



EUROPÄISCHE ZENTRALBANK

EUROSYSTEM

5. Oktober 2011

## PRESSEMITTEILUNG

### KONSOLIDIRTER AUSWEIS DES EUROSYSTEMS ZUM 30. SEPTEMBER 2011

#### Positionen, die nicht mit geldpolitischen Operationen zusammenhängen

In der Woche zum 30. September 2011 spiegelte der Anstieg um 56,8 Mrd EUR in **Gold und Goldforderungen** (Aktiva I) eine vierteljährliche Neubewertung wider.

Die Nettoposition des Eurosystems in Fremdwährung (Aktiva 2 und 3 abzüglich Passiva 7, 8 und 9) erhöhte sich um 13,2 Mrd EUR auf 191,1 Mrd EUR. Diese Änderung war auf die Auswirkungen der vierteljährlichen Neubewertung von Aktiva und Passiva, auf von Zentralbanken des Eurosystems im Betrachtungszeitraum durchgeführte Kunden- und Portfoliotransaktionen sowie auf liquiditätszuführende Geschäfte in US-Dollar (siehe unten) zurückzuführen.

#### Liquiditätszuführende Geschäfte in US-Dollar

Valutatag	Art der Transaktion	Fällig werdender Betrag	Neuer Betrag
29. September 2011	Befristete Transaktion zur Bereitstellung von Liquidität in US-Dollar mit einer Laufzeit von sieben Tagen	0,5 Mrd USD	0,5 Mrd USD

Die liquiditätszuführenden Transaktionen wurden vom Eurosystem im Zusammenhang mit dem befristeten wechselseitigen Währungsabkommen (Swap-Vereinbarung) zwischen der Europäischen Zentralbank und dem Federal Reserve System durchgeführt.

Die Bestände des Eurosystems an marktfähigen **Sonstigen Wertpapieren** (d. h. an Wertpapieren, die nicht für geldpolitische Zwecke gehalten werden) (Aktiva 7.2) nahmen um 0,5 Mrd EUR auf 336,7 Mrd EUR zu. Der **Banknotenumlauf** (Passiva I) stieg um 4,9 Mrd EUR auf 857,4 Mrd EUR. Die **Einlagen von öffentlichen Haushalten** (Passiva 5.1) gingen um 4,8 Mrd EUR auf 51,6 Mrd EUR zurück.

## Positionen im Zusammenhang mit geldpolitischen Operationen

Die Nettoforderungen des Eurosystems an Kreditinstitute (Aktiva 5 abzüglich Passiva 2.2, 2.3, 2.4, 2.5 und 4) verringerten sich um 34,1 Mrd EUR auf 230,6 Mrd EUR. Am Mittwoch, dem 28. September 2011, wurde ein **Hauptrefinanzierungsgeschäft** in Höhe von 201,1 Mrd EUR fällig, und ein neues Geschäft in Höhe von 208,3 Mrd EUR wurde abgewickelt. Am selben Tag wurden **Termineinlagen** in Höhe von 152,5 Mrd EUR fällig, und neue Einlagen in Höhe von 156,5 Mrd EUR mit einer Laufzeit von einer Woche wurden hereingenommen. Am Donnerstag, dem 29. September 2011, wurde ein **längerfristiges Refinanzierungsgeschäft** in Höhe von 132,2 Mrd EUR fällig, und ein neues Geschäft in Höhe von 140,6 Mrd EUR wurde abgewickelt.

Die Inanspruchnahme der **Spitzenrefinanzierungsfazilität** (Aktiva 5.5) betrug 1,4 Mrd EUR (gegenüber 0,5 Mrd EUR in der Vorwoche). Die Inanspruchnahme der **Einlagefazilität** (Passiva 2.2) belief sich auf 199,6 Mrd EUR (gegenüber 150,7 Mrd EUR in der Vorwoche).

