

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

12. Mai 2016

## Rundschreiben Nr. 29/2016

### Bilanzstatistik

hier: Berichtspflichten für Banken (MFIs), die an den gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften (GLRG-II) mit vierjähriger Laufzeit teilnehmen möchten  
Information über technische Umsetzungsfragen des Projekts

Sehr geehrte Damen und Herren,

### 1 Grundsätzliches

am 10. März 2016 hat der EZB-Rat u.a. beschlossen, zur Verbesserung der geldpolitischen Transmission weitere Anreize für die Kreditvergabe der Banken zu setzen und eine weitere Serie von vier gezielten längerfristigen Refinanzierungsgeschäften (**GLRG-II**) durchzuführen, die - beginnend im Juni 2016 - in dreimonatigen Abständen angeboten werden. Der als Rechtsgrundlage dienende EZB-Rats-Beschluss EZB/2016/10 wurde am 28. April 2016 verabschiedet<sup>1</sup>. Jedes GLRG-II-Geschäft wird dabei mit einer vierjährigen Laufzeit sowie einer Option zur freiwilligen Rückzahlung nach zwei Jahren ausgestattet sein. Geschäftspartner können im Rahmen der GLRG-II-Serie insgesamt bis zu 30 % ihres am 31. Januar 2016 ausstehenden Bestands anrechenbarer Kredite aufnehmen, abzüglich noch ausstehender, im Rahmen der ersten beiden GLRG-Geschäfte der ersten GLRG-Serie (**GLRG-1**) im September und Dezember 2014 aufgenommener Kredite. Die Definition der anrechenbaren Kredite im Rahmen der GLRG-II-Serie entspricht der im Rahmen der GLRG-1-Serie verwendeten.

Die Bundesbank wird alle Informationen zu der GLRG-II-Serie  
ter <http://www.bundesbank.de/glrg2> bereitstellen; die Seite wird laufend aktualisiert.

<sup>1</sup> [http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en\\_2016\\_10\\_f\\_sign.pdf](http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en_2016_10_f_sign.pdf)

Um Geschäftspartnern eine Umschichtung ausstehender GLRG-1-Kredite in die neue GLRG-II-Serie zu ermöglichen, hat der EZB-Rat eine zusätzliche freiwillige vorzeitige Rückzahlungsmöglichkeit der GLRG-1-Geschäfte (Nummer 1 bis 7) zum Zeitpunkt der Valutierung des ersten GLRG-II-Geschäfts im Juni 2016 beschlossen. Dazu wurde der den GLRG-1-Geschäften zugrunde liegende Beschluss EZB/2014/34 durch den Beschluss EZB/2016/11<sup>2</sup> vom 28. April 2016 entsprechend modifiziert.

Banken (MFIs), die beabsichtigen an einem der GLRG-II-Geschäfte teilzunehmen, sollten möglichst umgehend prüfen, ob sie die erforderlichen technischen Voraussetzungen (PM-Konto, Sicherheitenkonto, etc.) erfüllen<sup>3</sup>, um über das OffenMarkt Tender Operations-System (OMTOS) der Bundesbank an Offenmarktgeschäften des Eurosystems teilzunehmen.

Banken (MFIs), die nicht an den GLRG-II teilnehmen und dies auch künftig nicht beabsichtigen, sind von dem vorliegenden Rundschreiben nicht betroffen.

## 2 Meldeschema

Eine der GLRG-II-Teilnahmevoraussetzungen ist die regelmäßige Bereitstellung vorgegebener Meldedaten in Form eines Meldeschemas. Bezüglich der definitorischen Abgrenzung der erfragten Daten verweist die EZB<sup>4</sup> wie bereits bei der GLRG-1-Serie auf einzelne bankstatistische Dokumente: primär auf (A) die EZB-Verordnung über die Bilanz des Sektors der monetären Finanzinstitute (**BSI-Verordnung**)<sup>5</sup> und in Fällen, in denen die BSI-Verordnung keine Definition vorsieht, auf (B) das „Manual on MFI balance sheet statistics (**Manual**)“<sup>6</sup>.

Um den GLRG-II-Teilnehmern die Befüllung des GLRG-II-Meldeschemas zu erleichtern<sup>7</sup>, wurde das als **Anlage 1** beigefügte **Meldeschema Y2**<sup>8</sup> entwickelt<sup>9</sup>. Das Meldeschema Y2 behält die

<sup>2</sup> [http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en\\_2016\\_11\\_f\\_sign.pdf](http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en_2016_11_f_sign.pdf)

<sup>3</sup> Ansprechpartner zu Fragen finden Sie auf unserer Internetseite unter [http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Service/Services\\_Banken\\_Unternehmen/OMTOS/omt\\_os\\_ansprechpartner.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Service/Services_Banken_Unternehmen/OMTOS/omt_os_ansprechpartner.pdf?__blob=publicationFile)

<sup>4</sup> Über die „Guidelines for completing the reporting template“ (**GLRG-II-Richtlinien**); siehe Link in Fußnote 10.

<sup>5</sup> EZB/2013/33 (<http://eur-lex.europa.eu/LexUriServ/LexUriServ.do?uri=OJ:L:2013:297:0001:0050:de:PDF>)

<sup>6</sup> <http://www.ecb.europa.eu/pub/pdf/other/manualmfibalancesheetstatistics201204en.pdf>

<sup>7</sup> Und um eine eindeutige Zuordnung der Meldung zu dem jeweiligen GLRG-Geschäft vornehmen zu können (GLRG-1: Y1, GLRG-II: Y2).

<sup>8</sup> Ungeachtet dessen möchten wir klarstellen, dass Y2 kein integraler Bestandteil der bankstatistischen Erhebung BISTA ist.

<sup>9</sup> Das Meldeschema Y2 ist inhaltsgleich zu dem Y1-Meldeschema, das im Rahmen der GLRG-1-Serie verwendet wird.

Grundstruktur des EZB-TLTRO-II-Meldeschemas<sup>10</sup> bei, fragt aber Teilmengen ab, die mit BISTA-Meldedaten übereinstimmen müssen; die anzuwendenden Plausibilitätsprüfungen finden Sie in **Anlage 2**<sup>11 12</sup>. **Die verbleibenden Teilmengen werden im Rahmen der bankstatistischen Erhebungen der Deutschen Bundesbank nicht erfragt und müssen von den GLRG-II-Teilnehmern unter Beachtung der GLRG-II-Richtlinien der EZB bzw. der definitorischen Abgrenzung des Manuals selbst aus ihren hausinternen DV-Systemen berechnet bzw. abgeleitet werden (Eigendaten).**<sup>13</sup> Das Meldeschema Y2 ist vollständig auszufüllen.

### 3 Elektronische Einreichung der GLRG-II-Meldedaten

#### 3.1 Meldungseinreichung über das Meldeportal AMS

Das ExtraNet der Deutschen Bundesbank ist eine leistungsfähige Infrastruktur basierend auf moderner Internet-Technologie, die eine verschlüsselte Übermittlung von Daten ermöglicht. Eine auf dieser Infrastruktur aufsetzende DV-Anwendung der Deutschen Bundesbank, das „**Allgemeine Meldeportal Statistik**“ (**AMS**), bietet die Möglichkeit, Daten online zu erfassen und an die Deutsche Bundesbank zu übermitteln. Eine Kurzanleitung zum GLRG-II-Meldedaten-Erfassungsprozess finden Sie in der Anlage 3 zu diesem Rundschreiben.

Um die GLRG-II-Meldedaten einreichen zu können, benötigen die MitarbeiterInnen der GLRG-II-Teilnehmerbanken die Berechtigungen, (a) Meldedaten zur monatlichen Bilanzstatistik (BISTA)<sup>14</sup> einzureichen und (b) BISTA-Meldedaten online erfassen zu dürfen. Sofern diese beiden Voraussetzungen erfüllt sind, können die **GLRG-II-Meldedaten wie in Anlage 3 beschrieben erfasst werden.**

Um unnötige Verzögerungen zu vermeiden, haben wir allen ExtraNet-Benutzern, die am **3. Mai 2016** berechtigt waren, BISTA-Meldedaten einzureichen<sup>15</sup>, zusätzlich die Berechtigung gegeben, den Meldebogen Y2<sup>16</sup> online erfassen zu dürfen.

