



EUROPÄISCHE ZENTRALBANK

EUROSYSTEM

7. Oktober 2015

PRESSEMITTEILUNG

KONSOLIDIERTER AUSWEIS DES EUROSYSTEMS ZUM 2. OKTOBER 2015

Positionen, die nicht mit geldpolitischen Operationen zusammenhängen

In der Woche zum 2. Oktober 2015 spiegelte der Rückgang der Position **Gold und Goldforderungen** (Aktiva 1) um 15,6 Mrd EUR eine vierteljährliche Neubewertung wider.

Die Nettoposition des Eurosystems in Fremdwährung (Aktiva 2 und 3 abzüglich Passiva 7, 8 und 9) verringerte sich um 1,3 Mrd EUR auf 263,4 Mrd EUR. Diese Änderung war auf die Auswirkungen der vierteljährlichen Neubewertung von Aktiva und Passiva sowie auf von Zentralbanken des Eurosystems im Betrachtungszeitraum durchgeführte Kunden- und Portfoliotransaktionen und liquiditätszuführende Geschäfte in US-Dollar (siehe unten) zurückzuführen.

Liquiditätszuführende Geschäfte in US-Dollar

| Valutatag | Art der Transaktion | Fällig werdender Betrag | Neuer Betrag |
|-----------------|--|-------------------------|--------------|
| 1. Oktober 2015 | Befristete Transaktion zur Bereitstellung von Liquidität in US-Dollar mit einer Laufzeit von 7 Tagen | 142 Mio USD | 143 Mio USD |

Die liquiditätszuführenden Transaktionen wurden vom Eurosystem im Zusammenhang mit der unbefristeten 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 0,2 Mrd EUR auf 359,1 Mrd EUR zu. Der **Banknotenumlauf** (Passiva 1) erhöhte sich um

2,6 Mrd EUR auf 1 054,2 Mrd EUR. Die **Einlagen von öffentlichen Haushalten** (Passiva 5.1) gingen um 26,7 Mrd EUR auf 88,7 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 13,1 Mrd EUR auf 391,1 Mrd EUR. Am Mittwoch, dem 30. September 2015, wurde ein **Hauptrefinanzierungsgeschäft** (Aktiva 5.1) in Höhe von 71,1 Mrd EUR fällig, und ein neues Geschäft in Höhe von 72,6 Mrd EUR mit einer Laufzeit von sieben Tagen wurde abgewickelt.

Im Lauf der Woche wurde ein **längerfristiges Refinanzierungsgeschäft** in Höhe von 17,3 Mrd EUR fällig, und ein neues Geschäft in Höhe von 11,8 Mrd EUR wurde abgewickelt. Weiterhin wurde ein **gezieltes längerfristiges Refinanzierungsgeschäft** in Höhe von 15,5 Mrd EUR mit einer Laufzeit von 1 092 Tagen abgewickelt.

Die Inanspruchnahme der **Spitzenrefinanzierungsfazilität** (Aktiva 5.5) betrug 0,6 Mrd EUR (gegenüber praktisch null in der Vorwoche). Die Inanspruchnahme der **Einlagefazilität** (Passiva 2.2) belief sich auf 148,3 Mrd EUR (gegenüber 123 Mrd EUR in der Vorwoche).

Die Bestände des Eurosystems an **Wertpapieren für geldpolitische Zwecke** (Aktiva 7.1) stiegen um 11,4 Mrd EUR auf 642,5 Mrd EUR. In der nachstehenden Tabelle werden diese Bestände nach einzelnen Portfolios detailliert aufgeschlüsselt. Alle Portfolios werden in den Büchern zu fortgeführten Anschaffungskosten ausgewiesen.

| Wertpapiere für geldpolitische Zwecke | Ausgewiesener Wert zum 2. Oktober 2015 | Veränderungen zum 25. September 2015 – Käufe | Veränderungen zum 25. September 2015 – Tilgungen | Veränderungen zum 25. September 2015 – Berichtigungen zum Quartalsende |
|--|---|---|---|---|
| 1. Programm zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen | 22,0 Mrd EUR | – | -0,2 Mrd EUR | – |
| 2. Programm zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen | 10,4 Mrd EUR | – | -0,1 Mrd EUR | – |
| 3. Programm zum Ankauf gedeckter | 122,8 Mrd EUR | +3,0 Mrd EUR | -0,1 Mrd EUR | -0,4 Mrd EUR |

| | | | | |
|---|---------------|--------------|--------------|--------------|
| Schuldverschreibungen | | | | |
| Programm zum Ankauf von Asset-Backed Securities | 13,1 Mrd EUR | +0,5 Mrd EUR | -0,1 Mrd EUR | – |
| Programm zum Ankauf von Wertpapieren des öffentlichen Sektors | 346,3 Mrd EUR | +9,7 Mrd EUR | – | -1,3 Mrd EUR |
| Programm für die Wertpapiermärkte | 127,9 Mrd EUR | – | – | +0,3 Mrd EUR |

Einlagen der Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet auf Girokonten

Im Ergebnis aller Transaktionen nahmen die **Einlagen** der Kreditinstitute **auf Girokonten** beim Eurosystem (Passiva 2.1) um 15,8 Mrd EUR auf 473,3 Mrd EUR zu.