Die Bestände des Eurosystems an **Wertpapieren für geldpolitische Zwecke** (Aktiva 7.1) stiegen um 4 Mrd EUR auf 219,9 Mrd EUR. Diese Zunahme war das Ergebnis des Erwerbs von Titeln im Rahmen des Programms für die Wertpapiermärkte, der Tilgung von Wertpapieren im Rahmen des Programms zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen und der Anpassungen zum Quartalsende. In der Woche zum 30. September 2011 betrug der Wert der Portfolios, die im Rahmen des Programms für die Wertpapiermärkte sowie im Rahmen des Programms zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen gehalten werden, somit insgesamt 160,7 Mrd EUR bzw. 59,2 Mrd EUR. Die in den beiden Portfolios enthaltenen Schuldtitel werden in den Büchern als Held-to-maturity-Wertpapiere geführt.

## Einlagen der Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet auf Girokonten

Im Ergebnis aller Transaktionen sanken die **Einlagen** der Kreditinstitute **auf Girokonten** beim Eurosystem (Passiva 2.1) um 18,7 Mrd EUR auf 204,9 Mrd EUR.

## Neubewertung der Aktiva und Passiva des Eurosystems zum Quartalsende

Gemäß den harmonisierten Rechnungslegungsgrundsätzen für das Eurosystem werden Gold, Devisen, Wertpapierbestände und Finanzinstrumente des Eurosystems zu jedem Quartalsende zu Marktkursen und -preisen bewertet. Die Nettoauswirkung der Neubewertung auf die einzelnen Ausweispositionen zum 30. September 2011 wird in der zusätzlichen Rubrik „**Veränderungen zur Vorwoche aufgrund von Anpassungen zum Quartalsende**“ ausgewiesen. Im Folgenden sind der Goldpreis und die wichtigsten Wechselkurse aufgeführt, die für die Neubewertung der einzelnen Positionen herangezogen wurden:

