

Qualitäts-/Plausibilitätsprüfungen für die Statistik über Wertpapierinvestments

Stand Januar 2023

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
1	<p><b>XML-Fehler (Validierung)</b> Eine XML-Datei muss bestimmte formale Kriterien erfüllen. Nähere Informationen zum XML-Dateiformat finden Sie auf unserer Bundesbank-Website (<a href="http://www.bundesbank.de">www.bundesbank.de</a>) unter „Service &gt; Meldewesen &gt; Bankenstatistik &gt; Formate XML“</p>	ja
2	<p><b>Absender muss bekannt sein</b> Die Leitzahl des Einreichers (im Unterelement &lt;ABSENDER&gt; der XML-Datei) muss hinterlegt sein. Die Leitzahl für MFIs und „sonstige Kreditinstitute“ ist die achtstellige Bankleitzahl mit Prüfziffer (neunstellig) und für Rechenzentren oder andere Dienstleister die Rechenzentrums-Leitzahl (R gefolgt von acht Ziffern).</p>	ja
3	<p><b>Meldepflichtiges Institut muss bekannt sein</b> Die Leitzahl des meldepflichtigen Instituts (im Unterelement &lt;MELDER&gt; der XML-Datei) muss hinterlegt sein. Die Leitzahl für MFIs und „sonstige Kreditinstitute“ ist die achtstellige Bankleitzahl mit Prüfziffer (neunstellig) und für Kapitalanlagegesellschaften die dreistellige Nummer.</p>	ja
4	<p><b>Meldetermin</b> Der angegebene Meldetermin darf nicht nach dem aktuellen bzw. vor Januar 2013 liegen.</p>	ja
5	<p><b>Nominalwährung/Stück</b> Bei Prozent-Notiz und Promille-Notiz ist die Nominalwährung/Depotwährung in der Abkürzung des dreistelligen ISO-Währungscode anzugeben. Nutzer der WM-Gattungsdatei können das WM-Datenfeld GD171 (Depotwährung/ISO) verwenden. Informationen zur Effektennotiz enthält das WM-Datenfeld GD440. Es dürfen nur gültige ISO-Währungscode verwendet werden. Ein Verzeichnis der Währungen mit Abkürzungen nach ISO-Währungscode findet sich in der Statistischen Sonderveröffentlichung 1, Statistik der Banken und Sonstigen Finanzinstitute - Richtlinien und Kundensystematik.</p>	ja

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
6	<p><b>Sektor-Land</b> Für das Sitzland des Deponenten ist der zweistellige ISO-Ländercode zu verwenden. Es dürfen nur gültige ISO-Ländercodes verwendet werden. Ein Verzeichnis der Länder mit Abkürzungen nach ISO-Ländercodes findet sich in der Statistischen Sonderveröffentlichung 1, Statistik der Banken und Sonstigen Finanzinstitute - Richtlinien und Kundensystematik.</p>	ja
7	<p><b>WP-Kurswährung</b> (gilt nur für Wertpapiere ohne offizielle ISIN) Die WP-Kurswährung ist in der Abkürzung des dreistelligen ISO-Währungscode (Beispiel: Euro – EUR) anzugeben, wie es das WM-Datenfeld GD172 (Abrechnungswährung/ISO) für Papiere mit Kenn-Nummern vorsieht. Es dürfen nur gültige ISO-Währungscode verwendet werden. Ein Verzeichnis der Währungen mit Abkürzungen nach ISO-Währungscode findet sich in der Statistischen Sonderveröffentlichung 1, Statistik der Banken und Sonstigen Finanzinstitute - Richtlinien und Kundensystematik.</p>	ja
8 9	<p><b>WP-Laufzeit</b> (gilt nur für Wertpapiere ohne offizielle ISIN) Hier ist die Ursprungslaufzeit mit Hilfe von Laufzeitbeginn (Emissionstag) und Laufzeitende (Tilgungstermin) anzugeben. Es dürfen nur Wertpapiere mit gültigen Laufzeiten angegeben werden. Eine ungültige WP-Laufzeit liegt vor, wenn - das Laufzeitende vor dem Laufzeitbeginn bzw. vor dem Meldestichtag oder - der Laufzeitbeginn nach dem Meldestichtag liegt.</p>	ja
10 11	<p><b>Kombination der Felder Sektor und Sektor-Land</b> - Werden die Sektoren für Eigenbestände angegeben (1221, 1222, 1223, 1224), so kann das Sitzland des Deponenten immer nur „Deutschland (DE)“ sein. Ist das Sektor-Land in diesen Fällen ungleich DE, dann liegt ein Fehler vor. - Die Sektoren 1215 (ausländische Zentralbanken), 1225 (ausländische Banken) und 1228 (ausländische Zentralverwahrer) können nie „Deutschland (DE)“ als Sitzland des Deponenten aufweisen. Ist das Sektor-Land in diesen Fällen DE, dann liegt ein Fehler vor.</p>	ja
12	<p><b>Mehrfache Meldung einer ISIN bzw. Internen WKN</b> Jede ISIN bzw. Interne WKN darf nur einmal vorkommen. Gleiche ISINs bzw. Interne WKNs sind zusammenzuführen.</p>	ja

