

An alle an der Devisen- und Derivat- erhebung teilnehmenden Banken

Börsenstrasse 15
Postfach, CH-8022 Zürich
Telefon +41 58 631 00 00
Fax +41 58 631 50 46
www.snb.ch

Zürich, 13. November 2015

Statistik

Devisen- und Derivaterhebung im Jahr 2016 Vorankündigung

Die Notenbanken der Industrieländer haben beschlossen, die im Turnus von drei Jahren stattfindende Devisen- und Derivaterhebung im Jahr 2016 zum zehnten Mal durchzuführen. Diese Erhebung wird weltweit von der Bank für Internationalen Zahlungsausgleich (BIZ) koordiniert.

Die dreijährige Devisen- und Derivaterhebung besteht aus zwei Teilen und wird zeitlich gestaffelt erhoben:

- Der erste Teil (DDUM) umfasst die im **April 2016** verzeichneten **Umsätze** auf den Devisen- und Derivatmärkten. Die Daten sind bis spätestens am **31. Mai 2016** einzureichen. Basis der Erhebung sind die inländischen Bankstellen. In der Schweiz sind Banken, deren Kontraktvolumen der offenen derivativen Finanzinstrumente 8 Milliarden Franken übersteigt, für den ersten Teil der Erhebung (Umsatzstatistik) auskunftspflichtig.
- Im zweiten Teil (DDBJ) werden **die ausstehenden Beträge** bei den Derivatprodukten (Nominal- und Marktwerte) **per 30. Juni 2016** erhoben. Die Daten sind bis spätestens am **31. August 2016** einzureichen. Dieser Teil der Erhebung erfolgt auf Konzernebene. Meldepflichtig sind Banken, deren Kontraktvolumen der offenen derivativen Finanzinstrumente 3,5 Milliarden Franken überschreitet. Alle ausländisch beherrschten Banken und Filialen ausländischer Banken sind von der in der Schweiz durchgeführten Umfrage ausgenommen. Die Operationen dieser Institute werden über die Muttergesellschaft durch die Währungsbehörde des entsprechenden Heimatlandes erhoben. Ebenfalls ausgenommen vom zweiten Teil der dreijährigen Erhebung sind

Banken, die bereits an der detaillierteren halbjährlichen Erhebung über die ausstehenden Beträge teilnehmen.

Die **definitiven Erhebungsmittel** für beide Teile der Erhebung werden im **Januar 2016** auf unserer Webseite veröffentlicht. Die SNB übernimmt direkt die Vorgaben der BIZ, passt die Erhebungsformulare jedoch den technischen Gegebenheiten an. Sobald diese verfügbar sind, werden wir Sie erneut informieren.

Die Anforderungen der BIZ entsprechen weitgehend den Anforderungen aus der letzten Erhebung im Jahr 2013. Folgende Anpassungen wurden vorgenommen:

Anpassungen Erhebungsteil Umsätze (DDUM)

- Bislang wurden FX-Umsatzdaten für verschiedene Instrumentenklassen nach sieben verschiedenen Handelsmethoden („Execution Methods for FX Contracts“) erhoben. In der DDUM 2016 wird nun die zusätzliche Methode „Dark Pools“¹ aufgenommen. Darüber hinaus wird die Instrumentengliederung im selben Formular um „Other Products“² ergänzt.
- Im ersten Formular der Umsatzerhebung werden Angaben erhoben, die u.a. auf der Basis von eigenen Schätzungen („Estimated Percentages“) basieren. Neu werden hier geschätzte prozentuale Angaben zur sog. Internalisierung³ von FX-Umsätzen („Internalisation of FX Contracts“) erfasst. Gleichzeitig werden bisherige Fragen zu „Algorithmic and High-Frequency Trading“ sowie „Centrally Cleared Transactions“ gestrichen.

Anpassungen Erhebungsteil ausstehende Beträge (DDBJ)

- Die Gegenpartiegliederung wird um sog. Zentrale Gegenparteien („CCPs“) als Davon-Position der sonstigen Finanzinstitute („Other Financial Institutions“) erweitert. Diese Untergliederung wurde vor drei Jahren bereits für Credit Default Swaps eingeführt und wird nun für die anderen Derivatklassen übernommen.

Vorab können auf der nachstehenden Webseite der BIZ grundlegende Informationen über den Erhebungsgegenstand und die Erhebungsausgestaltung bezogen werden:

www.bis.org/statistics/triennialrep/guidelines_cbanks.htm

¹ Als „Dark Pools“ werden Handelsplattformen bezeichnet, deren Handel mit Finanzprodukten ausserhalb des offenen Wertpapierhandels der Börsen abgeschlossen wird. Während an den offiziellen Börsen Auftraggeber, -nehmer, Stückzahl und Preis registriert werden, bleiben Auftraggeber einer Transaktion in „Dark Pools“ anonym. Der Handelsauftrag und der Kurs, zu dem der Deal abgeschlossen wurde, werden erst im Nachgang in einer Pflichtmeldung an die Börsen weitergegeben.

² Unter „Other Products“ werden Instrumente verstanden, bei denen eine Aufspaltung in einzelne Standardkomponenten wie etwa Forwards, Swaps oder Optionen unmöglich ist.

³ Unter „Internalisierung“ wird der Prozess verstanden, in dem der meldende Händler („Reporting Dealer“) die Order von einem Kunden mit der Order eines anderen Kunden ausgleicht.

Allerdings ist zum momentanen Zeitpunkt nicht auszuschliessen, dass die Dokumente der BIZ noch kleinere Änderungen erfahren werden.