<sup>10</sup> [http://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2014/html/TLTRO\\_reporting\\_template.xls](http://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2014/html/TLTRO_reporting_template.xls)

<sup>11</sup> Die Befüllung der Zeile 130 bzw. 430 ist **optional**. Falls ein Ausweis erfolgt, ist die Nutzung der in Anlage 2 aufgeführten Plausibilitätsprüfungen nur noch sehr eingeschränkt möglich.

<sup>12</sup> Die Plausibilitätsprüfungen sind identisch mit denen der GLRG-1-Serie.

<sup>13</sup> Die Schließung der definitorischen Lücken durch die Deutsche Bundesbank würde gegen den Grundsatz der Sicherstellung gleicher Wettbewerbsbedingungen (level-playing field) für alle GLRG-II-Teilnehmer im Euroraum verstoßen, da nicht ausgeschlossen werden kann, dass in anderen Euroraumländer abweichende definitorische Abgrenzungen gelten.

<sup>14</sup> Diese Berechtigung wird benötigt, damit die Bundesbank Rückfragen zu eingereichten GLRG-II-Meldedaten auf einem verschlüsselten Weg an die GLRG-II-Teilnehmerbanken adressieren kann.

<sup>15</sup> ExtraNet Fachverfahren „Bankenstatistisches Meldewesen“, Funktion „03. Einreichung der monatlichen Bilanzstatistik“)

<sup>16</sup> Bislang sind nur die Meldeschemata Y1 und Y2 aber keine originären BISTA-Meldeschemata zur Online-Erfassung freigegeben.

**Alle anderen MitarbeiterInnen von Banken (MFIs), die bislang keine ExtraNet-Berechtigung zur Einreichung der BISTA haben, die aber künftig Y2-Meldungen erfassen können sollen, müssen sich schnellstmöglich erst- bzw. folgeregistrieren<sup>17 18</sup>.** Es ist zu beachten, dass der postalische Versand des Initial-Passwortes bei einer ExtraNet-Erstregistrierung an den (die) beantragende(n) Meldewesen-Mitarbeiter(in) an die Zentrale der jeweiligen Bank erfolgt und von dort aus im Rahmen der hausinternen Postverteilung weitergeleitet wird. Erfahrungsgemäß kann dies einige Tage in Anspruch nehmen.

Das **Meldeschema Y2** wird **spätestens am 23. Mai 2016** im Meldeportal **AMS zur Verfügung stehen**.

### **3.2 Besonderheiten für GLRG-II-Bietergruppen mit deutschen GLRG-II-Leitinstituten**

Das Meldeschema Y2 ist in disaggregierter Form einzureichen, d. h. für jedes Gruppenmitglied einschließlich des Leitinstituts ist ein separater Meldebogen auszufüllen. Auch für ausländische GLRG-Gruppenmitglieder<sup>19</sup> einer deutschen Bietergruppe ist ein separates Meldeschema Y2 einzureichen; dieses wird die Deutsche Bundesbank mit Bilanzstatistik-Daten abgleichen, die ihr von der im Euroraum zuständigen Zentralbank für Plausibilisierungszwecke zur Verfügung gestellt werden.<sup>20</sup> Das Leitinstitut einer GLRG-II-Gruppe reicht zusätzlich ein Y2-Meldeschema mit den aggregierten Daten der GLRG-II-Gruppe ein.

Die vom GLRG-II-Leitinstitut abzugebende Y2-Gruppenmeldung und die Y2-Einzelmeldungen der ausländischen GLRG-II-Gruppenmitglieder sind in AMS (siehe Anlage 3) unter dem Arbeitsgebiet „AUSFI“ einzureichen.

Bitte beachten Sie, dass die in Gliederungspunkt 3.1 beschriebene automatisierte Freischaltung zur Erfassung des Y2-Meldeschemas nicht für das Arbeitsgebiet „AUSFI“ vorgenommen wurde. Wir bitten die GLRG-II-Leitinstitute zu prüfen, ob entsprechende ExtraNet-Zugangsrechte erforderlich sind und gegebenenfalls eine entsprechende Erst- bzw. Folgeregistrierung vorzunehmen.

<sup>17</sup> Erstregistrierung: <https://extranet.bundesbank.de/bsvpub/>; Fachverfahren „Bankenstatistisches Meldewesen“ (nicht Fachverfahren „Allgemeines Meldeportal Statistik“ auswählen!), auszuwählende Funktionen „03. Einreichung der monatlichen Bilanzstatistik“ und „17. Online-Erfassung der monatlichen Bilanzstatistik“

<sup>18</sup> Falls bereits eine ExtraNet-Registrierung für ein anderes Fachverfahren (z. B. „Bankenaufsichtliches Meldewesen“) besteht, kann auch eine Folgeregistrierung erfolgen; siehe Fußnote 17 (<https://extranet.bundesbank.de/bsvpriv/>).

<sup>19</sup> Als solche gelten auch die institutseigenen rechtlich unselbständigen Zweigstellen im EWU-Ausland mit MFI-Status, die als geldpolitischer Geschäftspartner zugelassen sind.

<sup>20</sup> Da einzelne Notenbanken im Euroraum in letzter Zeit die MFI-Codes in ihrem Zuständigkeitsbereich überarbeitet haben, bitten wir Sie, die Aktualität der von Ihnen verwendeten Codes zu überprüfen; siehe [http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/daily\\_list.en.html](http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/daily_list.en.html); "The euro area population of MFIs per category", "Credit institutions". Die von der Bundesbank vergebenen MFI-Codes bestehen unverändert fort.

Banken (MFIs), die im Rahmen der GLRG-1-Serie Teil einer GLRG-1-Gruppe waren, können an den GLRG-II-Geschäften entweder wieder als Gruppenteilnehmer (ggf. mit geänderter Gruppenzusammensetzung) oder als Einzelbieter teilnehmen.

Bitte beachten Sie, dass sich Leitinstitute deutscher GLRG-II-Gruppen für eine Teilnahme am ersten Geschäft der GLRG-II-Serie bis spätestens 19. Mai 2016, 15:30 bei der Bundesbank registrieren lassen müssen<sup>21</sup>.

### 3.3 Dritteinreichungen

Banken (MFIs) können auch im AMS Meldedaten für Dritte einreichen. Eine telefonische Hilfeleistung bei der Einrichtung erhalten Sie unter den Telefon-Nummern 069/9566-2350 bzw. -2351 bzw. -2353. Bitte prüfen Sie in diesem Zusammenhang, ob die Institute, für die Meldungen abgegeben werden sollen, bereits eine „Zurechnungserklärung zur elektronischen Einreichung (bank)statistischer Meldungen über das ExtraNet der Deutschen Bundesbank“<sup>22</sup> abgegeben haben.

### 3.4 Verwendete Internet-Browser

Im Rahmen der Dateneinreichungsphase der Geschäfte der GLRG-1-Serie traten im AMS (siehe Gliederungspunkt 3.1) vereinzelt Probleme bei der Bearbeitung und Versendung der erstellten Meldungen auf. Beachten Sie hierzu folgende Hinweise:

- Bei Verwendung älterer Browser-Versionen traten gelegentlich Probleme bei der Erstellung bzw. Versendung von Meldungen auf. In diesen Fällen empfehlen wir, entweder eine aktuelle Version oder alternative Browser zu verwenden.
- Die JavaScript-Funktion des Browsers muss aktiviert sein.
- Bei Verwendung des Internet Explorers traten gelegentlich Probleme bei der Anzeige des Meldeschemas auf, wenn der Zoommodus<sup>23</sup> einen zu hohen Wert hatte; wir empfehlen die Einstellung von 100 %.

## 4 Meldezeiträume für alle vier Geschäfte der GLRG-II-Serie

Das GLRG-II sieht die Einreichung von zwei Meldeschemata Y2 vor.

