



EUROPÄISCHE ZENTRALBANK

EUROSYSTEM

5. Oktober 2016

PRESSEMITTEILUNG

KONSOLIDIERTER AUSWEIS DES EUROSYSTEMS ZUM 30. SEPTEMBER 2016

Positionen, die nicht mit geldpolitischen Operationen zusammenhängen

In der Woche zum 30. September 2016 ging die Position **Gold und Goldforderungen** (Aktiva 1) um 0,5 Mrd EUR zurück, was auf eine vierteljährliche Neubewertung sowie die Veräußerung von Gold in Höhe von 12 Mio EUR durch eine nationale Zentralbank des Eurosystems zum Zweck der Herstellung einer Gedenkmünze zurückzuführen war.

Die Nettoposition des Eurosystems in Fremdwährung (Aktiva 2 und 3 abzüglich Passiva 7, 8 und 9) erhöhte sich um 5,4 Mrd EUR auf 279,4 Mrd EUR. Diese Veränderung war auf die Auswirkungen der vierteljährlichen Neubewertung von Aktiva und Passiva sowie auf von Zentralbanken des Eurosystems im Betrachtungszeitraum durchgeführte Kunden- und Portfoliotransaktionen zurückzuführen.

Liquiditätszuführende Geschäfte in US-Dollar

Valutatag	Art der Transaktion	Fällig werdender Betrag	Neuer Betrag
29. September 2016	Befristete Transaktion zur Bereitstellung von Liquidität in US-Dollar mit einer Laufzeit von 7 Tagen	290 Mio USD	6 348 Mio USD

Die genannten liquiditätszuführenden Transaktionen wurden vom Eurosystem im Zusammenhang mit der unbefristeten Swap-Vereinbarung zwischen der Europäischen Zentralbank und dem Federal Reserve System durchgeführt.

Die Bestände des Eurosystems an marktfähigen **sonstigen Wertpapieren** (d. h. an Wertpapieren, die nicht zu geldpolitischen Zwecken gehalten werden) (Aktiva 7.2) gingen um 2 Mrd EUR auf 329,3 Mrd EUR zurück. Der **Banknotenumlauf** (Passiva 1) stieg um 4 Mrd EUR auf 1 096,3 Mrd EUR. Die **Einlagen von öffentlichen Haushalten** (Passiva 5.1) verringerten sich um 15,6 Mrd EUR auf 155,4 Mrd EUR.

Positionen im Zusammenhang mit geldpolitischen Operationen

Die Nettoforderungen des Eurosystems an Kreditinstitute (Aktiva 5 abzüglich Passiva 2.2, 2.3, 2.4, 2.5 und 4) sanken um 8,7 Mrd EUR auf 154,5 Mrd EUR. Am Mittwoch, dem 28. September 2016, wurde ein **Hauptrefinanzierungsgeschäft** (Aktiva 5.1) in Höhe von 43,2 Mrd EUR fällig, und ein neues Geschäft in Höhe von 38,7 Mrd EUR mit einwöchiger Laufzeit wurde abgewickelt.

Im Lauf der Woche wurde ein **längerfristiges Refinanzierungsgeschäft** (Aktiva 5.2) in Höhe von 7,7 Mrd EUR fällig, und ein neues Geschäft in Höhe von 4,6 Mrd EUR wurde abgewickelt. Außerdem wurden im Rahmen der **ersten Serie gezielter längerfristiger Refinanzierungsgeschäfte (GLRG-I)** bereitgestellte Mittel in Höhe von 11 Mrd EUR, einschließlich eines freiwilligen Betrags in Höhe von 9,4 Mrd EUR, vor Fälligkeit zurückgezahlt. Darüber hinaus wurde der zweite Tender der **zweiten Serie gezielter längerfristiger Refinanzierungsgeschäfte (GLRG-II)** in Höhe von 45,3 Mrd EUR mit einer Laufzeit von 1 463 Tagen abgewickelt.