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
13	<b>Teilaggregation</b> Bei gleichartigen Datensätzen ist eine Teilaggregation durchzuführen, d. h. alle Wertpapiere, bei denen die Datenfelder „Sektor“, „Sektor-Land“ und die zugehörigen Bestandselemente (B, B-, V und E) identisch sind, sind im Datenfeld „Depotbestand“ betragsmäßig zusammenzufassen. Gleichartige Datensätze dürfen nur einmal in der Meldung aufgeführt werden.	ja
14	<b>Sektorangaben zu den Eigenbeständen</b> Bei der Meldung der Eigenbestände kann jeder ISIN nur einer der Sektoren 1221, 1222, 1223 oder 1224 zugeordnet werden.	ja
15	<b>Saldierung</b> Pro Datensatz darf nur eines der Bestandselemente „B“ oder „B-“ auftreten, d. h. es ist eine Saldierung erforderlich. Dies gilt auch für die neuen Bestandselemente H, H-, BW, BW- und HBW, HBW-.	ja
16	<b>Gemeldete Deponentensektoren und gemeldete Depots</b> Es wird überprüft, ob für die gemeldeten Deponentensektoren auch eine Anzahl von Kundendepots bzw. für eine Anzahl von Kundendepots Wertpapiere mit dem entsprechenden Deponentensektor gemeldet werden. Leerdepots sind nicht zu melden.	ja
17	<b>Existenz bzw. Meldepflicht der gemeldeten ISINs</b> Es dürfen nur existierende bzw. meldepflichtige ISINs gemeldet werden. Dies wird anhand eines Abgleichs mit einer Stamm- und Kursdatenbank sichergestellt.	empfohlen
18	<b>Status der gemeldeten ISIN</b> Es dürfen nur ISINs gemeldet werden, die (i) aktiv sind, (ii) deren Laufzeit noch nicht beendet ist und (iii) deren Laufzeit bereits begonnen hat. Dies wird anhand eines Abgleichs mit einer Stamm- und Kursdatenbank sichergestellt.	empfohlen
19	<b>Fehlende Bestandselemente (Gemeldete Bestandselemente dürfen nicht leer sein)</b> Die für eine ISIN gemeldeten Bestandselemente (B und soweit erforderlich B-, BW(-), H(-), HBW(-)) dürfen nicht leer sein. Dies wird auf ISIN-Basis geprüft.	ja