<sup>21</sup> [http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Standardartikel/Aufgaben/Geldpolitik/glrg\\_2\\_teilnahme.html](http://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Standardartikel/Aufgaben/Geldpolitik/glrg_2_teilnahme.html)

<sup>22</sup> [https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Service/Meldewesen/Bankenstatistik/XML/zurechnungserklaerung.pdf?\\_\\_blob=publicationFile](https://www.bundesbank.de/Redaktion/DE/Downloads/Service/Meldewesen/Bankenstatistik/XML/zurechnungserklaerung.pdf?__blob=publicationFile)

<sup>23</sup> Beim Internet Explorer 8: Ansicht > Zoom > 100 %

- **1. Februar 2015 (mit Ultimo-Stand 31.01.2015) bis 31. Januar 2016  
(Erstes Meldeschema)**  
(technische Anmerkungen zur Befüllung des Y2-Meldeschemas: „Stand Ende“ ⇨ „1.2016“; Kennziffer 906 = „12“)
- **1. Februar 2016 (mit Ultimo-Stand 31.01.2016) bis 31. Januar 2018  
(Zweites Meldeschema)**  
(technische Anmerkungen zur Befüllung des Y2-Meldeschemas: „Stand Ende“ ⇨ „1.2018“; Kennziffer 906 = „24“)

Eine Bank (MFI) hat das Erste Meldeschema Y2 nur bei erstmaliger Teilnahme an einem der vier GLRG-II-Geschäfte einzureichen. Sollten Änderungen an bereits eingereichten Y2-Melddaten bzw. den zugrunde liegenden BISTA-Daten vorgenommen werden, so ist Kontakt mit **statistik-glr@bundesbank.de** aufzunehmen, um abzuklären, ob die davon betroffene Y2-Meldung erneut einzureichen ist (beispielsweise könnte es im Lauf des Jahres 2016 oder 2017 erforderlich werden, dass Melddaten zurück bis zum Beginn des Meldezeitraums des Ersten Meldeschemas revidiert werden müssen).

Es ist unerheblich, ob eine Bank (MFI) an den Geschäften der GLRG-II-Serie erstmals am ersten, zweiten, dritten oder vierten Geschäft teilnimmt. Bei Teilnahme an einem der Geschäfte sind die Meldezeiträume des Ersten und Zweiten Meldeschemas voll abzudecken. Die jeweiligen Dateneinreichungsfristen können dem „Unverbindlichen Zeitplan für die zweite Serie der GLRG-II“ entnommen werden.<sup>24</sup>

## **5 Anmerkungen zur Einreichung von Y2-Melddaten im Rahmen des ersten GLRG-II-Geschäfts**

### **5.1 Einreichungsfrist**

**Um ein Bietungslimit für das erste GLRG-II-Geschäft im Juni 2016 zu erhalten, ist ein vollständig ausgefülltes Meldeschema Y2 bis spätestens 2. Juni 2016, 15:30 Uhr einzureichen.** Wir empfehlen eine frühzeitige Datenübermittlung an die Deutsche Bundesbank. Bei auftretenden (technischen) Problemen im Rahmen der Dateneinreichung wenden Sie sich bitte vor Ablauf der Einreichungsfrist an die E-Mail-Adresse **extranet-s100@bundesbank.de** bzw. die Fax-Nummer [+49] 69 / 9566-50-9843.

Bitte beachten Sie, dass eine **verspätete Einreichung des Meldeschemas nicht möglich** ist. Eine Teilnahme ist dann erst wieder zum zweiten Geschäft der GLRG-II-Serie möglich.

<sup>24</sup> <http://www.bundesbank.de/grlg2> > GLRG-II-Kalender

## **5.2 Meldeverpflichtungen in Abhängigkeit von der Teilnahme einer Bank (MFI) an dem GLRG-1-Programm und/oder an dem GLRG-II-Programm**

Beachten Sie in diesem Zusammenhang bitte auch das taggleich erschienene Rundschreiben Nr. 30/2016 zu Berichtspflichten zu den GLRG-1-Geschäften.

### **5.2.1 Banken (MFIs), die bereits an einem der ersten sieben Geschäfte der GLRG-1-Serie teilgenommen haben, diese Gelder im Rahmen der zusätzlichen vorzeitigen Rückzahlungsoption im Juni 2016 vollständig zurückzahlen werden und nicht an dem 8. und damit letzten GLRG-1-Geschäft teilnehmen werden**

#### *5.2.1.1 Allgemein*

Banken (MFIs), die bereits an einem der ersten sieben Geschäfte der GLRG-1-Serie teilgenommen haben, diese Gelder im Rahmen der zusätzlichen vorzeitigen Rückzahlungsoption im Juni 2016 vollständig zurückzahlen werden und nicht an dem 8. und damit letzten GLRG-1-Geschäft teilnehmen werden, müssen keine Meldungen für den GLRG-1-Meldezeitraum 2016/02 bis 2016/04 mehr abgeben. Falls sich abzeichnet, dass eine Bank die vorgenannte Rückzahlungsentscheidung nicht bis zu dem in Gliederungspunkt 5.1 genannten Einreichungstermin getroffen haben wird, so empfehlen wir, die vorgenannte Y1-Meldung sicherheitshalber abzugeben.

#### *5.2.1.2 Banken (MFI), die nach vollständiger Rückzahlung aller GLRG-1-Geschäfte an einem der Geschäfte der GLRG-II-Serie teilnehmen*

Banken (MFIs), die **bereits im Rahmen der GLRG-1-Serie Y1-Melddaten für die vier Zeiträume**, die den in Gliederungspunkt 4 genannten Meldezeitraum des Ersten Meldeschemas Y2 beinhalten, eingereicht haben, **müssen Y2-Melddaten für den entsprechenden Meldezeitraum nicht nochmals einreichen**<sup>25</sup>. Sollten Sie mit der entsprechenden **Datenübernahme als Substitut für die Einreichung des Ersten Meldeschemas der GLRG-II-Serie nicht einverstanden sein**, so bitten wir Sie, dies **formlos bis zum 20. Mai 2016** per E-Mail an **statistik-glr@bundesbank.de** anzuzeigen; bitte tragen Sie in der Betreffzeile ihren MFI-Code und das Schlagwort „Datenübernahme Y2“ ein.

<sup>25</sup> Dies gilt nicht, wenn der Datenstand der vier Y1-Meldungen, die Y2-relevante Meldezeiträume betreffen, nicht mehr aktuell ist. In diesem Fall sind die betroffenen GLRG-1-Teilmeldungen (Y1) zu korrigieren.

### **5.2.2 Banken (MFIs), die bereits an einem Geschäft des GLRG-1-Programms teilgenommen haben, die Gelder aus den GLRG-1-Geschäften 1 bis 7 im Rahmen des Sonderrückzahlungsrechts nicht vollständig zurückzahlen werden bzw. die an dem 8. und letzten Geschäft der GLRG-1-Serie teilnehmen werden**

Die betroffenen Banken (MFIs) müssen eine Meldung für den GLRG-1-Meldezeitraum 2016/02 bis 2016/04 abgeben. Die Daten sind ebenfalls spätestens am 2. Juni 2016, 15:30 Uhr einzureichen.

## **6 Validierung der eingereichten Meldedaten und Auswirkungen auf das zugewiesene Bietungslimit**

Am 2. Juni 2016, 15:30 Uhr enden Einreichungsfristen sowohl für Meldungen zu Geschäften der GLRG-1-Serie als auch des ersten Geschäfts der GLRG-II-Serie. Die Regularien beider Geschäfte sehen vor, dass die Bundesbank allen Daten einreichenden Banken (MFIs) bis spätestens 16. Juni 2016, 15:30 Uhr Bietungslimite für das achte Geschäft der GLRG-1-Serie bzw. das erste Geschäft der GLRG-II-Serie mitteilt.

Abhängig davon, in welchem Umfang

- (a) das zusätzliche freiwillige vorzeitige Rückzahlungsrecht von GLRG-1-Teilnehmern in Anspruch genommen wird,
- (b) zur Teilnahme am achten und letzten Geschäft der GLRG-1-Serie und
- (c) zur Teilnahme am ersten Geschäft der GLRG-II-Geschäfte

Meldedaten eingereicht werden, kann die Plausibilisierung der Y1 bzw. Y2-Meldungen<sup>26</sup> gegebenenfalls nicht vollständig abgeschlossen werden. In diesen Fällen ist nicht auszuschließen, dass die Bietungslimite, die den Daten einreichenden Banken (MFIs) mitgeteilt werden, im Nachgang (auf Basis zu korrigierender Y1 bzw. Y2-Meldungen) revidiert werden müssen, worüber wir die betroffenen Banken (MFIs) mit gesondertem Schreiben informieren würden.

## **7 Anmerkungen zur Befüllung des Meldeschemas Y2**

### **7.1 Allgemeine Anmerkungen**

Nachfolgend finden Sie einige Erläuterungen zur Befüllung des Meldeschemas Y2:

- Abweichend vom Meldeschema Y1 der GLRG-1-Serie enthält das Meldeschema Y2 die zusätzliche **Kennziffer 904 („Nummer der GLRG-Serie“)**. Im Rahmen der vier Geschäfte der GLRG-II-Serie ist hier immer eine „2“ erforderlich.

