkehrs-
statistik

Statistik über
Investment-
vermögen

Statistik über Ver-
briefungszweck-
gesellschaften

OTC-
Derivate
Statistik

Triennial
Survey

Verzeichnisse

Allgemeine
 Richtlinien

■ **MFI-Zinsstatistik** 435

Richtlinien zur MFI-Zinsstatistik 436
 Meldungen 456
 Anordnung 459

Monatliche
 Bilanzstatistik

Kreditnehmer-
 statistik

■ **Geldmarktstatistik** 461

Richtlinien zur Geldmarktstatistik 462
 Anordnung 513

Auslandsstatus

Kreditdaten-
 statistik

■ **Emissionsstatistik über Schuldverschreibungen** 515

Richtlinien zur Emissionsstatistik über Schuldverschreibungen 516
 Meldungen 533
 Anordnung 543

MFI-Zinsstatistik

Geldmarkt-
 statistik

■ **Statistik über Wertpapierinvestments** 547

Richtlinien zur Erhebung der Wertpapierbestände aller meldepflichtigen Institute 548
 Richtlinien zur Erhebung der Eigenbestände ausgewählter Bankgruppen auf Konzernebene 566
 Meldungen 581
 Anordnung 583

Emissions-
 statistik

Statistik über
 Wertpapier-
 investments

■ **Zahlungsverkehrsstatistik** 587

Richtlinien zur Zahlungsverkehrsstatistik 588
 Erläuterungen zum Berichtssystem 593
 Meldungen 617
 Anordnung 629

Zahlungs-
 verkehrs-
 statistik

Statistik über
 Investment-
 vermögen

■ **Statistik über Investmentvermögen** 633

Richtlinien zur Statistik über Investmentvermögen 634
 Meldungen 655
 Anordnung 665

Statistik über Ver-
 briefungszweck-
 gesellschaften

OTC-
 Derivate
 Statistik

■ **Statistik über Verbriefungszweckgesellschaften** 669

Richtlinien zur Statistik über Verbriefungszweckgesellschaften 670
 Richtlinien zu den einzelnen Positionen der Meldeschemata 677
 Meldungen 687
 Anordnung 693

Triennial
 Survey

Verzeichnisse

**Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter
 Derivate** 697

Richtlinien zur Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate 698
 Richtlinien zu den einzelnen Erhebungsvordrucken 701
 Meldungen 704
 Anordnung 721

**Statistik über Devisenhandelsumsätze und das Geschäft
 in OTC-Derivaten inländischer monetärer Finanzinstitute
 (MFIs)** 723

Richtlinien zur Statistik über Devisenhandelsumsätze und das Geschäft in OTC-Derivaten
 inländischer monetärer Finanzinstitute (MFIs) 724
 Richtlinien zu den einzelnen Tabellen 726
 Meldungen 730
 Anordnung 743

Verzeichnisse 745

Verzeichnis der Banken (MFIs) in Deutschland nach Bankengruppen 746
 Verzeichnis der rechtlich selbständigen Banken (MFIs) im Mehrheitsbesitz
 ausländischer Banken 752
 Verzeichnis der ausländischen Banken im Mehrheitsbesitz deutscher Banken (MFIs) 753
 Verzeichnis der Kapitalverwaltungsgesellschaften 754
 Verzeichnis der Investmentaktiengesellschaften 755
 Verzeichnis der Verbriefungszweckgesellschaften 756
 Verzeichnis berufständischer Versorgungswerke 756
 Verzeichnis der Zusatzversorgungseinrichtungen der Gebietskörperschaften 758
 Verzeichnis der Länder 759
 Verzeichnis wichtiger internationaler Organisationen 764
 Verzeichnis der Währungen 766
 Verzeichnis der Währungsbehörden/Notenbanken 770

Statistische Sonderveröffentlichungen 775

Allgemeine
 Richtlinien

Monatliche
 Bilanzstatistik

Kreditnehmer-
 statistik

Auslandsstatus

Kreditdaten-
 statistik

MFI-Zinsstatistik

Geldmarkt-
 statistik

Emissions-
 statistik

Statistik über
 Wertpapier-
 investments

Zahlungs-
 verkehrs-
 statistik

Statistik über
 Investment-
 vermögen

Statistik über Ver-
 briefungszweck-
 gesellschaften

OTC-
 Derivate
 Statistik

Triennial
 Survey

Verzeichnisse

Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate (OTC-Derivate Statistik)

Richtlinien zur Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

Die Statistik über den Bestand außerbörslich (OTC) gehandelter Derivate ist Teil einer von der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich (BIZ) koordinierten Erhebung, die in halbjährlichem Abstand von den Notenbanken wichtiger Finanzzentren durchgeführt wird. Mit dieser Statistik soll eine hinreichend detaillierte und international vergleichbare Datengrundlage zur besseren Beurteilung von Umfang, Struktur und Entwicklung der weltweiten OTC-Derivate-Märkte geschaffen werden. Die dabei erfragten Angaben beziehen sich auf Nominal- und Marktwerte von Kontrakten über währungsbezogene, zinsbezogene, aktienbezogene und rohstoffbezogene Derivate sowie über Kreditderivate.

