

An alle Banken (MFIs)
und an die Rechenzentralen der
Sparkassen und Kreditgenossenschaften
(sowie an die Bankenverbände und Meldewesen-
Software-Hersteller)

20. Mai 2020

—

Rundschreiben Nr. 37/2020

Bankenstatistik / Kreditdatenstatistik (AnaCredit)

hier: Veröffentlichung der Wertgrenzen für Ausreißerregeln

— Sehr geehrte Damen und Herren,

das Europäische System der Zentralbanken verfolgt das Ziel, die Qualität der AnaCredit-Daten weiter zu verbessern. Anhand der Validierungsregeln wird bereits überprüft, ob die Daten den Anforderungen des Datenmodells entsprechen und dabei sowohl technisch einwandfrei als auch tabellenübergreifend konsistent und vollständig sind. In weiteren Schritten soll die inhaltliche Überprüfung der Daten beginnen.

Als erster Schritt in diese Richtung sind die Regeln anzusehen, die die Daten auf Ausreißer überprüfen. Sie sind bei der letzten Aktualisierung des Validierungshandbuchs mit einer Gültigkeit ab 1. August 2020 aufgenommen worden.

Die Wertgrenzen für diese Ausreißerregeln werden als eigenständige Datei auf der Webseite der Deutschen Bundesbank veröffentlicht.

Die Exceltabelle, die diese Informationen enthält, ist unter folgendem Pfad abrufbar:

<https://www.bundesbank.de/resource/blob/832858/1669c9f05169c00bc4c810130e88c84b/mL/anacredit-handbuch-version-1-0-data.xlsx>

Es ist geplant, dass die zunächst sehr groben Wertgrenzen, die jetzt veröffentlicht wurden, im Zeitablauf verfeinert werden. Es ist davon auszugehen, dass die Anpassung der Wertgrenzen von der Aktualisierung des Validierungshandbuchs entkoppelt sein wird. Auf Änderungen der Wertgrenzen wird mit einem Vorlauf von mindestens einem Vierteljahr hingewiesen werden.

Des Weiteren wurde das Validierungshandbuch in Version 10.1 um einen Validierungscode ergänzt, der mitteilt, dass in den ausgeführten Plausibilisierungsregeln zunächst keine Auffälligkeiten aufgetreten sind (AK0003). Zudem wurde der formale Fehler FL0048_DE, der das Schreiben der Rückmeldung bei zu vielen Fehlern abbricht, erweitert, sodass hier nun sowohl Validierungen als auch Plausibilisierungen berücksichtigt werden.

In einer späteren Phase ist vorgesehen, dass die meldepflichtigen Institute auch die Möglichkeit bekommen sollen, Werte, die als Ausreißer vermutet werden, bestätigen zu können. Hierzu werden wir Sie zu einem späteren Zeitpunkt gesondert informieren, sobald dieses Verfahren zusammen mit der EZB definiert sein wird.

Mit freundlichen Grüßen

Deutsche Bundesbank
Brunken König



Beglaubigt:
N. Bayer
Tarifbeschäftigte