<sup>26</sup> Y1 = GLRG-1; Y2 = GRLG-2



- Hinweise zu Besonderheiten der eingereichten Meldedaten (z.B. bei Befüllung der Anwahlpositionen Y2.325/01 bzw. Y2.325/02) teilen Sie uns bitte im Freitextfeld „Kennziffer 903“ in den Header-Informationen des Y2-Meldeschemas mit.
- Das Meldeschema Y2 ist **vollständig auszufüllen**; dies gilt insbesondere für die Zeilen 210, 220 und 200. Es gelten die Formalprüfungen der Anlage 2. Die elektronische Übermittlung der in der AMS-Erfassungsmaske Y2 eingetragenen Daten ist erst dann möglich, wenn alle Y2-internen Formalprüfungen erfüllt sind.
- Für die meisten Banken (MFIs) dürfte es zweckmäßig sein, die Befüllung des Meldeschemas Y2 durch Umformung der in Anlage 2 genannten **Gleichungs-Nummern 19 bzw. 21** vorzunehmen. Nach **Umformung des Terms** ergibt sich  $Y2.200/0x = Y2.400/0x - Y2.100/0x - Y2.300/0x$ . Die nun auf der rechten Seite der Gleichung stehenden Zeilen-Nummern dürften von vielen – insbesondere kleineren – Banken (MFIs) vollständig aufgrund von BISTA-Daten befüllt werden können. Zur Befüllung der Zeile 200, aber auch der zugehörigen Zeilen 210 und 220, verweisen wir insbesondere auf Anlage II, 4. Definitions (Definitionen), b) „Eligible net lending (Anrechenbare Nettokreditvergabe)“ des Beschlusses EZB/2016/10)<sup>27</sup>.
- Das Meldeschema Y2 enthält die Kennziffern 901, 902, 903, 904, 905 und 906. In einigen Formalprüfungen der Anlage 2 wird, nach dem **Zusatz: „gilt für folgende Kennzifferausprägungen:“**, ebenfalls auf – teilweise gleichlautende – Kennziffern verwiesen. Bitte beachten Sie, dass sich die Kennziffern in diesen Fällen nicht auf das Meldeschema Y2, sondern auf das **im jeweiligen Fall betroffene BISTA-Meldeschema beziehen**. Dies soll an einem Beispiel verdeutlicht werden: Die Gleichungs-Nummer 27, Spalte „rechte Seite“ enthält die Beschreibung „P1.114/04 + P1.114/05 + P1.414/04 + P1.414/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = alle; 906 = alle“; die genannten Kennziffern 904, 905 und 906 beziehen sich auf das BISTA-Meldeschema P1 und nicht auf das Meldeschema Y2.
- In den Abschnitten mit den Zwischensummen in den Zeilen 200 und 300 sind kumulierte Werte über die gesamte Berichtsperiode (vgl. Y2-Kennziffer 906) einzutragen; z.B. „Summe der Bewertungskorrekturen über die Anzahl der Monate“ für die Anwahlpositionen Y2.322/01 und Y2.322/02. In den Abschnitten mit den Zwischensummen in den Zeilen 100 und 400 sind Stände zum Beginn (Ultimo vor Beginn der Berichtsperiode) bzw. zum Ende der Berichtsperiode zu melden. Die jeweiligen Zwischensummen werden nicht automatisch ermittelt, sondern sind einzutragen.
- Bestandsveränderungen von Fremdwährungskrediten, die sich aufgrund von Wechselkurschwankungen ergeben, sind als „sonstige Anpassungen“ in den Anwahlpositionen Y2 321 01 bzw. Y2 321 02 zu berücksichtigen. Diese sind mindestens dann zu berücksichtigen, wenn in

<sup>27</sup> [http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en\\_2016\\_10\\_f\\_sign.pdf](http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en_2016_10_f_sign.pdf)

den Meldungen zum Auslandsstatus der Banken (MFIs)<sup>28</sup> Angaben gemacht werden. Bitte beachten Sie, dass für die Anwahlpositionen Y2.321/01 bzw. Y2.321/02 (ebenso wenig wie für alle anderen Anwahlpositionen) keine untere Meldeschwelle (Mindestwechselkursschwankung) existiert und folglich auch geringfügige Änderungen zu melden sind. Ggf. kann die Nichtbefüllung der Anwahlpositionen zu Rückfragen durch die Bundesbank führen.

- Die Zeilen 130 und 430 haben einen optionalen Charakter. Werden dort Werte eingetragen, können die in Anlage 2 vorgegebenen Formalprüfungen nur sehr eingeschränkt genutzt werden. In diesen Fällen muss die Datenqualität anhand der bei der jeweiligen Bank (MFI) hausintern verfügbaren Daten sichergestellt werden (siehe auch Gliederungspunkt 9).

## 7.2 Anmerkungen zu Auswirkungen von Fusionen auf einzureichende Y2-Melddaten

Eine Bank (MFI), die aus der Verschmelzung mehrerer Banken (MFIs) – von denen mindestens eine an den GLRG-II-Geschäften teilnimmt – hervorgegangen ist, hat erstmals in der Berichtsperiode, in der das Institut **rechtlich** verschmolzen wird, Y2-Meldeschemata (immer sowohl für das Erste als auch das Zweite Meldeschema; siehe auch Gliederungspunkt 4) nachzureichen.

Bitte beachten Sie, dass, sofern die rechtliche Fusion bereits im Meldezeitraum 01.2015 bis 01.2016 (Erstes Meldeschema) vollzogen wurde und die technische Fusion erst noch ansteht, ebenfalls bereits bei der erstmaligen Einreichung eine „fusionierte“ Y2-Meldung abzugeben ist.

In **beiden** Fällen bitten wir um möglichst frühzeitige Kontaktaufnahme via E-Mail an **statistik-glr@bundesbank.de**. Die E-Mail ist in der Betreffzeile mit „Y2 – MFI-Codes der betroffenen Bank – Fusion“<sup>29</sup> zu kennzeichnen.

<sup>28</sup> Relevant sind die folgenden Anwahlpositionen der Anlage FW:

- FW516 - Buchforderungen bis 1 Jahr einschl. an inländische sonstige Unternehmen
  - FW517 - Buchforderungen von über 1 bis 5 Jahre einschl. an inländische sonstige Unternehmen
  - FW518 - Buchforderungen von über 5 Jahren an inländische sonstige Unternehmen
  - FW519 - Buchforderungen bis 1 Jahr einschl. an inländische Privatpersonen
  - FW521 - Buchforderungen von über 1 bis 5 Jahre einschl. an inländische Privatpersonen
  - FW523 - Buchforderungen von über 5 Jahren an inländische Privatpersonen
  - FW506 - Buchforderungen an inländische Organisationen ohne Erwerbszweck abzüglich der folgenden Positionen
  - FW520 - Buchforderungen bis 1 Jahr einschl. an inländische Privatpersonen für den Wohnungsbau
  - FW522 - Buchforderungen von über 1 bis 5 Jahre einschl. an inländische Privatpersonen für den Wohnungsbau
  - FW524 - Buchforderungen von über 5 Jahren an inländische Privatpersonen für den Wohnungsbau
- Sowie Teilangaben gegenüber dem EWU-Ausland der Anwahlpositionen aus der Anlage R11 (jedoch ohne Kredite für den Wohnungsbau und nur Kredite in Fremdwährung):
- 109 - täglich fällige und befristete Forderungen bis zu 1 Jahr einschl. an ausländische sonstige Unternehmen
  - 110 - befristete Forderungen von mehr als 1 Jahr an ausländische sonstige Unternehmen
  - 111 - täglich fällige und befristete Forderungen bis zu 1 Jahr einschl. an ausländische Privatperson
  - 112 - befristete Forderungen von mehr als 1 Jahr an ausländische Privatpersonen
  - 113 - täglich fällige und befristete Forderungen bis zu 1 Jahr einschl. an ausländische Organisation ohne Erwerbszweck
  - 114 - befristete Forderungen von mehr als 1 Jahr an ausländische Organisationen ohne Erwerbszweck

<sup>29</sup> Beispiel: „Y2 – DE09998 / DE09999 – Fusion“

## 8 Ausweisposition der Geschäfte in der BISTA

- Ausweis der GLRG-II-Geschäfte in der monatlichen Bilanzstatistik der Banken (MFIs): Banken (MFIs), die an den GLRG-II teilnehmen, weisen diese Geschäfte in der Anlage A2, Zeile 114 der monatlichen Bilanzstatistik (BISTA) aus. Bitte beachten Sie, dass Gelder, die den Instituten bei Teilnahme an dem anstehenden ersten GLRG-II (Zuteilung Valuta 29.06.2016), zugeteilt werden, in der BISTA-Anwahlposition A2.114/04 zu zeigen sein werden.