I. Berichtende Institute

Eine Berichtspflicht besteht für Kreditinstitute, die in ihrem Konzernabschluss einen Nominalbetrag aller ausstehenden OTC-Derivate von mehr als 1 000 Mrd € oder einen Nominalbetrag ausstehender Kreditderivate von mehr als 100 Mrd € ausweisen. Die Meldungen sind auf zusammengefasster Basis abzugeben. Maßgeblich hierfür ist der bankenaufsichtliche Konsolidierungskreis gemäß § 10a KWG beziehungsweise § 13b KWG. Geschäfte zwischen Instituten des eigenen Konsolidierungskreises bleiben dabei unberücksichtigt.

II. Zu meldende Daten

Die Erhebung bezieht sich auf den Bestand an offenen Kontrakten am letzten Geschäftstag der Monate Juni beziehungsweise Dezember. Anzugeben sind Nominalwerte und Bruttomarktwerte. Darüber hinaus werden Angaben zu den kontrahentenbezogenen Nettomarktwerten (Kredit-Exposures und Nettoverbindlichkeiten) erfragt.

Die anzugebenden **Nominalwerte** sind als Bruttosumme aus den Nennwerten aller vertraglich vereinbarten und am Erhebungsstichtag noch nicht glattgestellten Geschäfte zu berechnen. Eine Saldierung von Käufen und Verkäufen oder von Abnahme- und Lieferverpflichtungen ist nicht zulässig.

Als **Bruttomarktwerte** gelten die zum Erhebungsstichtag ermittelten Wiederbeschaffungswerte der ausstehenden Kontrakte. Die Bruttomarktwerte von Instrumenten mit positivem Wiederbeschaffungswert und die Bruttomarktwerte von Instrumenten mit negativem Wiederbeschaffungswert sind getrennt auszuweisen.

Als **Nettomarktwerte** gelten die zum Erhebungsstichtag ermittelten Wiederbeschaffungswerte nach Berücksichtigung rechtlich bindender bilateraler Aufrechnungsvereinbarungen. Positive Nettomarktwerte („Kredit-Exposure“) und negative Nettomarktwerte („Netto-Verpflichtungen“) sind getrennt auszuweisen.

■ III. Geschäftspartner

In der Gliederung nach Geschäftspartnern sind Positionen gegenüber „berichtenden Banken“, „anderen Finanzinstitutionen“ und „nichtfinanziellen Kunden“ auszuweisen.

Berichtende Banken sind in- und ausländische Institute, die auch zur Halbjährlichen OTC-Derivate Statistik der BIZ berichten. Dabei handelt es sich in der Regel um große, international aktive Geschäfts- und Investmentbanken. Eine Liste der berichtenden Banken wird von der Deutschen Bundesbank auf Anfrage zur Verfügung gestellt.

Sonstige Finanzinstitutionen sind alle Banken und Finanzinstitutionen, die nicht zu den berichtenden Banken zählen. Zusätzlich sind die in den sonstigen Finanzinstitutionen enthaltenen zentralen Gegenparteien gesondert zu zeigen.

Auf den Meldebögen über Credit Default Swaps (Tabellen 6A bis 6E) sind die Positionen gegenüber „sonstigen Finanzinstitutionen“ weiter aufzugliedern. Dabei sind die Beziehungen zu zentralen Gegenparteien, zu nicht berichtenden Banken und Wertpapierhäusern, zu Versicherungsunternehmen, zu finanziellen Zweckgesellschaften (SPVs) und zu Hedge Fonds gesondert auszuweisen.

Zu den **nichtfinanziellen Kunden** zählen alle Unternehmen außerhalb des Finanzsektors sowie staatliche Marktteilnehmer.

■ IV. Geschäfte mit zentralen Gegenparteien

Geschäfte, die über eine zentrale Gegenpartei abgewickelt werden, sind nicht gegenüber dem ursprünglichen Geschäftspartner auszuweisen, sondern von beiden Geschäftspartnern jeweils gegenüber der zentralen Gegenpartei.

■ V. Berichtswährung und Währungsumrechnung

Als Berichtswährung gilt der US-Dollar. Nicht auf Dollar lautende Kontrakte sollen zu Kursen des Erhebungsstichtags in US-Dollar umgerechnet werden. Alle Beträge sind auf volle Millionen US-Dollar gerundet ohne Nachkommastellen anzugeben.

■ VI. Einreichungstermin

Die Meldungen sollten nicht später als 40 Arbeitstage nach dem jeweiligen Erhebungsstichtag (Ultimo Juni bzw. Dezember) bei der Deutschen Bundesbank, Zentrale, S 12, via Extranet eingereicht werden.

■ VII. Zuordnung von Derivaten mit heterogenem Risikoprofil

Nach den Vorgaben der OTC-Derivate Statistik sollen die individuellen Kontrakte gemäß dem zugrunde liegenden Marktrisiko einer der fünf Kategorien Währungsderivate, Zinsderivate, Aktienderivate, Rohstoffderivate und Kreditderivate zugeordnet werden. In der Praxis kommt es aber vor, dass individuelle Kontrakte mehrere Risikokategorien umspannen. Sofern sich dabei das Exposure problemlos in einzelne Risikokomponenten zerlegen lässt, sollen diese Komponenten separat gemeldet werden. Andernfalls ist der gesamte Kontrakt derjenigen Risikokategorie mit der größten Ergebnisrelevanz zuzuordnen.