Die Inanspruchnahme der **Spitzenrefinanzierungsfazilität** (Aktiva 5.5) betrug praktisch null (gegenüber 0,1 Mrd EUR in der Vorwoche). Die Inanspruchnahme der **Einlagefazilität** (Passiva 2.2) belief sich auf 398 Mrd EUR (gegenüber 362,8 Mrd EUR in der Vorwoche).

Die Bestände des Eurosystems an **zu geldpolitischen Zwecken gehaltenen Wertpapieren** (Aktiva 7.1) nahmen um 14,5 Mrd EUR auf 1 434,8 Mrd EUR zu. In der nachstehenden Tabelle werden diese Bestände nach einzelnen Portfolios detailliert aufgeschlüsselt. Alle Portfolios werden in den Büchern zu fortgeführten Anschaffungskosten ausgewiesen.

Wertpapiere für geldpolitische Zwecke	Ausgewiesener Wert zum 30. September 2016	Veränderung gegenüber dem 23. September 2016 – Käufe	Veränderung gegenüber dem 23. September 2016 – Tilgungen	Veränderung gegenüber dem 23. September 2016 – Anpassungen zum Quartalsende
1. Programm zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen	15,6 Mrd EUR	–	–	–0,0 Mrd EUR
2. Programm zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen	7,3 Mrd EUR	–	–	+0,0 Mrd EUR
3. Programm zum Ankauf gedeckter Schuldverschreibungen	194,3 Mrd EUR	+1,0 Mrd EUR	–	–0,6 Mrd EUR

Programm zum Ankauf von Asset-Backed Securities	20,7 Mrd EUR	+0,6 Mrd EUR	-0,2 Mrd EUR	-
Programm zum Ankauf von Wertpapieren des Unternehmenssektors	29,7 Mrd EUR	+1,9 Mrd EUR	-	-0,1 Mrd EUR
Programm zum Ankauf von Wertpapieren des öffentlichen Sektors	1 061,2 Mrd EUR	+15,6 Mrd EUR	-	-4,1 Mrd EUR
Programm für die Wertpapiermärkte	106 Mrd EUR	-	-	+0,3 Mrd EUR

Einlagen der Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet auf Girokonten

Im Ergebnis aller Transaktionen sanken die **Einlagen** der Kreditinstitute **auf Girokonten** beim Eurosystem (Passiva 2.1) um 4,6 Mrd EUR auf 759,8 Mrd EUR.

Neubewertung der Aktiva und Passiva des Eurosystems zum Quartalsende

Gemäß den harmonisierten Rechnungslegungsgrundsätzen für das Eurosystem werden Gold, Devisen, Wertpapierbestände und Finanzinstrumente des Eurosystems zu jedem Quartalsende zu Marktkursen und -preisen bewertet. Die Nettoauswirkung der Neubewertung auf die einzelnen Ausweispositionen zum 30. September 2016 wird in der zusätzlichen Rubrik „**Veränderungen zur Vorwoche aufgrund von Anpassungen zum Quartalsende**“ ausgewiesen. Im Folgenden sind der Goldpreis und die wichtigsten Wechselkurse aufgeführt, die für die Neubewertung der einzelnen Positionen herangezogen wurden:

Gold: 1 185,915 EUR je Unze Feingold

USD: 1,1161 je EUR

JPY: 113,09 je EUR

Sonderziehungsrechte: 1,2503 EUR je SZR

Konsolidierter Ausweis des Eurosystems - 05.10.2016

Aktiva (in Millionen EUR)	Stand	Veränderungen zur Vorwoche	
		aufgrund von i) Transaktionen	ii) Anpassungen zum Quartalsende
		i)	ii)
1 Gold und Goldforderungen	412.633	-12	-498
2 Forderungen in Fremdwährung an Ansässige außerhalb des Euro-Währungsgebiets	315.195	2.642	-1.973
2.1 Forderungen an den IWF	77.840	1.083	-501
2.2 Guthaben bei Banken, Wertpapieranlagen, Auslandskredite und sonstige Auslandsaktiva	237.354	1.558	-1.472
3 Forderungen in Fremdwährung an Ansässige im Euro-Währungsgebiet	33.904	4.506	-211
4 Forderungen in Euro an Ansässige außerhalb des Euro-Währungsgebiets	19.572	1.829	-14
4.1 Guthaben bei Banken, Wertpapieranlagen und Kredite	19.572	1.829	-14
4.2 Forderungen aus der Kreditfazilität im Rahmen des WKM II	0	0	0
5 Forderungen in Euro aus geldpolitischen Operationen an Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet	552.557	26.581	0
5.1 Hauptrefinanzierungsgeschäfte	38.740	-4.438	0
5.2 Längerfristige Refinanzierungsgeschäfte	513.797	31.071	0
5.3 Feinsteuerungsoperationen in Form von befristeten Transaktionen	0	0	0
5.4 Strukturelle Operationen in Form von befristeten Transaktionen	0	0	0
5.5 Spitzenrefinanzierungsfazilität	20	-52	0
5.6 Forderungen aus Margenausgleich	0	0	0
6 Sonstige Forderungen in Euro an Kreditinstitute im Euro-Währungsgebiet	83.405	-6.552	1
7 Wertpapiere in Euro von Ansässigen im Euro-Währungsgebiet	1.764.071	17.273	-4.776
7.1 Wertpapiere für geldpolitische Zwecke	1.434.785	18.968	-4.484
7.2 Sonstige Wertpapiere	329.286	-1.695	-292
8 Forderungen in Euro an öffentliche Haushalte	26.439	0	-38
9 Sonstige Aktiva	230.369	4.748	3238
Aktiva insgesamt	3.438.145	51.014	-4.271

Differenzen in den Summen durch Runden der Zahlen.

Passiva (in Millionen EUR)	Stand	Veränderungen zur Vorwoche	
		aufgrund von i) Transaktionen	ii) Anpassungen zum Quartalsende
		i)	ii)
1 Banknotenumlauf	1.096.255	4.044	0
2 Verbindlichkeiten in Euro aus geldpolitischen Operationen gegenüber Kreditinstituten im Euro-Währungsgebiet	1.157.891	30.695	0
2.1 Einlagen auf Girokonten (einschließlich Mindestreserveguthaben)	759.817	-4.578	0
2.2 Einlagefazilität	398.016	35.226	0
2.3 Termineinlagen	0	0	0
2.4 Feinsteuerungsoperationen in Form von befristeten Transaktionen	0	0	0
2.5 Verbindlichkeiten aus Margenausgleich	58	47	0
3 Sonstige Verbindlichkeiten in Euro gegenüber Kreditinstituten im Euro-Währungsgebiet	3.804	-56	0
4 Verbindlichkeiten aus der Begebung von Schuldverschreibungen	0	0	0
5 Verbindlichkeiten in Euro gegenüber sonstigen Ansässigen im Euro-Währungsgebiet	260.956	-12.599	0
5.1 Einlagen von öffentlichen Haushalten	155.392	-15.620	0
5.2 Sonstige Verbindlichkeiten	105.564	3.021	0
6 Verbindlichkeiten in Euro gegenüber Ansässigen außerhalb des Euro-Währungsgebiets	122.847	29.427	-4
7 Verbindlichkeiten in Fremdwährung gegenüber Ansässigen im Euro-Währungsgebiet	2.789	-95	-25
8 Verbindlichkeiten in Fremdwährung gegenüber Ansässigen außerhalb des Euro-Währungsgebiets	8.756	-10	4
8.1 Einlagen, Guthaben und sonstige Verbindlichkeiten	8.756	-10	4
8.2 Verbindlichkeiten aus der Kreditfazilität im Rahmen des WKM II	0	0	0
9 Ausgleichsposten für vom IWF zugewiesene Sonderziehungsrechte	58.132	0	-354
10 Sonstige Passiva	207.335	-391	-1.515
11 Ausgleichsposten aus Neubewertung	418.546	0	-2.377
12 Kapital und Rücklagen	100.835	0	0
Passiva insgesamt	3.438.145	51.014	-4.271

Differenzen in den Summen durch Runden der Zahlen.