## 9 Externe Prüfung der gemeldeten GLRG-II-Melddaten

Auch für die im Rahmen der GLRG-II-Serie gemeldeten Daten haben Banken der Bundesbank von externen Wirtschaftsprüfern erstellte Einschätzungen vorzulegen<sup>30</sup>. Hierzu werden wir zu einem späteren Zeitpunkt in einem weiteren bankstatistischen Rundschreiben gesondert Stellung nehmen.

Allerdings möchten wir bereits zum jetzigen Zeitpunkt darauf hinweisen, dass die Bundesbank auch im Rahmen der GLRG-II-Serie die Möglichkeit haben wird, „Sonderprüfaufträge“ an den von der Bank (MFI) beauftragten Wirtschaftsprüfer zu richten. Aufgrund der im Rahmen der GLRG-1-Geschäfte gemachten Erfahrungen werden wir von dieser Option auf jeden Fall dann Gebrauch machen, wenn die Y2-Anwahlpositionen zu „Bestand der gebildeten Einzelwertberichtigungen (optional)“ (Y2.130/01, Y2.130/02, Y2.430/01, Y2.430/02) befüllt werden; hierzu siehe auch Gliederungspunkt 7.1.

- Anlage 1: Y2-Meldeschema  
Anlage 2: Formalprüfungen für die Meldungen zu den GLRG-II einschl. des Abgleichs zur monatlichen Bilanzstatistik (BISTA)  
Anlage 3: Kurzanleitung zur Erfassung des GLRG-II-Meldebogens Y2 im Allgemeinen Meldeportal Statistik (AMS)

Mit freundlichen Grüßen

Deutsche Bundesbank  
Brunken Conrad



Beglaubigt:  
*S. Reipi*  
Tarifbeschäftigte

<sup>30</sup> Siehe hierzu auch Artikel 7(5) des Beschlusses EZB/2016/10  
[http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en\\_2016\\_10\\_f\\_sign.pdf](http://www.ecb.europa.eu/ecb/legal/pdf/en_2016_10_f_sign.pdf)

# Anlage 1 zum Bundesbank Rundschreiben

Stand Ende (letzter erfasster Berichtsmonat) \_\_\_\_\_

Anlage Y2

- Blatt 1 -

## Gezielte längerfristige Refinanzierungsgeschäfte (GLRG-II)

### Buchforderungen und Wechselkredite an nichtfinanzielle (sonstige) Unternehmen und Privatpersonen (ohne Kredite für den Wohnungsbau; einschließlich Organisationen ohne Erwerbszweck)

Anmerkung:  
Nur für die mit "x" gekennzeichneten Anwahlpositionen kann die Deutsche Bundesbank Berechnungsvorgaben machen. Alle anderen Angaben müssen aus den hausinternen DV-Systemen der GLRG-II-Teilnehmer berechnet werden.

Das Meldeschema ist nur von Banken (MFIs) abzugeben, die direkt oder indirekt (über eine GLRG-II-Gruppe) an den GLRG-II-Geschäften teilnehmen. Bei GLRG-II-Gruppen angehörigen Mitgliedern, die ihren Sitz im EWU-Ausland haben, ist nur die Befüllung der Meldepositionen des originären EZB-Meldeschemas (siehe Fußnote 3) verpflichtend. GLRG-II-Leitinststitute melden sowohl ihren disaggregierten Anteil als auch eine aggregierte Meldung für die GLRG-II-Gruppe.

901	MFI-Identifikator des GLRG-II-Teilnehmers <sup>1)</sup>	
905	Teilnahme an den GLRG-II-Geschäften erfolgt im Rahmen einer "GLRG-II-Gruppe" <sup>2)</sup>	
902	MFI-Identifikator <sup>1)</sup> des bietungsberechtigten Leitinsttituts (nur anzugeben, wenn Kennziffer 905 <> 5)	
906	Anzahl der Berichtsmonate, auf die sich die Meldung bezieht (Februar 2015 bis Januar 2016 = 12; Februar 2016 bis Januar 2018 = 24)	
904	Nummer der GLRG-Serie (z.B. Alle vier Geschäfte der GLRG-II-Serie = 2)	2

Banknummer  Prüfziffer

<input type="text"/>	<input type="text"/>
----------------------	----------------------

Name

Ort

- Beträge in Tsd Euro -

Schuldner mit Sitz im Inland und in anderen Mitgliedsländern der Europäischen Währungsunion (EWU)			nichtfinanzielle (sonstige) Unternehmen alle Laufzeiten insgesamt	Privatpersonen (einschließlich Organisationen ohne Erwerbszweck) ohne Kredite für den Wohnungsbau; alle Laufzeiten insgesamt
			01	02
<b>Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode</b>	Verweis auf...			
Buchforderungen und Wechselkredite	EZB <sup>3)</sup> : 1,1	110	x	x
Bestände aus "traditionellen Verbriefungstransaktionen" aus eigenen Forderungsverkäufen (als Originator) <u>ohne</u> Bilanzabgang	EZB: Teil von 1,2	121	x	x
Bestände aus eigenen Forderungsverkäufen (ohne Verbriefungen) <u>ohne</u> Bilanzabgang	EZB: Teil von 1,2	122	x	x
Bestände an verbrieften und sonstigen Forderungsverkäufen <u>ohne</u> Bilanzabgang (121+122)	EZB: 1,2	120	x	x
Bestand der gebildeten Einzelwertberichtigungen (optional) <sup>4)</sup>	EZB: 1,3	130		
<b>Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode (110-120+130)</b>	EZB: 1	100	x	x
<b>Nettokreditvergabe im Berichtszeitraum</b>				
Bruttokreditvergabe	EZB: 2,1	210		
Tilgungen	EZB: 2,2	220		
<b>Nettokreditvergabe im Berichtszeitraum (210-220)</b>	EZB: 2	200	x	x
<b>Daten-Anpassungsmaßnahmen (bzw. -bereinigungsmaßnahmen) im Berichtszeitraum, die nicht auf eine Nettokreditvergabe zurückzuführen sind<sup>5) 6)</sup></b>				
<b>Kreditverbriefungen und sonstige Kreditübertragungen im Berichtszeitraum (Kreditkäufe minus Kreditverkäufe)</b>				
Saldo der im Berichtszeitraum abgewickelten Verbriefungen <u>mit</u> Auswirkungen auf die Bilanz	EZB: 3,1A	311	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum <u>mit MFIs</u> mit Sitz im Inland oder in anderen Mitgliedsländern der Europäischen Währungsunion (EWU) abgewickelten Kreditübertragungen (Kreditkäufe minus -verkäufe) <u>mit</u> Auswirkungen auf die Bilanz, die keine Verbriefungstransaktionen betreffen	EZB Teil von 3,1B	312	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum <u>mit Geschäftspartnern ohne MFI-Status</u> abgewickelten Kreditübertragungen (Kreditkäufe minus -verkäufe) <u>mit</u> Auswirkungen auf die Bilanz, die keine Verbriefungstransaktionen betreffen	EZB: Teil von 3,1B	313	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum abgewickelten Kreditübertragungen (Kreditkäufe minus -verkäufe) <u>mit</u> Auswirkungen auf die Bilanz, die keine Verbriefungstransaktionen betreffen (312+313)	EZB: 3,1B	314	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum <u>mit MFIs</u> mit Sitz im Inland oder in anderen Mitgliedsländern der EWU abgewickelten Kreditübertragungen (Kreditkäufe minus -verkäufe) (ohne Verbriefungen); <u>ohne</u> Auswirkungen auf die Bilanz	EZB: Teil von 3,1C	315	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum <u>mit Geschäftspartnern ohne MFI-Status</u> abgewickelten Kreditübertragungen (Kreditkäufe minus -verkäufe) <u>ohne</u> Auswirkungen auf die Bilanz; Verbriefungen und sonstige Kreditübertragungen	EZB: Teil von 3,1C	316	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum abgewickelten Kreditübertragungen (Kreditkäufe minus -verkäufe) <u>ohne</u> Auswirkungen auf die Bilanz, unabhängig davon, ob sie Verbriefungstransaktionen betreffen (315+316)	EZB: 3,1C	317	x	x
<b>Kreditverbriefungen und sonstige Kreditübertragungen im Berichtszeitraum (Kreditkäufe minus -verkäufe) (311+314+317)</b>	EZB: 3,1	310	x	x

