

OFFENLEGUNG PER 31.12.2021

Meldebogen EU KM1 – Schlüsselparameter

in TEUR		31.12.2021	30.06.2021	31.12.2020
Verfügbare Eigenmittel (Beträge)				
1	Hartes Kernkapital (CET1)	729.622	689.390	691.311
2	Kernkapital (T1)	729.622	689.390	691.311
3	Gesamtkapital	729.622	689.390	691.311
Risikogewichtete Positionsbeträge				
4	Gesamtrisikobetrag	3.770.117	3.912.892	3.856.823
Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)				
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	19,35%	17,62%	17,92%
6	Kernkapitalquote (%)	19,35%	17,62%	17,92%
7	Gesamtkapitalquote (%)	19,35%	17,62%	17,92%
Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für andere Risiken als das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)				
EU 7a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für andere Risiken als das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	1,60%	1,60%	1,60%
EU 7b	davon: in Form von CET1 vorzuhaltend (Prozentpunkte)	0,90%	0,90%	0,90%
EU 7c	davon: in Form von T1 vorzuhaltend (Prozentpunkte)	1,20%	1,20%	1,20%
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	9,60%	9,60%	9,60%
Kombinierte Kapitalpuffer- und Gesamtkapitalanforderung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)				
8	Kapitalerhaltungspuffer (%)	2,50%	2,50%	2,50%
EU 8a	Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats (%)	n/a	n/a	n/a
9	Institutsspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	0,02%	0,02%	0,02%
EU 9a	Systemrisikopuffer (%)	0,50%	0,50%	0,50%
10	Puffer für global systemrelevante Institute (%)	n/a	n/a	n/a
EU 10a	Puffer für sonstige systemrelevante Institute (%)	n/a	n/a	n/a
11	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (%)	3,02%	3,02%	3,02%
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	12,62%	12,62%	12,62%
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1 (%)	9,75%	8,02%	8,32%
Verschuldungsquote				
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	15.357.221	14.913.320	14.676.161
14	Verschuldungsquote (%)	4,75%	4,62%	4,71%

in TEUR		31.12.2021	30.06.2021	31.12.2020
Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)				
EU 14a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	n/a	n/a	n/a
EU 14b	davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	n/a	n/a	n/a
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	3,04%	3,04%	3,00%
Anforderung für den Puffer bei der Verschuldungsquote und die Gesamtverschuldungsquote (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)				
EU 14d	Puffer bei der Verschuldungsquote (%)	n/a	n/a	n/a
EU 14e	Gesamtverschuldungsquote (%)	3,04%	3,04%	3,00%
Liquiditätsdeckungsquote				
15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	1.810.887	1.958.902	1.900.917
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	1.020.883	1.084.863	1.068.246
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	111.801	94.105	80.680
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	891.241	963.983	962.496
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	205,08%	205,05%	196,94%
Strukturelle Liquiditätsquote*				
18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	13.460.728	12.901.018	13.180.597
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	11.179.631	10.265.402	11.371.400
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	120,40%	125,67%	115,91%

* Die NSFR nach CRR II wurde erstmalig per 30.06.2021 gemeldet. Davor wurde die NSFR indikativ nach den geltenden Regelungen der CRR I erstellt. Für offene Detailregelungen wurden Annahmen getroffen.