

OFFENLEGUNG ZUM 30.06.2024

Meldebogen EU KM1 – Schlüsselparameter

in TEUR		30.06.2024	31.12.2023	30.06.2023
Verfügbare Eigenmittel (Beträge)				
1	Hartes Kernkapital (CET1)	815.969	817.211	771.698
2	Kernkapital (T1)	815.969	817.211	771.698
3	Gesamtkapital	815.969	817.211	771.698
Risikogewichtete Positionsbeträge				
4	Gesamtrisikobetrag	4.115.937	3.914.016	3.882.244
Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)				
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	19,82%	20,88%	19,88%
6	Kernkapitalquote (%)	19,82%	20,88%	19,88%
7	Gesamtkapitalquote (%)	19,82%	20,88%	19,88%
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 (%)	1,80%	1,40%	1,40%
EU 7b	davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	1,01%	0,79%	0,79%
EU 7c	davon: in Form von T1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	1,35%	1,05%	1,05%
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	9,80%	9,40%	9,40%
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	Institutspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	0,24%	0,17%	0,04%
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 (%)	3,24%	3,17%	3,04%
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	13,04%	12,57%	12,44%
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1 (%)	10,02%	11,48%	10,48%
Verschuldungsquote				
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	16.681.283	15.497.335	15.277.812
14	Verschuldungsquote (%)	4,89%	5,27%	5,05%

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 vorzuhaltend (Prozentpunkte)	n/a	n/a	n/a
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	3,00%	3,00%	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 (%)	3,00%	3,00%	3,00%

Liquiditätsdeckungsquote

15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	1.921.408	1.571.136	1.949.745
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	950.213	916.898	885.114
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	183.280	189.242	146.340
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	767.566	730.373	740.859
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	310,32%	279,75%	295,98%

Strukturelle Liquiditätsquote

18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	13.357.024	12.308.993	11.732.805
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	10.790.608	10.645.121	10.259.705
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	123,78%	115,63%	114,36%

Meldebogen EU KM2 – Schlüsselparameter

in TEUR

30.06.2024

Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, Verhältniszahlen und Bestandteile

1	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten	2.535.674
EU-1a	davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten	815.969
2	Gesamtrisikobetrag der Abwicklungsgruppe (TREA)	4.115.937
3	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil am TREA	61,61%
EU-3a	davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten	19,82%
4	Gesamtrisikopositionsmessgröße (TEM) der Abwicklungsgruppe	16.681.283
5	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten als prozentualer Anteil an der TEM	15,20%
EU-5a	davon: Eigenmittel und nachrangige Verbindlichkeiten	4,89%
6a	Gilt die Ausnahme von der Nachrangigkeit in Artikel 72b Absatz 4 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013? (5 %-Ausnahme)	
6b	Aggregierter Betrag der zulässigen nicht nachrangigen Instrumente der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten bei Anwendung des Ermessensspielraums für die Rangfolge gemäß Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 (max. 3,5 %-Ausnahme)	
6c	Wenn eine Obergrenze für die Ausnahme von der Nachrangigkeit im Sinne von Artikel 72b Absatz 3 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gilt, handelt es sich um den Betrag der begebenen Mittel, die gleichrangig mit den ausgenommenen Verbindlichkeiten sind und gemäß Zeile 1 angerechnet werden, dividiert durch die begebenen Mittel, die gleichrangig mit den ausgenommenen Verbindlichkeiten sind und die gemäß Zeile 1 angerechnet würden, wenn keine Obergrenze angewendet würde (in %).	

Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (MREL)

EU-7	MREL als prozentualer Anteil am TREA	21,61%
EU-8	davon: mit Eigenmitteln oder nachrangigen Verbindlichkeiten zu erfüllen	0,00%
EU-9	MREL als prozentualer Anteil an der TEM	5,91%
EU-10	davon: mit Eigenmitteln oder nachrangigen Verbindlichkeiten zu erfüllen	0,00%