

Geldmarktfonds und Verbriefungszweckgesellschaften in der Kundensystematik der Bundesbank /

Verbriefungszweckgesellschaften in der BISTA

FACHINFORMATION
F26 – 15.07.2010

VF1 (WM Variables Format)

FOF (WM Financial Object Feed)

ONLINE (Info-Line)

1. Hintergrund

Die Deutsche Bundesbank hat vor einigen Monaten in der Kundensystematik zwei neue Schlüssel eingeführt: „64I Geldmarktfonds“ und „64J Verbriefungszweckgesellschaften“.¹

Zusätzlich wurde in der Bilanzstatistik (BISTA) von der Deutschen Bundesbank der neue Schlüssel „Verbriefungszweckgesellschaften“ geschaffen.²

Nach abschließender Abstimmung mit der Deutschen Bundesbank wird WM Datenservice die o.g. Schlüssel nun verwenden.

2. Umsetzung im Format VF1

Bereits zum 60. Änderungsdienst – Eildienst Nr. 03 und zum 63. Änderungsdienst – Eildienst Nr. 01 wurden die zwei neuen Schlüssel **KD09** und **KA11** eingerichtet. Sie werden **ab dem 19.07.2010** in den Feldern **MD213** (Branche Emittent) und **GD205B** (WZ2008/ Kundensystematik) in den Tabellen Z29, Z30 sowie Z31 Anwendung finden:

Tab.-Nr.	Tab.-Name	Schlüssel	Decode
Z29	WZ08/Kusy (WM-Code)	KA11	Geldmarktfonds
Z30	WZ08/Kusy (WZ08)	KA11	64.19 Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute) (Geldmarktfonds)
Z31	WZ08/Kusy (Kusy)	KA11	64I Geldmarktfonds
Z29	WZ08/Kusy (WM-Code)	KD09	Verbriefungszweckgesellschaften
Z30	WZ08/Kusy (WZ08)	KD09	64.99.9 Sonstige Finanzierungsinstitutionen a.n.g. (Verbriefungszweckgesellschaften)
Z31	WZ08/Kusy (Kusy)	KD09	64J Verbriefungszweckgesellschaften

Bisher wurden Geldmarktfonds unter dem Schlüssel KA04 („Kreditinstitute (ohne Spezialkreditinstitute)“) und Verbriefungszweckgesellschaften unter dem Schlüssel KD08 („Sonstige Finanzierungsinstitutionen a.n.g.“) subsumiert.

Zusätzlich wurde zum 60. Änderungsdienst – Eildienst Nr. 03 der neue Schlüssel **953** im Feld **GD212** (BISTA-Emittentengruppe) eingeführt, der **ab dem 19.07.2010** verwendet wird:

Tab.-Nr.	Tab.-Name	Schlüssel	Decode
F44	BISTA Emittentengruppe	953	Verbriefungszweckgesellschaft

¹ vgl. Rundschreiben Nr. 18/2009 der Deutschen Bundesbank

² vgl. ebd.

Verbriefungszweckgesellschaften in der BISTA wurden bisher unter dem Schlüssel 952 („Sonstige Finanzierungsinstitutionen“) erfasst.

Von der Umstellung auf die Schlüssel KA11 („Geldmarktfonds“) und KD09 („Verbriefungszweckgesellschaften“) in den Feldern **MD213/GD205B** sind etwa **12.000 aktive Emittenten** und ca. **39.500 aktive Gattungen** betroffen. Von diesen 39.500 aktiven Gattungen erhalten ca. **36.500** zusätzlich in **GD212** den neuen Schlüssel 953 („Verbriefungszweckgesellschaft“).

Die Umsetzung wird vom **21.07.2010 bis zum 22.07.2010** in zwei Tranchen erfolgen.

3. Umsetzung im Datenformat FOF

Lieferformat FOF

Sachverhalt	Cloud	Klasse/Attribut	Decode
Branche Emittent (Kusy)	Institution	IndustryActivity mit schemeSymbol = ‚Branche_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KD09‘	Verbriefungszweckgesellschaften
Branche Emittent (Kusy)	Institution	IndustryActivity und schemeSymbol = ‚Branche_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KA11‘	Geldmarktfonds
Kundensystematik	Instrument	ReportingGroupKey mit schemeSymbol = ‚Branche_Emitt_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KD09‘	Verbriefungszweckgesellschaften
Kundensystematik	Instrument	ReportingGroupKey mit schemeSymbol = ‚Branche_Emitt_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KA11‘	Geldmarktfonds
BISTA Emittentengruppe	Instrument	ReportingGroupKey mit schemeSymbol = ‚Bista_Emittentengruppe‘ und idSymbol = ‚953‘	Verbriefungszweckgesellschaft
Branche Emittent (Kusy)	Referenzdaten	Industry mit schemeSymbol = ‚Branche_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KD09‘	Verbriefungszweckgesellschaften
Branche Emittent (Kusy)	Referenzdaten	Industry mit schemeSymbol = ‚Branche_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KA11‘	Geldmarktfonds
Branche Emittent (Kusy)	Referenzdaten	IndustryScheme mit schemeSymbol = ‚Branche_StatBundesamt‘	
Kundensystematik	Referenzdaten	ReportingGroup mit schemeSymbol = ‚Branche_Emitt_StatBundesamt‘ und idSymbol = ‚KD09‘	Verbriefungszweckgesellschaften

Sachverhalt	Cloud	Klasse/Attribut	Decode
Kundensystematik	Referenz- daten	ReportingGroup mit schemeSymbol = ,Branche_Emitt_StatBundesamt' und idSymbol = ,KA11'	Geldmarktfonds
Kundensystematik	Referenz- daten	ReportingGroupscheme mit schemeSymbol = ,Bran- che_Emitt_StatBundesamt'	
BISTA Emittentengruppe	Referenz- daten	Industry mit schemeSymbol = ,Bista_Emittentengruppe' und idSymbol = ,953'	Verbriefungszweckgesellschaft
BISTA Emittentengruppe	Referenz- daten	IndustryScheme mit schemeSymbol = ,Bista_Emittentengruppe'	
BISTA Emittentengruppe	Referenz- daten	ReportingGroup mit schemeSymbol = ,Bista_Emittentengruppe' und idSymbol = ,953'	Verbriefungszweckgesellschaft
BISTA Emittentengruppe	Referenz- daten	ReportingGroupScheme mit schemeSymbol = , Bista_Emittentengruppe'	

Die entsprechenden Anpassungen zu den Decodes der Referenzdatenklassen Industry und ReportingGroup erfolgen mit der Lieferung ab dem 19.07.2010 rsp. dem 2. Eildienst zum 63.Änderungsdienst im laufenden Updateprozess.

4. Umsetzung Info-Line

Angaben zu den Branchen finden sich im WM-DatenOnline-Profil General Meetings. Der neue Branchenschlüssel steht dort im Feld „Branche“ gemeinsam mit dem Decode und parallel mit der Umstellung in unserer Datenbank.

Die Umsetzung wird vom 21.07.2010 bis zum 22.07.2010 in zwei Tranchen erfolgen.