Richtlinien zu den einzelnen Erhebungsvordrucken

■ I. Währungsbezogene Derivate (Tabellen 1A, 1B und 1C)

Als währungsbezogene Derivate gelten im Rahmen dieser Erhebung sämtliche derivativen Geschäfte, die einem Wechselkursrisiko ausgesetzt sind. Als Gold-Kontrakte sind alle Geschäfte mit Gold-Exposure zu verstehen. Erfasst werden Outright Termingeschäfte und Devisen-Swaps, Währungs-Swaps (einschl. Zins-Währungs-Swaps) und Devisenoptionen.

Die Angaben über währungsbezogene Derivate sind nach den beteiligten Währungen zu untergliedern. Dies bedeutet, dass der Nominalwert beziehungsweise der positive oder negative Brutomarktwert eines jeden Kontrakts insgesamt zweimal – nämlich sowohl unter der gegebenen als auch unter der genommenen Währung – erfasst wird. Die Summe der unter den einzelnen Währungen ausgewiesenen Beträge muss sich deshalb auf 200 % des in der Gesamtspalte gezeigten Kontraktvolumens belaufen. Soll beispielsweise ein Forward-Kontrakt über den Kauf von USD gegen EUR im Nominalwert von 100 Mio US-\$ gemeldet werden, so beläuft sich das in der Gesamt-Spalte anzugebende Kontraktvolumen auf 100 Mio US-\$; darüber hinaus sind aber auch 100 Mio US-\$ in der USD-Spalte und 100 Mio US-\$ in der EUR-Spalte einzutragen.

Unter den anderen Instrumenten sind alle währungsbezogenen Derivate auszuweisen, bei denen die Transaktion im hohen Maße fremdfinanziert und/oder der Nominalwert variabel ist und bei denen eine Zerlegung in einzelne standardisierte Bestandteile unzweckmäßig oder unmöglich ist. Das können zum Beispiel Differential Swaps sein.

■ II. Zinsbezogene Derivate (Tabellen 2A, 2B und 2C)

Anzugeben sind derivative Kontrakte mit Zinsrisiken in nur einer Währung. Kontrakte, die den Austausch von mehr als einer Währung vorsehen (z. B. Zins-Währungs-Swaps), sind nicht hier, sondern unter den währungsbezogenen Derivaten (Tabellen 1A bis 1C) zu erfassen. Unter den zinsbezogenen Instrumenten sind Forward Rate Agreements, Zins-Swaps und Zins-Optionen (einschließl. Caps, Floors, Collars und Corridors) gesondert auszuweisen.

Unter den anderen Instrumenten sind alle zinsbezogenen Derivate auszuweisen, bei denen die Transaktion im hohen Maße fremdfinanziert und/oder der Nominalwert variabel ist und bei denen eine Zerlegung in einzelne standardisierte Bestandteile unzweckmäßig oder unmöglich ist. Das können zum Beispiel Swaps auf Basis von LIBOR zum Quadrat oder Index-Amortising Rate Swaps sein.

■ III. Aktien-, rohstoff-, kreditbezogene und „andere“ Derivate (Tabellen 3A, 3B und 3C)

Als aktienbezogene Derivate gelten solche Kontrakte, deren Auszahlung von der Preisentwicklung einer bestimmten Aktie oder eines Aktienindex abhängt. Sie sind nach den Emissionsländern beziehungsweise -regionen der referenzierten Aktiva zu untergliedern.

Als rohstoffbezogene Derivate gelten solche Kontrakte, deren Auszahlung von der Preisentwicklung zum Beispiel eines Edelmetalls (außer Gold, siehe Tabelle 1A bis 1C), eines Agrarprodukts oder eines Energieträgers abhängt.

Als kreditbezogene Derivate gelten solche Kontrakte, deren Auszahlung von dem Maß der Kreditwürdigkeit eines bestimmten Referenzkredits abhängt. Die Kreditderivate sollten mindestens die Credit Default Swaps auf den Tabellen 6A bis 6E umfassen, können aber auch noch andere Instrumente beinhalten. Gesondert auszuweisen sind kreditbezogene Forwards, Swaps (Credit Event/Default Swaps, Total Return Swaps) und OTC-Optionen.

Als andere Derivate gelten alle Kontrakte, die kein währungs-, zins-, aktien-, rohstoff- oder kreditbezogenes Verlustrisiko beinhalten.

■ IV. Nominalwert der ausstehenden Kontrakte nach Restlaufzeiten (Tabelle 4)

Auf der Grundlage von Nominalwerten sind für währungsbezogene, zinsbezogene und aktienbezogene Kontrakte Restlaufzeiten anzugeben. Die Restlaufzeit bemisst sich als der Zeitraum zwischen dem Erhebungsstichtag und dem Verfallsdatum eines Kontrakts. Dabei ist nach den folgenden Laufzeitbändern zu unterscheiden:

- bis einschließlich ein Jahr
- über ein Jahr bis einschließlich fünf Jahre
- über fünf Jahre

Die Summe über alle Laufzeitbänder muss mit den auf den Tabellen 1A, 2A und 3A gemeldeten Nominalwerten kompatibel sein.