Gold: 1.206,399 EUR je Unze Feingold

USD: 1,3503 je EUR

JPY: 103,79 je EUR

Sonderziehungsrechte: 1,1564 EUR je SZR

**Europäische Zentralbank**

Direktion Kommunikation, Abteilung Presse und Information

Kaiserstraße 29, D-60311 Frankfurt am Main

Tel.: +49 69 1344 7455, Fax: +49 69 1344 7404

Internet: <http://www.ecb.europa.eu>

**Nachdruck nur mit Quellenangabe gestattet.**

## Konsolidierter Ausweis des Eurosystems - 05/10/2011

Aktiva (in Millionen EUR)	Stand	Veränderungen zur Vorwoche aufgrund von		Passiva (in Millionen EUR)	Stand	Veränderungen zur Vorwoche aufgrund von	
		i) Transaktionen	ii) Anpassungen zum Quartalsende			i) Transaktionen	ii) Anpassungen zum Quartalsende
		i)	ii)			i)	ii)
<b>1 Gold und Goldforderungen</b>	<b>420.005</b>	<b>0</b>	<b>56.756</b>	<b>1 Banknotenumlauf</b>	<b>857.372</b>	<b>4.882</b>	<b>0</b>
<b>2 Forderungen in Fremdwährung an Ansässige außerhalb des Euro-Währungsgebiets</b>	<b>226.522</b>	<b>-155</b>	<b>13.659</b>	<b>2 Verbindlichkeiten in Euro aus geldpolitischen Operationen gegenüber Kreditinstituten im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>563.015</b>	<b>32.985</b>	<b>0</b>
2.1 Forderungen an den IWF	80.402	-7	3.308	2.1 Einlagen auf Girokonten (einschließlich Mindestreserveguthaben)	204.871	-18.654	0
2.2 Guthaben bei Banken, Wertpapieranlagen, Auslandskredite und sonstige Auslandsaktiva	146.120	-149	10.351	2.2 Einlagefazilität	199.639	48.988	0
<b>3 Forderungen in Fremdwährung an Ansässige im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>35.327</b>	<b>1.370</b>	<b>2.385</b>	2.3 Termineinlagen	156.500	4.000	0
<b>4 Forderungen in Euro an Ansässige außerhalb des Euro-Währungsgebiets</b>	<b>19.694</b>	<b>-991</b>	<b>48</b>	2.4 Feinsteuerungsoperationen in Form von befristeten Transaktionen	0	0	0
4.1 Guthaben bei Banken, Wertpapieranlagen und Kredite	19.694	-991	48	2.5 Verbindlichkeiten aus Margenausgleich	2.004	-1.349	0
4.2 Forderungen aus der Kreditfazilität im Rahmen des WKM II	0	0	0	<b>3 Sonstige Verbindlichkeiten in Euro gegenüber Kreditinstituten im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>3.298</b>	<b>-1.264</b>	<b>0</b>
<b>5 Forderungen in Euro aus geldpolitischen Operationen an Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>588.786</b>	<b>17.492</b>	<b>0</b>	<b>4 Verbindlichkeiten aus der Begebung von Schuldverschreibungen</b>	<b>0</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
5.1 Hauptrefinanzierungsgeschäfte	208.349	7.200	0	<b>5 Verbindlichkeiten in Euro gegenüber sonstigen Ansässigen im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>59.740</b>	<b>-4.665</b>	<b>0</b>
5.2 Längerfristige Refinanzierungsgeschäfte	378.935	9.299	0	5.1 Einlagen von öffentlichen Haushalten	51.646	-4.796	0
5.3 Feinsteuerungsoperationen in Form von befristeten Transaktionen	0	0	0	5.2 Sonstige Verbindlichkeiten	8.094	131	0
5.4 Strukturelle Operationen in Form von befristeten Transaktionen	0	0	0	<b>6 Verbindlichkeiten in Euro gegenüber Ansässigen außerhalb des Euro-Währungsgebiets</b>	<b>50.036</b>	<b>-6.725</b>	<b>413</b>
5.5 Spitzenrefinanzierungsfazilität	1.414	939	0	<b>7 Verbindlichkeiten in Fremdwährung gegenüber Ansässigen im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>2.476</b>	<b>-3</b>	<b>149</b>
5.6 Forderungen aus Margenausgleich	88	54	0	<b>8 Verbindlichkeiten in Fremdwährung gegenüber Ansässigen außerhalb des Euro-Währungsgebiets</b>	<b>13.802</b>	<b>765</b>	<b>787</b>
<b>6 Sonstige Forderungen in Euro an Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>52.322</b>	<b>2.168</b>	<b>0</b>	8.1 Einlagen, Guthaben und sonstige Verbindlichkeiten	13.802	765	787
<b>7 Wertpapiere in Euro von Ansässigen im Euro-Währungsgebiet</b>	<b>556.662</b>	<b>3.601</b>	<b>938</b>	8.2 Verbindlichkeiten aus der Kreditfazilität im Rahmen des WKM II	0	0	0
7.1 Wertpapiere für geldpolitische Zwecke	219.941	3.756	280	<b>9 Ausgleichsposten für vom IWF zugeteilte Sonderziehungsrechte</b>	<b>54.486</b>	<b>0</b>	<b>2.316</b>
7.2 Sonstige Wertpapiere	336.721	-155	658	<b>10 Sonstige Passiva</b>	<b>219.590</b>	<b>1.702</b>	<b>10.536</b>
<b>8 Forderungen in Euro an öffentliche Haushalte</b>	<b>33.965</b>	<b>0</b>	<b>16</b>	<b>11 Ausgleichsposten aus Neubewertung</b>	<b>383.276</b>	<b>0</b>	<b>66.619</b>
<b>9 Sonstige Aktiva</b>	<b>355.289</b>	<b>4.192</b>	<b>7.017</b>	<b>12 Kapital und Rücklagen</b>	<b>81.481</b>	<b>0</b>	<b>0</b>
<b>Aktiva insgesamt</b>	<b>2.288.571</b>	<b>27.677</b>	<b>80.819</b>				

Differenzen in den Summen durch Runden der Zahlen.

<b>Passiva insgesamt</b>	<b>2.288.571</b>	<b>27.677</b>	<b>80.819</b>
--------------------------	------------------	---------------	---------------