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 2015 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: 1 002,365 EUR je Unze Feingold

USD: 1,1203 je EUR

JPY: 134,69 je EUR

Sonderziehungsrechte: 1,2522 EUR je SZR

Konsolidierter Ausweis des Eurosystems - 07/10/2015

| Aktiva (in Millionen EUR) | Stand | Veränderungen zur Vorwoche aufgrund von | |
|--|------------------|---|----------------------------------|
| | | i) Transaktionen | ii) Anpassungen zum Quartalsende |
| Differenzen in den Summen durch Runden der Zahlen. | | | |
| | | i) | ii) |
| 1 Gold und Goldforderungen | 348.849 | 0 | -15.606 |
| 2 Forderungen in Fremdwährung an Ansässige außerhalb des Euro-Währungsgebiets | 287.896 | -1.999 | -1.747 |
| 2.1 Forderungen an den IWF | 78.917 | 73 | -311 |
| 2.2 Guthaben bei Banken, Wertpapieranlagen, Auslandskredite und sonstige Auslandsaktiva | 208.980 | -2.071 | -1.436 |
| 3 Forderungen in Fremdwährung an Ansässige im Euro-Währungsgebiet | 40.993 | 1.216 | -130 |
| 4 Forderungen in Euro an Ansässige außerhalb des Euro-Währungsgebiets | 21.541 | 455 | -44 |
| 4.1 Guthaben bei Banken, Wertpapieranlagen und Kredite | 21.541 | 455 | -44 |
| 4.2 Forderungen aus der Kreditfazilität im Rahmen des WKM II | 0 | 0 | 0 |
| 5 Forderungen in Euro aus geldpolitischen Operationen an Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet | 539.538 | 12.209 | 0 |
| 5.1 Hauptrefinanzierungsgeschäfte | 72.551 | 1.474 | 0 |
| 5.2 Längerfristige Refinanzierungsgeschäfte | 466.348 | 10.121 | 0 |
| 5.3 Feinsteuerungsoperationen in Form von befristeten Transaktionen | 0 | 0 | 0 |
| 5.4 Strukturelle Operationen in Form von befristeten Transaktionen | 0 | 0 | 0 |
| 5.5 Spitzenrefinanzierungsfazilität | 640 | 614 | 0 |
| 5.6 Forderungen aus Margenausgleich | 0 | 0 | 0 |
| 6 Sonstige Forderungen in Euro an Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet | 137.146 | -1.257 | 0 |
| 7 Wertpapiere in Euro von Ansässigen im Euro-Währungsgebiet | 1.001.661 | 11.835 | -167 |
| 7.1 Wertpapiere für geldpolitische Zwecke | 642.538 | 12.787 | -1.361 |
| 7.2 Sonstige Wertpapiere | 359.122 | -952 | 1.194 |
| 8 Forderungen in Euro an öffentliche Haushalte | 25.152 | 0 | -24 |
| 9 Sonstige Aktiva | 224.058 | 1.431 | 32 |
| Aktiva insgesamt | 2.626.835 | 23.891 | -17.687 |

| Passiva (in Millionen EUR) | | Stand | Veränderungen zur Vorwoche | aufgrund von |
|--|---|-----------|----------------------------|----------------------------------|
| | | | i) Transaktionen | ii) Anpassungen zum Quartalsende |
| Differenzen in den Summen durch Runden der Zahlen. | | | | |
| | | | i) | ii) |
| 1 | Banknotenumlauf | 1.054.220 | 2.594 | 0 |
| 2 | Verbindlichkeiten in Euro aus geldpolitischen Operationen gegenüber Kreditinstituten im Euro-Währungsgebiet | 621.763 | 41.177 | 0 |
| | 2.1 Einlagen auf Girokonten (einschließlich Mindestreserveguthaben) | 473.281 | 15.826 | 0 |
| | 2.2 Einlagefazilität | 148.326 | 25.338 | 0 |
| | 2.3 Termineinlagen | 0 | 0 | 0 |
| | 2.4 Feinsteuerungsoperationen in Form von befristeten Transaktionen | 0 | 0 | 0 |
| | 2.5 Verbindlichkeiten aus Margenausgleich | 155 | 13 | 0 |
| 3 | Sonstige Verbindlichkeiten in Euro gegenüber Kreditinstituten im Euro-Währungsgebiet | 5.046 | 172 | 0 |
| 4 | Verbindlichkeiten aus der Begebung von Schuldverschreibungen | 0 | 0 | 0 |
| 5 | Verbindlichkeiten in Euro gegenüber sonstigen Ansässigen im Euro-Währungsgebiet | 167.615 | -26.379 | 0 |
| | 5.1 Einlagen von öffentlichen Haushalten | 88.701 | -26.678 | 0 |
| | 5.2 Sonstige Verbindlichkeiten | 78.914 | 298 | 0 |
| 6 | Verbindlichkeiten in Euro gegenüber Ansässigen außerhalb des Euro-Währungsgebiets | 47.337 | 7.079 | 1 |
| 7 | Verbindlichkeiten in Fremdwährung gegenüber Ansässigen im Euro-Währungsgebiet | 2.022 | 10 | -46 |
| 8 | Verbindlichkeiten in Fremdwährung gegenüber Ansässigen außerhalb des Euro-Währungsgebiets | 4.297 | -936 | -97 |
| | 8.1 Einlagen, Guthaben und sonstige Verbindlichkeiten | 4.297 | -936 | -97 |
| | 8.2 Verbindlichkeiten aus der Kreditfazilität im Rahmen des WKM II | 0 | 0 | 0 |
| 9 | Ausgleichsposten für vom IWF zugeteilte Sonderziehungsrechte | 59.202 | 0 | -254 |
| 10 | Sonstige Passiva | 217.397 | 175 | -603 |
| 11 | Ausgleichsposten aus Neubewertung | 350.735 | 0 | -16.688 |
| 12 | Kapital und Rücklagen | 97.201 | 0 | 0 |
| Passiva insgesamt | | 2.626.835 | 23.891 | -17.687 |