■ V. Bruttomarktwerte und Nettomarktwerte von derivativen OTC-Geschäften (Tabelle 5)

Es sind die Brutto- und Nettomarktwerte für die Gesamtheit der währungs- zins- sowie aktien- und rohstoffbezogenen Derivate anzugeben. Die hier ausgewiesenen Bruttomarktwerte müssen mit der Gesamtsumme der Bruttomarktwerte aus den Tabellen 1B/1C, 2B/2C und 3B/3C übereinstimmen.

■ VI. Credit Default Swaps (Tabellen 6A bis 6E)

Credit Default Swaps (CDS) sind zweiseitige Verträge, in denen ein Sicherungsnehmer gegen regelmäßige Zahlung einer fixen Prämie an einen Sicherungsgeber den Anspruch auf eine Ausgleichszahlung erwirbt, die dann fällig wird, wenn ein zuvor definiertes Schuldverhältnis notleidend werden sollte (ein „Kreditereignis“ eintritt).

Credit Linked Notes, Optionen auf CDS sowie Total Return Swaps sind nicht in die Meldung einzubeziehen.

Single-Name CDS sind Kontrakte, bei denen die vertraglich vereinbarte Ausgleichszahlung vom Zustand der Kreditwürdigkeit eines einzelnen Referenzschuldners oder eines einzelnen Referenzaktivums abhängt.

Multi-Name CDS sind Kontrakte, die sich auf die Übertragung der Kreditrisiken ganzer Kreditkörbe beziehen oder denen die Übertragung von Risiken aus tranchierten Forderungspools zugrunde liegt. Auch Index-CDS gehören hierzu. Ebenso sind hierunter Geschäfte aufzuführen, denen sektorübergreifende Forderungen zugrunde liegen.

CDS auf verbriefte Produkte: Hierunter fallen Credit Default Swaps, denen Kreditkörbe oder tranchierte Forderungspools zugrunde liegen, die in Form synthetischer ABS/MBS oder anderer komplexer Strukturen (z.B. CDOs) verbrieft sind.

CDS auf sektoral gemischte Portfolios umfassen solche Instrumente, die sich nach der Zusammensetzung ihrer Referenzaktiva sektoral nicht eindeutig zuordnen lassen.

CDS auf Indexprodukte: Standardisierte Multi-Name-Kontrakte, deren Referenzaktiva einen (z. B. unter Länder-, Branchen-, Rating- oder Liquiditätsgesichtspunkten) homogenen Kreis von Adressen abbilden und die von einem professionellen Administrator wie zum Beispiel Markit (der die Rechte für die geläufigen CDX und iTraxx-Indizes besitzt) vermarktet werden.

Rating-Kategorien: Anzugeben ist das aktuelle Rating und nicht das Rating bei Vertragsabschluss. Sofern keine öffentlichen Ratings verfügbar sind, können interne Ratings verwendet werden. Sollten für ein Referenzaktivum zwei öffentliche Ratingeinstufungen verfügbar sein, ist das niedrigere Ratingurteil maßgeblich.

Bei Single-Name-Instrumenten ist die Zuordnung nach dem Rating des zugrunde liegenden Referenzaktivums, bei Multi-Name-Instrumenten nach dem Rating der jeweiligen Körbe beziehungsweise Tranchen vorzunehmen. Multi-Name CDS, für die kein Korb-Rating verfügbar ist, deren Referenzaktiva jedoch durchgängig als „investment grade“ klassifiziert sind, sollen als „Multiple Ratings investment grade“ ausgewiesen werden.

Verzeichnis der Meldungen zur Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

Melde- schema/ Vordruck	Bezeichnung der Meldung	Kennzeichnung der Meldung/ der Anlage	Seite
	I. Währungsbezogene Derivate, zinsbezogene Derivate, Aktien- und rohstoffbezogene Derivate¹⁾		
1A	Währungsbezogene Derivate Nominalwert der ausstehenden Kontrakte	Tabelle 1A	706
1B	Währungsbezogene Derivate Positive Marktwerte	Tabelle 1B	707
1C	Währungsbezogene Derivate Negative Marktwerte	Tabelle 1C	708
2A	Zinsbezogene Derivate Nominalwert der ausstehenden Kontrakte	Tabelle 2A	709
2B	Zinsbezogene Derivate Positive Marktwerte	Tabelle 2B	710
2C	Zinsbezogene Derivate Negative Marktwerte	Tabelle 2C	711
3A	Aktien- und rohstoffbezogene Derivate Nominalwert der ausstehenden Kontrakte	Tabelle 3A	712
3B	Aktien- und rohstoffbezogene Derivate Positive Marktwerte	Tabelle 3B	713
3C	Aktien- und rohstoffbezogene Derivate Negative Marktwerte	Tabelle 3C	714
4	Nominalwerte der ausstehenden Kontrakte nach Restlaufzeiten	Tabelle 4	715
5	Bruttomarktwerte und Nettomarktwerte von derivativen OTC-Geschäften	Tabelle 5	716

¹ Auf sämtlichen Tabellen sind nur die unterlegten Zellen auszufüllen.