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
20	<p><b>Unplausible Bestandselemente</b>  Die für eine ISIN gemeldeten Bestandselemente (B(-), BW(-), H(-), HBW(-) – jeweils sofern erforderlich) oder eine Kombination davon weist eine Unplausibilität auf. Dies kann z.B. ein BW von 0 für einen gemeldeten höheren Bestandswert sein.</p>	empfohlen
21	<p><b>Entlehene und verliehene Bestände</b>  Bei der Meldung der Bestandselemente B, B-, V und E sollte folgende Gleichung eingehalten werden <math>B + E &gt; B- + V</math>.</p>	
22	<p><b>Überprüfung der Wertpapiere ohne offizielle ISIN (Interne WKN)</b>  „Interne WKN“ dürfen nur dann gemeldet werden, wenn sie sich im Eigenbestand (Sektor 1221, 1222, 1223 oder 1224) der meldepflichtigen Bank befinden. Die Wertpapiere dürfen nur dann als „Interne WKN“ gekennzeichnet werden, wenn sie keine offizielle ISIN besitzen. Es wird daher überprüft, ob die gemeldeten Wertpapiere eine offizielle ISIN besitzen.</p>	ja
23	<p><b>Fehlende Währung für Wertpapiere ohne offizielle ISIN</b>  Für Wertpapiere ohne offizielle ISIN darf das Attribut „WP-Kurswährung“ nicht leer sein.</p>	empfohlen
24	<p><b>Fehlerhafte Kombination aus Emittentensektor und WP-Art für Wertpapiere ohne offizielle ISIN</b>  Für Wertpapiere ohne offizielle ISIN kann bei einer gemeldeten WP-Art F.52 nur der Emittentensektor S.123 oder S.124 gemeldet werden. Umgekehrt kann bei einem gemeldeten Emittentensektor S.123 bzw. S.124 nur die WP-Art F.52 gemeldet werden.</p>	Ja
25	<p><b>Abgleich der Angabe Nominalwährung/Stück mit einer Stamm- und Kursdatenbank</b>  Es wird die Übereinstimmung der Angabe Nominalwährung/Stück mit der entsprechenden Angabe in einer Stamm- und Kursdatenbank abgestimmt. Damit soll ausgeschlossen werden, dass z. B. ein in DM gemeldetes Wertpapier bereits auf Euro (ISO-Währungscode "EUR") umgestellt bzw. eine prozentnotierte Aktie zwischenzeitlich stücknotiert (Abkürzung „XXX“) ist. Nutzer der WM-Gattungsdatei können das WM-Datenfeld GD171 (Depotwährung/ISO) verwenden. Informationen zur Effektennotiz enthält das WM-Datenfeld GD440.</p>	empfohlen
26	<p><b>Anzeige von unplausiblen Länder-Angaben</b>  Es wird überprüft, ob die gemeldeten Sektor-Länder plausibel erscheinen.</p>	

Nr.	Beschreibung der Prüfung	Ist die Prüfung vom Meldepflichtigen zu implementieren?
27	<p><b>Überschreitung der Marktkapitalisierung oder des Emissionsvolumens</b>  Die gemeldeten Wertpapierbestände insgesamt werden je ISIN der jeweiligen Marktkapitalisierung bzw. dem jeweiligen Emissionsvolumen gegenübergestellt. Eine Unplausibilität liegt u. a. dann vor, wenn die gemeldeten Bestände die Marktkapitalisierung bzw. das Emissionsvolumen überschreiten.</p>	
28	<p><b>Vorterminevergleich</b>  Die Veränderungen des aktuellen Bestands im Vergleich zum Vortermine werden im Hause der Bundesbank überprüft. In diesem Vergleich wird auch geprüft, ob es im Vergleich zum Vortermine bei gemeldeten Wertpapierbeständen zu auffälligen Umschlüsselungen des Deponentensektors oder –landes gekommen ist. Ebenso wird geprüft, ob Deponentensektor/-land-Kombinationen neu/nicht mehr gemeldet werden.</p>	
29	<p><b>Abgleich mit den Eigenbeständen aus der Bilanzstatistik</b>  Die Buchwerte der Sektoren 1221, 1222, 1223 und 1224 in der Statistik über Wertpapierinvestments werden mit den Buchwerten der monatlichen Bilanzstatistik (HV11, Anlage E1 und E2) abgestimmt. Hierzu werden Buchwerte aus WpInvest zu Buchwerten in BISTA ins Verhältnis gesetzt. Eine Unplausibilität liegt vor, wenn Grenzwerte, innerhalb derer sich das Verhältnis bewegen darf, über- bzw. unterschritten werden.</p> <p><b>Abgleich mit der Emissionsstatistik</b>  Im Rahmen der Emissionsstatistik für Schuldverschreibungen wird in der monatlichen Bestands- und Transaktionsdatenmeldung für Inhaberschuldverschreibungen der Eigenbestand der eigenen zurückgekauften Schuldverschreibungen aufgeführt. Die Nominalwerte des Sektors 1222 werden mit diesen Eigenbeständen abgestimmt. Eine Unplausibilität liegt vor, wenn Grenzwerte, innerhalb derer sich das Verhältnis bewegen darf, über- bzw. unterschritten werden.</p>	empfohlen