Weiter auf Anlage Y2 - Blatt 2 -

# Anlage 1 zum Bundesbank Rundschreiben

Stand Ende (letzter erfasster Berichtsmonat) \_\_\_\_\_

Anlage Y2  
- Blatt 2 -

## Gezielte längerfristige Refinanzierungsgeschäfte (GLRG-II)

## Buchforderungen und Wechselkredite an nichtfinanzielle (sonstige) Unternehmen und Privatpersonen (ohne Kredite für den Wohnungsbau; einschließlich Organisationen ohne Erwerbszweck)

Anmerkung:  
Nur für die mit "x" gekennzeichneten Anwahlpositionen kann die Deutsche Bundesbank Berechnungsvorgaben machen. Alle anderen Angaben müssen aus den hausinternen DV-Systemen der GLRG-Teilnehmer berechnet werden.

Das Meldeschema ist nur von Banken (MFIs) abzugeben, die direkt oder indirekt (über eine GLRG-II-Gruppe) an den GLRG-II-Geschäften teilnehmen. Bei GLRG-II-Gruppen angehörigen Mitgliedern, die ihren Sitz im EWU-Ausland haben, ist nur die Befüllung der Meldepositionen des originären EZB-Meldeschemas (siehe Fußnote 3) verpflichtend. GLRG-II-Leitinststitute melden sowohl ihren disaggregierten Anteil als auch eine aggregierte Meldung für die GLRG-II-Gruppe.

901	MFI-Identifikator des GLRG-II-Teilnehmers <sup>1)</sup>	
905	Teilnahme an den GLRG-II-Geschäften erfolgt im Rahmen einer "GLRG-II-Gruppe" <sup>2)</sup>	
902	MFI-Identifikator <sup>1)</sup> des bietungsberechtigten Leitinststituts (nur anzugeben, wenn Kennziffer 905 <> 5)	
906	Anzahl der Berichtsmonate, auf die sich die Meldung bezieht (Februar 2015 bis Januar 2016 = 12; Februar 2016 bis Januar 2018 = 24)	
904	Nummer der GLRG-Serie (z.B. Alle vier Geschäfte der GLRG-II-Serie = 2)	2

Banknummer  Prüzfiffer

<input type="text"/>	<input type="text"/>
----------------------	----------------------

Name

Ort

Fortsetzung von Anlage Y2 - Blatt 1 -

- Beträge in Tsd Euro -

<b>Sonstige Anpassungen (other adjustments)</b>				
Saldo der im Berichtszeitraum vorgenommenen Anpassungen aufgrund von Wechselkursveränderungen	EZB: 3,2A	321		
Saldo der im Berichtszeitraum vorgenommenen Anpassungen aufgrund von Abschreibungen / Wertberichtigungen auf Buchforderungen und Wechselkredite (vgl. Zeilen 110 bzw. 410)	EZB: Teil von 3,2B	322	x	x
darunter: Saldo der im Berichtszeitraum vorgenommenen Anpassungen aufgrund von Abschreibungen / Wertberichtigungen auf Bestände aus "traditionellen Verbriefungstransaktionen" aus eigenen Forderungsverkäufen (als Originator) und sonstigen Kreditübertragungen <u>ohne</u> Bilanzabgang (vgl. Zeilen 120 bzw. 420)	EZB: Teil von 3,2B	323		
Saldo der im Berichtszeitraum vorgenommenen Anpassungen aufgrund von Abschreibungen / Wertberichtigungen (322-323)	EZB: 3,2B	324	x	x
Saldo der im Berichtszeitraum vorgenommenen Anpassungen aufgrund von Neuklassifizierungen	EZB: 3,2C	325		
<b>Sonstige Anpassungen (321+324+325)</b>	EZB: 3,2	320	x	x
<b>Daten-Anpassungsmaßnahmen im Berichtszeitraum, die nicht auf eine Nettokreditvergabe zurückzuführen sind (310+320)</b>	EZB: 3	300	x	x
<b>Stand am Monatsende der Berichtsperiode</b>				
Buchforderungen und Wechselkredite	EZB: 4,1	410	x	x
Bestände aus "traditionellen Verbriefungstransaktionen" aus eigenen Forderungsverkäufen (als Originator) <u>ohne</u> Bilanzabgang	EZB: Teil von 4,2	421	x	x
Bestände aus eigenen Forderungsverkäufen (ohne Verbriefungen) <u>ohne</u> Bilanzabgang	EZB: Teil von 4,2	422	x	x
Bestände an verbrieften und sonstigen Forderungsverkäufen <u>ohne</u> Bilanzabgang (421+422)	EZB: 4,2	420	x	x
Bestand der gebildeten Einzelwertberichtigungen ( <b>optional</b> ) <sup>4)</sup>	EZB: 4,3	430		
<b>Stand am Monatsende der Berichtsperiode (410-420+430)</b>	EZB: 4	400	x	x

1) siehe [http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/daily\\_list.en.html](http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/daily_list.en.html); "The euro area population of MFI per category", "Credit institutions"

2) Kennzifferausprägungen: 1 = "ja, als Gruppenmitglied mit Sitz in Deutschland"; 2 = "ja, als Gruppenmitglied mit Sitz in einem anderen Mitgliedsland der EWU"; 3 = "ja, als bietungsberechtigtes Leitinststitut (eigene Meldung)";

4 = "ja, als bietungsberechtigtes Leitinststitut (aggregierte GLRG-II-Gruppenmeldung)"; 5 = "nein"

3) Die in dieser Spalte ausgewiesenen Positionsnummern verweisen auf das jeweilige "item" aus dem EZB-TLTRO-Berichtsbogen ([http://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2014/html/TLTRO\\_reporting\\_template.xls?](http://www.ecb.europa.eu/press/pr/date/2014/html/TLTRO_reporting_template.xls?)).

4) In den gemeldeten BISTA-Beständen sind diese Werte bereits verrechnet; die Anrechnung dieser Position für Zwecke der GLRG-II-Berechnung ist **optional**.

Im Falle der Befüllung der Anwahlposition sind die bereitgestellten Plausibilitätsprüfungen nur noch sehr eingeschränkt verwendbar.

5) Konvention: Anpassungsmaßnahmen fließen mit einem negativen Vorzeichen ein, wenn sie zu einer Bestandsreduzierung führen, und mit einem positivem Vorzeichen, wenn sie zu einer Bestandserhöhung führen; für die BISTA-Meldeschemata O1 und O2 gelten gegenläufige Konventionen.

903 Anmerkungen

**DEUTSCHE BUNDESBANK - Zentrale -  
S 10**

Anlage 2

Stand: 11.05.2016

**Gezielte längerfristige Refinanzierungsgeschäfte (GLRG-II)**
**Formalprüfungen für die Meldungen zu den GLRG-II einschl. des Abgleichs zur monatlichen Bilanzstatistik (BISTA) <sup>1)</sup>**

Anmerkung: Die Befüllung der Anwahlpositionen Y2.130/01, Y2.130/02, Y2.430/01 und Y2.430/02 ist optional. Falls ein GLRG-II-Teilnehmer von dem Ansetzungswahlrecht Gebrauch macht, können die nachfolgenden Plausibilitätsprüfungen nur noch sehr eingeschränkt verwendet werden. GLRG-II-Gruppen sollten sich auf eine einheitliche Ausweispraxis verständigen.