Melde- schema/ Vordruck	Bezeichnung der Meldung	Kennzeichnung der Meldung/ der Anlage	Seite
	II. Credit Default Swaps¹⁾		
6A	Nominalwerte, Bruttomarktwerte, Nettomarktwerte der ausstehenden Kontrakte	Tabelle 6A	717
6B	Gliederung der Kontrakte nach Rating-Kategorien	Tabelle 6B	718
6C	Gliederung der Kontrakte nach dem Sektor der Referenzaktiva	Tabelle 6C	718
6D	Gliederung der Kontrakte nach Restlaufzeiten	Tabelle 6D	719
6E	Gliederung der Kontrakte nach der Nationalität der Gegenpartei	Tabelle 6E	719

1 Auf sämtlichen Tabellen sind nur die unterlegten Zellen auszufüllen.

Tabelle 1A

Berichtendes Kreditinstitut: _____

Halbjahr: _____

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

WÄHRUNGSBEZOGENE DERIVATE ¹⁾
Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	SEK	AUD	HKD	Übrige	Gesamt
<u>OUTRIGHT FORWARDS</u>											
<u>UND FX SWAPS ²⁾</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
SUMME EINSCHL. GOLD											
<u>WÄHRUNGSSWAPS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>OTC OPTIONEN ³⁾</u>											
<u>Geschrieben</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
SUMME EINSCHL. GOLD											
<u>Gekauft</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
SUMME EINSCHL. GOLD											
SUMME OTC OPTIONEN											
Andere Instrumente ⁴⁾											
<u>FX-KONTRAKTE INSGESAMT</u>											
FX-KONTRAKTE INSGESAMT											
EINSCHLIESSLICH GOLD											

1) Alle Instrumente - sowohl im Währungs- als auch im Zinsbereich - mit Exposure gegenüber mehr als einer Währung. 2) Wenn Swaps auf Forward/Forward Basis vereinbart worden sind, sollen die beiden Forward-Komponenten separat gemeldet werden. 3) Einschließlich Currency Warrants und Multicurrency Swaptions. 4) Alle Instrumente, bei denen die Transaktion im hohen Maße fremdfinanziert und/oder der Nominalwert variabel ist und bei denen eine Zerlegung in einzelne standardisierte Bestandteile unzweckmäßig oder unmöglich ist.

Tabelle 1B

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

WÄHRUNGSBEZOGENE DERIVATE ¹⁾
Positive Marktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	SEK	AUD	HKD	Übrige	Gesamt
<u>OUTRIGHT FORWARDS</u>											
<u>UND FX SWAPS ²⁾</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>WÄHRUNGSSWAPS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>OTC OPTIONEN GEKAUFT ³⁾</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>FX-KONTRAKTE INSGESAMT</u>											
FX-KONTRAKTE INSGESAMT											
EINSCHLIESSLICH GOLD											

1) Alle Instrumente - sowohl im Währungs- als auch im Zinsbereich - mit Exposure gegenüber mehr als einer Währung. 2) Wenn Swaps auf Forward/Forward Basis vereinbart worden sind, sollen die beiden Forward-Komponenten separat gemeldet werden. 3) Einschließlich Currency Warrants und Multicurrency Swaptions.

Tabelle 1C

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

WÄHRUNGSBEZOGENE DERIVATE ¹⁾
Negative Marktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	SEK	AUD	HKD	Übrige	Gesamt
<u>OUTRIGHT FORWARDS</u>											
<u>UND FX SWAPS ²⁾</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>WÄHRUNGSSWAPS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>OTC OPTIONEN GESCHRIEBEN ³⁾</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>FX-KONTRAKTE INSGESAMT</u>											
FX-KONTRAKTE INSGESAMT											
EINSCHLIESSLICH GOLD											

1) Alle Instrumente - sowohl im Währungs- als auch im Zinsbereich - mit Exposure gegenüber mehr als einer Währung. 2) Wenn Swaps auf Forward/Forward Basis vereinbart worden sind, sollen die beiden Forward-Komponenten separat gemeldet werden. 3) Einschließlich Currency Warrants und Multicurrency Swaptions.

Tabelle 2A

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

ZINSBEZOGENE DERIVATE ¹⁾
Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	SEK	AUD	HKD	Übrige	Gesamt
<u>FORWARD RATE AGREEMENTS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>ZINSSWAPS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>OTC ZINS-OPTIONEN</u>											
<u>Geschrieben</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>Gekauft</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
SUMME OTC ZINS-OPTIONEN											
Andere Instrumente ²⁾											
ZINSBEZOGENE KONTRAKTE											
INSGESAMT											

1) Alle Instrumente, die Exposure gegenüber dem Zinssatz in nur einer einzigen Währung aufweisen, einschließlich aller auf eine einzige Währung lautenden Fixed/Floating und Floating/Floating-Kontrakte. 2) Alle Instrumente, bei denen die Transaktion im hohen Maße fremdfinanziert und/oder der Nominalwert variabel ist und bei denen eine Zerlegung in einzelne standardisierte Bestandteile unzumutbar oder unmöglich ist.

Tabelle 2B

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

ZINSBEZOGENE DERIVATE ¹⁾

Positive Marktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	SEK	AUD	HKD	Übrige	Gesamt
<u>FORWARD RATE AGREEMENTS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>ZINSSWAPS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>OTC OPTIONEN GEKAUFT</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
ZINSBEZOGENE KONTRAKTE INSGESAMT											

1) Alle Instrumente, die Exposure gegenüber dem Zinssatz in nur einer einzigen Währung aufweisen, einschließlich aller auf eine einzige Währung lautenden Fixed/Floating und Floating/Floating-Kontrakte.

Tabelle 2C

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

ZINSBEZOGENE DERIVATE ¹⁾

Negative Marktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	USD	EUR	JPY	GBP	CHF	CAD	SEK	AUD	HKD	Übrige	Gesamt
<u>FORWARD RATE AGREEMENTS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>ZINSSWAPS</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
<u>OTC OPTIONEN GESCHRIEBEN</u>											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentralen Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
ZINSBEZOGENE KONTRAKTE INSGESAMT											

1) Alle Instrumente, die Exposure gegenüber dem Zinssatz in nur einer einzigen Währung aufweisen, einschließlich aller auf eine einzige Währung lautenden Fixed/Floating und Floating/Floating-Kontrakte.

Tabelle 3A

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

AKTIEN-, ROHSTOFF-, KREDITBEZOGENE UND "ANDERE" DERIVATE ¹⁾
Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	Aktienbezogene Derivate mit Underlying aus ...							Edelmetalle (ohne Gold)	Andere Rohstoffe	Kredit- derivate ³⁾	Andere Derivate ⁴⁾
	USA	Japan	West- Europa ²⁾	Latein Amerika	Asien ex Japan	Anderen Ländern	SUMME				
FORWARDS UND SWAPS											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
OTC OPTIONEN											
Geschrieben											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
Gekauft											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
SUMME OTC OPTIONEN											
ALLE KONTRAKTE											

1) Alle Instrumente, deren Wert über den Preis einer Aktie, eines Aktienindex oder eines Rohstoffs bestimmt wird. 2) Westeuropäische EU-Länder, Norwegen, Türkei und die Schweiz. 3) Einschließlich Credit Default Swaps. 4) Alle Instrumente, die kein währungs-, zins-, aktien-, rohstoff- oder kreditbezogenes Verlustrisiko beinhalten.

Tabelle 3B

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate
AKTIEN-, ROHSTOFF-, KREDITBEZOGENE UND "ANDERE" DERIVATE ¹⁾
Positive Marktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	Aktienbezogene Derivate mit Underlying aus ...							Edelmetalle (ohne Gold)	Andere Rohstoffe	Kredit- derivate ³⁾	Andere Derivate ⁴⁾
	USA	Japan	West- Europa ²⁾	Latein Amerika	Asien ex Japan	Anderen Ländern	SUMME				
FORWARDS UND SWAPS											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
OTC OPTIONEN GEKAUFT											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
ALLE KONTRAKTE											

1) Alle Instrumente, deren Wert über den Preis einer Aktie, eines Aktienindex oder eines Rohstoffs bestimmt wird. 2) Westeuropäische EU-Länder, Norwegen, Türkei und die Schweiz. 3) Einschließlich Credit Default Swaps. 4) Alle Instrumente, die kein währungs-, zins-, aktien-, rohstoff- oder kreditbezogenes Verlustrisiko beinhalten.

Tabelle 3C

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

AKTIEN-, ROHSTOFF-, KREDITBEZOGENE UND "ANDERE" DERIVATE ¹⁾
Negative Marktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente	Aktienbezogene Derivate mit Underlying aus ...							Edelmetalle (ohne Gold)	Andere Rohstoffe	Kredit- derivate ³⁾	Andere Derivate ⁴⁾
	USA	Japan	West- Europa ²⁾	Latein Amerika	Asien ex Japan	Anderen Ländern	SUMME				
FORWARDS UND SWAPS											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
OTC OPTIONEN GESCHRIEBEN											
mit berichtenden Banken											
mit anderen Finanzinstitutionen											
darunter mit zentr. Gegenparteien											
mit nichtfinanziellen Kunden											
SUMME											
ALLE KONTRAKTE											

1) Alle Instrumente, deren Wert über den Preis einer Aktie, eines Aktienindex oder eines Rohstoffs bestimmt wird. 2) Westeuropäische EU-Länder, Norwegen, Türkei und die Schweiz. 3) Einschließlich Credit Default Swaps. 4) Alle Instrumente, die kein währungs-, zins-, aktien-, rohstoff- oder kreditbezogenes Verlustrisiko beinhalten.

Tabelle 5

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

**BRUTTOMARKTWERTE UND NETTOMARKTWERTE
VON DERIVATIVEN OTC-GESCHÄFTEN**

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Gegenparteien	Bruttomarktwerte		Nettomarktwerte	
	Positive	Negative	Kredit-Exposure ¹⁾	Netto- verpflichtungen ²⁾
ALLE KONTRAKTE ³⁾				
mit berichtenden Banken				
mit anderen Finanzinstitutionen				
mit nichtfinanziellen Unternehmen				
SUMME				

1) Kredit-Exposure ist definiert als der positive Wiederbeschaffungswert ausstehender OTC-Kontrakte nach Berücksichtigung rechtlich bindender bilateraler Aufrechnungsvereinbarungen. 2) Nettoverpflichtungen gegenüber Kontrahenten sind definiert als der negative Wiederbeschaffungswert ausstehender OTC-Kontrakte nach Berücksichtigung rechtlich bindender bilateraler Aufrechnungsvereinbarungen. 3) Ohne Credit Default Swaps; deren Bruttomarktwerte und Nettomarktwerte sind in der Tabelle 6A gesondert auszuweisen.