Gleichungs-Nr.	Betroffene Melde-schemata	linke Seite	Operand	rechte Seite <sup>2)</sup>	Anmerkungen
1	Y2_intern	Y2.100/01	=	Y2.110/01 - Y2.120/01 (+ Y2.130/01)	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
2	Y2_intern	Y2.100/02	=	Y2.110/02 - Y2.120/02 (+ Y2.130/02)	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
3	Y2_intern	Y2.120/01	=	Y2.121/01 + Y2.122/01	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
4	Y2_intern	Y2.120/02	=	Y2.121/02 + Y2.122/02	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
5	Y2_intern	Y2.200/01	=	Y2.210/01 - Y2.220/01	
6	Y2_intern	Y2.200/02	=	Y2.210/02 - Y2.220/02	
7	Y2_intern	Y2.300/01	=	Y2.310/01 + Y2.320/01	
8	Y2_intern	Y2.300/02	=	Y2.310/02 + Y2.320/02	
9	Y2_intern	Y2.310/01	=	Y2.311/01 + Y2.314/01 + Y2.317/01	
10	Y2_intern	Y2.310/02	=	Y2.311/02 + Y2.314/02 + Y2.317/02	

Gleichungs-Nr.	Betroffene Melde-schemata	linke Seite	Operand	rechte Seite <sup>2)</sup>	Anmerkungen
11	Y2_intern	Y2.314/01	=	Y2.312/01 + Y2.313/01	
12	Y2_intern	Y2.314/02	=	Y2.312/02 + Y2.313/02	
13	Y2_intern	Y2.317/01	=	Y2.315/01 + Y2.316/01	
14	Y2_intern	Y2.317/02	=	Y2.315/02 + Y2.316/02	
15	Y2_intern	Y2.320/01	=	Y2.321/01 + Y2.324/01 + Y2.325/01	
16	Y2_intern	Y2.320/02	=	Y2.321/02 + Y2.324/02 + Y2.325/02	
17	Y2_intern	Y2.324/01	=	Y2.322/01 - Y2.323/01	
18	Y2_intern	Y2.324/02	=	Y2.322/02 - Y2.323/02	
19	Y2_intern	Y2.400/01	=	Y2.100/01 + Y2.200/01 + Y2.300/01	
20	Y2_intern	Y2.400/01	=	Y2.410/01 - Y2.420/01 (+ Y2.430/01)	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
21	Y2_intern	Y2.400/02	=	Y2.100/02 + Y2.200/02 + Y2.300/02	
22	Y2_intern	Y2.400/02	=	Y2.410/02 - Y2.420/02 (+ Y2.430/02)	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
23	Y2_intern	Y2.420/01	=	Y2.421/01 + Y2.422/01	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
24	Y2_intern	Y2.420/02	=	Y2.421/02 + Y2.422/02	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
25	Y2_BISTA	Y2.110/01	=	Banken (MFIs) ohne Bausparkassen B1.114/04 + B1.114/06 + B3.114/04 + B3.114/06  Besonderheiten Bausparkassen (Bei Anwahlpositionen, die mit einem führenden "BAUSP." bezeichnet werden, handelt es sich um Positionen aus einem Bausparkassen spezifischen Meldeschema): BAUSP.B2.114/04 + B3.114/04 + B3.114/06	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode

Gleichungs-Nr.	Betroffene Melde-schemata	linke Seite	Operand	rechte Seite <sup>2)</sup>	Anmerkungen
26	Y2_BISTA	Y2.110/02	=	B4.121/04 + B4.123/04 + B4.121/06 + B4.123/06 + B4.133/04 + B4.133/06 + B4.221/04 + B4.223/04 + B4.221/06 + B4.223/06 + B4.233/04 + B4.233/06	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
27	Y2_BISTA	Y2.121/01	=	P1.114/04 + P1.114/05 + P1.414/04 + P1.414/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = alle; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
28	Y2_BISTA	Y2.121/02	=	P1.124/04 + P1.126/04 + P1.124/05 + P1.126/05 + P1.130/04 + P1.130/05 + P1.421/04 + P1.423/04 + P1.421/05 + P1.423/05 + P1.430/04 + P1.430/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = alle; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
29	Y2_BISTA	Y2.122/01	=	Q1.114/04 + Q1.114/05 + Q1.414/04 + Q1.414/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
30	Y2_BISTA	Y2.122/02	=	Q1.124/04 + Q1.126/04 + Q1.124/05 + Q1.126/05 + Q1.130/04 + Q1.130/05 + Q1.421/04 + Q1.423/04 + Q1.421/05 + Q1.423/05 + Q1.430/04 + Q1.430/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode
31	Y2_BISTA	Y2.311/01	=	(O2.114/04 + O2.114/05 + O2.414/04 + O2.414/05) * (-1); gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = 1+2+5; 906 = alle	
32	Y2_BISTA	Y2.311/02	=	O2.124/04 + O2.126/04 + O2.124/05 + O2.126/05 + O2.130/04 + O2.130/05 + O2.421/04 + O2.423/04 + O2.421/05 + O2.423/05 + O2.430/04 + O2.430/05) * (-1); gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = 1+2+5; 906 = alle	



Gleichungs-Nr.	Betroffene Melde-schemata	linke Seite	Operand	rechte Seite <sup>2)</sup>	Anmerkungen
33	Y2_BISTA	Y2.312/01	=	$(O1.114/04 + O1.114/05 + O1.414/04 + O1.414/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 1+3; 906 = 1+2+3	
34	Y2_BISTA	Y2.312/02	=	$(O1.124/04 + O1.126/04 + O1.124/05 + O1.126/05 + O1.130/04 + O1.130/05 + O1.421/04 + O1.423/04 + O1.421/05 + O1.423/05 + O1.430/04 + O1.430/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 1+3; 906 = 1+2+3	
35	Y2_BISTA	Y2.313/01	=	$(O1.114/04 + O1.114/05 + O1.414/04 + O1.414/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 1+3; 906 = 4+5	
36	Y2_BISTA	Y2.313/02	=	$(O1.124/04 + O1.126/04 + O1.124/05 + O1.126/05 + O1.130/04 + O1.130/05 + O1.421/04 + O1.423/04 + O1.421/05 + O1.423/05 + O1.430/04 + O1.430/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 1+3; 906 = 4+5	
37	Y2_BISTA	Y2.315/01	=	$(O1.114/04 + O1.114/05 + O1.414/04 + O1.414/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2+4; 906 = 1+2+3	
38	Y2_BISTA	Y2.315/02	=	$(O1.124/04 + O1.126/04 + O1.124/05 + O1.126/05 + O1.130/04 + O1.130/05 + O1.421/04 + O1.423/04 + O1.421/05 + O1.423/05 + O1.430/04 + O1.430/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2+4; 906 = 1+2+3	
39	Y2_BISTA	Y2.316/01	=	$(O1.114/04 + O1.114/05 + O1.414/04 + O1.414/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2+4; 906=4+5 zuzüglich (d.h. +) $(O2.114/04 + O2.114/05 + O2.414/04 + O2.414/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 =3+4; 906 = 1+2	
40	Y2_BISTA	Y2.316/02	=	$O1.124/04 + O1.126/04 + O1.124/05 + O1.126/05 + O1.130/04 + O1.130/05 + O1.421/04 + O1.423/04 + O1.421/05 + O1.423/05 + O1.430/04 + O1.430/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2+4; 906=4+5 zuzüglich (d.h. +) $(O2.124/04 + O2.126/04 + O2.124/05 + O2.126/05 + O2.130/04 + O2.130/05 + O2.421/04 + O2.423/04 + O2.421/05 + O2.423/05 + O2.430/04 + O2.430/05) * (-1)$ ; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 =3+4; 906 = 1+2	

Gleichungs-Nr.	Betroffene Melde-schemata	linke Seite	Operand	rechte Seite <sup>2)</sup>	Anmerkungen
41	Y2_BISTA	Y2.322/01	=	Banken (MFIs) ohne Bausparkassen B1B.114/04 + B1B.114/06 + B3B.114/04 + B3B.114/06  Besonderheiten Bausparkassen (Bei Anwahlpositionen, die mit einem führenden "BAUSP." bezeichnet werden, handelt es sich um Positionen aus Bausparkassen spezifischen Meldeschemata): BAUSP.B2B.114/04 + B3B.114/04 + B3B.114/06	
42	Y2_BISTA	Y2.322/02	=	B4B.121/04 + B4B.123/04 + B4B.121/06 + B4B.123/06 + B4B.133/04 + B4B.133/06 + B4B.221/04 + B4B.223/04 + B4B.221/06 + B4B.223/06 + B4B.233/04 + B4B.233/06	
43	Y2_BISTA	Y2.410/01	=	Banken (MFIs) ohne Bausparkassen B1.114/04 + B1.114/06 + B3.114/04 + B3.114/06  Besonderheiten Bausparkassen (Bei Anwahlpositionen, die mit einem führenden "BAUSP." bezeichnet werden, handelt es sich um Positionen aus einem Bausparkassen spezifischen Meldeschema): BAUSP.B2.114/04 + B3.114/04 + B3.114/06	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
44	Y2_BISTA	Y2.410/02	=	B4.121/04 + B4.123/04 + B4.121/06 + B4.123/06 + B4.133/04 + B4.133/06 + B4.221/04 + B4.223/04 + B4.221/06 + B4.223/06 + B4.233/04 + B4.233/06	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
45	Y2_BISTA	Y2.421/01	=	P1.114/04 + P1.114/05 + P1.414/04 + P1.414/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = alle; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
46	Y2_BISTA	Y2.421/02	=	P1.124/04 + P1.126/04 + P1.124/05 + P1.126/05 + P1.130/04 + P1.130/05 + P1.421/04 + P1.423/04 + P1.421/05 + P1.423/05 + P1.430/04 + P1.430/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 904 = alle; 905 = alle; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode
47	Y2_BISTA	Y2.422/01	=	Q1.114/04 + Q1.114/05 + Q1.414/04 + Q1.414/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode

Gleichungs-Nr.	Betroffene Melde-schemata	linke Seite	Operand	rechte Seite <sup>2)</sup>	Anmerkungen
48	Y2_BISTA	Y2.422/02	=	Q1.124/04 + Q1.126/04 + Q1.124/05 + Q1.126/05 + Q1.130/04 + Q1.130/05 + Q1.421/04 + Q1.423/04 + Q1.421/05 + Q1.423/05 + Q1.430/04 + Q1.430/05; gilt für folgende Kennzifferausprägungen: 905 = 2; 906 = alle	Formel betrifft Stand am Monatsende der Berichtsperiode

1) Bitte beachten Sie, dass die Plausibilitätsprüfungen für das Meldeschema Y2 identisch sind mit denen für das Meldeschema Y1 (siehe Anhang 2 zum Rundschreiben Nr. 45/2014 vom 23.07.2014). Es wurden lediglich die Verweise auf die "alten" BISTA-Meldeschemata (gültig bis 11/2014 einschließlich) entfernt.

2) Bitte beachten Sie, dass sich die Kennziffern 904, 905, 906 in der Spalte "rechte Seite" in diesen Fällen nicht auf das Meldeschema Y2, sondern auf das im jeweiligen Fall betroffene BISTA-Meldeschema beziehen.

**Erfassung des GLRG-II-Meldebogens Y2 im Allgemeinen Meldeportal Statistik (AMS)**

Die Anwendung AMS wird unter folgendem Link  
 fen: <https://extranet.bundesbank.de/ams/>

Nach Eingabe des Benutzernamens (UserID) und des Passworts gelangt man zur folgenden Maske (Extranet-Registrierung muss vorab erfolgt sein<sup>1</sup>):

Unter „Meldungen“ -> „Neue Meldung erstellen“ auswählen

<sup>1</sup> Wir haben allen ExtraNet-Benutzern, die am **3. Mai 2016** berechtigt waren, BISTA-Melddaten einzureichen, zusätzlich die Berechtigung gegeben, den Meldebogen Y2 online erfassen zu dürfen.

- Aktuellen Meldetermin eingeben (mm.jjjj). Im Juni 2016 erwartet die Deutsche Bundesbank hier eine Meldung mit Ständen am Ende der jeweiligen Berichtsperiode („01.2016“). **Bitte achten Sie darauf, dass nur der vorgenannte Termin erfasst wird (das System würde auch jeden anderen Monatswert akzeptieren).**
- Anschließend den Termin mit „Weiter“ bestätigen

- Sachgebiet „BISTA“ auswählen  
(Hinweis für GLRG-II-Institutsgruppen mit deutschem Leitinstitut: Bei Einreichung der Gruppenmeldung durch das Leitinstitut und bei Einreichung der Teilmeldungen der ausländischen Gruppenmitglieder ist das Sachgebiet „AUSFI“ auszuwählen<sup>2</sup>)
- Vordruck/Meldeschema „Y2“ auswählen  
Bitte beachten Sie, dass in der Auswahlmaske weitere Bilanzstatistik-Meldeschemata angezeigt werden; diese sind nicht zur Benutzung freigegeben!
- Anschließend die Auswahl mit „Weiter“ bestätigen

Bei erstmaliger Erstellung einer Meldung ist die Eingabe des fachlichen Ansprechpartners zwingend erforderlich:

- „neuer Ansprechpartner“ auswählen

<sup>2</sup> Bitte beachten Sie, dass die in Fußnote 1 beschriebene automatisierte Freischaltung zur Erfassung des Y2-Meldeschemas nicht für das Arbeitsgebiet „AUSFI“ vorgenommen wurde. Wir bitten die GLRG-II-Leitinststitute zu prüfen, ob entsprechende ExtraNet-Zugangsrechte erforderlich sind und gegebenenfalls eine entsprechende Erst- bzw. Folgeregistrierung vorzunehmen.

- und Erfassungsmaske ausfüllen

- Nach dem Speichern gelangt man automatisch wieder auf die Ursprungsmaske:

- Auswahl „Weiter“

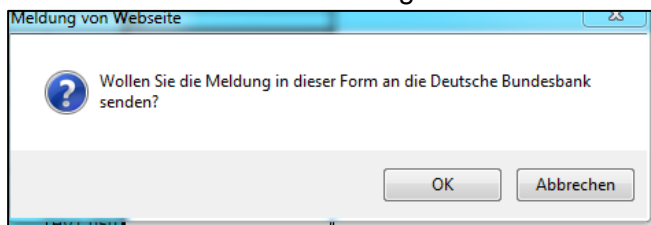
## Erfassungsmaske des GLRG-II-Meldeschemas Y2

	Schuldner mit Sitz im Inland und in anderen Mitgliedsländern der Europäischen Währungsunion (EWU) Angaben in Tsd Euro	nichtfinanzielle (sonstige) Unternehmen alle Laufzeiten insgesamt	Privatpersonen (einschließlich Organisationen ohne Erwerbszweck) ohne Kredite für den Wohnungsbau; alle Laufzeiten insgesamt
	D1	D2	
Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode			
Buchforderungen und Wechselkredite	110		
Bestände aus "traditionellen Verbriefungstransaktionen" aus eigenen Forderungsverkäufen (als Originator) ohne Bilanzabgang	121		
Bestände aus eigenen Forderungsverkäufen (ohne Verbriefungen) ohne Bilanzabgang	122		
Bestände an verbrieften und sonstigen Forderungsverkäufen ohne Bilanzabgang (121+122)	120		
Bestand der gebildeten Einzeleinsparungen (optional)	130		
Stand am Monatsende vor Beginn der Berichtsperiode (110-120+130)	100		
Nettokreditvergabe im Berichtszeitraum			
Bruttokreditvergabe	210		
Tilgungen	220		
Nettokreditvergabe im Berichtszeitraum (210-220)	200		
Daten-Anpassungsmaßnahmen (bzw. -bereinigungsmaßnahmen) im Berichtszeitraum, die nicht auf eine Nettokreditvergabe zurückzuführen sind			

- Erfassungsmaske vollständig ausfüllen
  - ◆ Hinweis: Einige Angaben können erst dann erfasst werden, wenn die Abschnittsüberschrift „Headerinformationen für die Meldung“ (Kennziffern 901 bis 906 des GLRG-II-Meldeschemas Y2) angeklickt wird. Ihren MFI-Identifikator (MFI-Code) finden Sie – sofern nicht bekannt – unter **[http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/daily\\_list.en.html](http://www.ecb.europa.eu/stats/money/mfi/general/html/daily_list.en.html)** ; "The euro area population of MFIs per category", "Credit institutions".
- „Eingabe zwischenspeichern“
- „Versenden“

Hinweis: Versenden ist erst dann möglich, wenn alle Formalprüfungen erfüllt sind (vgl. Anlage 2 zu diesem Bundesbank Rundschreiben)

- Anschließend das Versenden bestätigen:



- Das Meldeschema wird an die Deutsche Bundesbank übermittelt
- Bereits versendete GLRG-II-Meldeschemata Y2 finden Sie unter „Erstellte Meldungen“

Hilfestellung bei der Datenerfassung:

- Technische Fragen zur Bedienung des Meldeportals:  
Telefon: 069/9566-2350, -2351 bzw. -2353
- Inhaltliche Fragen zum Meldeschema:  
Telefon: 069/9566-2356 bzw. -7575