Tabelle 6A

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

CREDIT DEFAULT SWAPS INSGESAMT

Nominalwerte, Bruttomarktwerte, Nettomarktwerte der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente und Gegenparteien		Ausstehende Kontrakte insgesamt					
		Nominalwerte		Bruttomarktwerte		Nettomarktwerte	
		Als Sicherungsnehmer	Als Sicherungsgeber	Positive Bruttomarktwerte	Negative Bruttomarktwerte	Kredit-Exposure ¹⁾	Netto-Verpflichtungen ²⁾
		1	2	3	4	5	6
ALLE KONTRAKTE (005 + 010 + 070)	000						
mit berichtenden Banken ³⁾	005						
mit anderen Finanzinstitutionen (020+025+030+040+050+060)	010						
Banken und Wertpapierhäuser	020						
Zentrale Gegenparteien	025						
Versicherungsunternehmen ⁴⁾	030						
SPVs	040						
Hedge funds	050						
Andere Finanzinstitutionen	060						
mit nichtfinanziellen Unternehmen	070						
SINGLE-NAME CDS (105 + 110 + 170)	100						
mit berichtenden Banken ³⁾	105						
mit anderen Finanzinstitutionen (120+125+130+140+150+160)	110						
Banken und Wertpapierhäuser	120						
Zentrale Gegenparteien	125						
Versicherungsunternehmen ⁴⁾	130						
SPVs	140						
Hedge funds	150						
Andere Finanzinstitutionen	160						
mit nichtfinanziellen Unternehmen	170						
MULTI-NAME CDS (185 + 190 + 250)	180						
mit berichtenden Banken ³⁾	185						
mit anderen Finanzinstitutionen (200+205+210+220+230+240)	190						
Banken und Wertpapierhäuser	200						
Zentrale Gegenparteien	205						
Versicherungsunternehmen ⁴⁾	210						
SPVs	220						
Hedge funds	230						
Andere Finanzinstitutionen	240						
mit nichtfinanziellen Unternehmen	250						

1) Kredit-Exposure ist definiert als der positive Wiederbeschaffungswert ausstehender OTC-Kontrakte nach Berücksichtigung rechtlich bindender bilateraler Aufrechnungsvereinbarungen. 2) Nettoverpflichtungen sind definiert als der negative Wiederbeschaffungswert ausstehender OTC-Kontrakte nach Berücksichtigung rechtlich bindender Aufrechnungsvereinbarungen. 3) Als "berichtende Banken" gelten alle Institute, die an der Halbjährlichen OTC-Derivate Statistik der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich teilnehmen (vgl. die von der Bundesbank zur Verfügung gestellte Liste der "berichtenden Banken"). 4) Einschließlich Pensionsfonds, Rückversicherer und Monoliner.

Tabelle 6B

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

CREDIT DEFAULT SWAPS NACH RATING-KATEGORIEN
Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente und Gegenparteien	Rating-Kategorien ¹⁾																			
	AAA/AA				A/BBB				BB und darunter				ohne Rating				Multiple Ratings "investment grade" ²⁾			
	Sicherungsnehmer		Sicherungsgeber		Sicherungsnehmer		Sicherungsgeber		Sicherungsnehmer		Sicherungsgeber		Sicherungsnehmer		Sicherungsgeber		Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsgeber	
	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch	Anlagebuch	Handelsbuch
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20
SINGLE-NAME CDS (105 + 110 + 170)	100																			
mit berichtenden Banken ³⁾	105																			
mit anderen Finanzinstitutionen (120+125+130+140+150+160)	110																			
Banken und Wertpapierhäuser	120																			
Zentrale Gegenparteien	125																			
Versicherungsunternehmen ⁴⁾	130																			
SPVs	140																			
Hedge funds	150																			
Andere Finanzinstitutionen	160																			
mit nichtfinanziellen Unternehmen	170																			
MULTI-NAME CDS (185 + 190 + 250)	180																			
mit berichtenden Banken ³⁾	185																			
mit anderen Finanzinstitutionen (200+205+210+220+230+240)	190																			
Banken und Wertpapierhäuser	200																			
Zentrale Gegenparteien	205																			
Versicherungsunternehmen ⁴⁾	210																			
SPVs	220																			
Hedge funds	230																			
Andere Finanzinstitutionen	240																			
mit nichtfinanziellen Unternehmen	250																			

1) Bei Single-Name Instrumenten ist die Zuordnung nach dem Rating des zugrunde liegenden Referenzaktivums, bei Multi-Name Instrumenten nach dem Rating der jeweiligen Körbe bzw. Tranchen vorzunehmen. 2) Multi-Name CDS, für die kein Korb-Rating verfügbar ist, deren Referenzaktiva jedoch durchgängig als "investment grade" klassifiziert sind. 3) Als "berichtende Banken" gelten alle Institute, die an der Halbjährlichen OTC-Derivatestatistik der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich teilnehmen (vgl. die von der Bundesbank bereitgestellte Liste der "berichtenden Banken"). 4) Einschließlich Pensionsfonds, Rückversicherer und Monoliner.

Tabelle 6C

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

CREDIT DEFAULT SWAPS NACH DEM SEKTOR DER REFERENZAKTIVA
Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente und Gegenparteien	Sektoren der Referenzaktiva															
	Finanzinstitutionen		Nichtfinanzielle Unternehmen		Öffentliche Haushalte		Verbriefte Produkte				Sektoral gemischte Portfolios		Indexprodukte			
	Sicherungsnehmer		Sicherungsgeber		Sicherungsnehmer		Sicherungsgeber		ABS / MBS		Andere Verbriefungen		Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14		
SINGLE-NAME CDS (105 + 110 + 170)	100															
mit berichtenden Banken ¹⁾	105															
mit anderen Finanzinstitutionen (120+125+130+140+150+160)	110															
Banken und Wertpapierhäuser	120															
Zentrale Gegenparteien	125															
Versicherungsunternehmen ²⁾	130															
SPVs	140															
Hedge funds	150															
Andere Finanzinstitutionen	160															
mit nichtfinanziellen Unternehmen	170															
MULTI-NAME CDS (185 + 190 + 250)	180															
mit berichtenden Banken ¹⁾	185															
mit anderen Finanzinstitutionen (200+205+210+220+230+240)	190															
Banken und Wertpapierhäuser	200															
Zentrale Gegenparteien	205															
Versicherungsunternehmen ²⁾	210															
SPVs	220															
Hedge funds	230															
Andere Finanzinstitutionen	240															
mit nichtfinanziellen Unternehmen	250															

1) Als "berichtende Banken" gelten alle Institute, die an der Halbjährlichen OTC-Derivatestatistik der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich teilnehmen (vgl. die von der Bundesbank bereitgestellte Liste der "berichtenden Banken"). 2) Einschließlich Pensionsfonds, Rückversicherer und Monoliner.

Tabelle 6D

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

CREDIT DEFAULT SWAPS NACH RESTLAUFZEITEN

Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Instrumente und Gegenparteien		Restlaufzeit der Geschäfte													
		bis einschließlich 1 Jahr		über 1 Jahr bis einschließlich 5 Jahre		über 5 Jahre									
		Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber								
		1	2	3	4	5	6								
SINGLE-NAME CDS (105 + 110 + 170)	100														
mit berichtenden Banken ¹⁾	105														
mit anderen Finanzinstitutionen (120+125+130+140+150+160)	110														
Banken und Wertpapierhäuser	120														
Zentrale Gegenparteien	125														
Versicherungsunternehmen ²⁾	130														
SPVs	140														
Hedge funds	150														
Anderer Finanzinstitutionen	160														
mit nichtfinanziellen Unternehmen	170														
MULTI-NAME CDS (185 + 190 + 250)	180														
mit berichtenden Banken ¹⁾	185														
mit anderen Finanzinstitutionen (200+205+210+220+230+240)	190														
Banken und Wertpapierhäuser	200														
Zentrale Gegenparteien	205														
Versicherungsunternehmen ²⁾	210														
SPVs	220														
Hedge funds	230														
Anderer Finanzinstitutionen	240														
mit nichtfinanziellen Unternehmen	250														

1) Als "berichtende Banken" gelten alle Institute, die an der Halbjährlichen OTC-Derivatestatistik der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich teilnehmen (vgl. die von der Bundesbank bereitgestellte Liste der "berichtenden Banken"). 2) Einschließlich Pensionsfonds, Rückversicherer und Monoliner.

Tabelle 6E

Berichtendes Kreditinstitut:

Halbjahr:

Halbjährliche Statistik über den Bestand außerbörslich gehandelter Derivate

CREDIT DEFAULT SWAPS NACH DER NATIONALITÄT DER GEGENPARTEI

Nominalwert der ausstehenden Kontrakte

Stand zum Ende des Halbjahres, Beträge in Millionen US-Dollar

Kontrahenten		Nationalität (= Sitzland der Unternehmenszentrale) des Kontrahenten															
		Alle Länder zusammen		Deutschland		West-Europa ¹⁾		Vereinigte Staaten		Japan		Andere asiatische Länder		Lateinamerika		Übrige Länder	
		Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber	Sicherungsnehmer	Sicherungsgeber
		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16
Alle Kontrahenten (005 + 010 + 070)	000																
Berichtende Banken ²⁾	005																
Anderer Finanzinstitutionen (020+025+030+040+050+060)	010																
Banken und Wertpapierhäuser	020																
Zentrale Gegenparteien	025																
Versicherungsunternehmen ³⁾	030																
SPVs	040																
Hedge funds	050																
Anderer Finanzinstitutionen	060																
Nichtfinanzielle Unternehmen	070																

1) Westeuropäische EU-Länder (ohne Deutschland), Norwegen, Türkei und die Schweiz. 2) Als "berichtende Banken" gelten alle Institute, die an der Halbjährlichen OTC-Derivatestatistik der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich teilnehmen (vgl. die von der Bundesbank bereitgestellte Liste der "berichtenden Banken"). 3) Einschließlich Pensionsfonds, Rückversicherer und Monoliner.

■ Anordnung

Mitteilung Nr. 8001/2010
Meldebestimmungen

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

OTC-
Derivate
Statistik

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