

Ergebnisdaten der quantitativen Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute 2020



Ergebnisdaten der quantitativen Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute zum 31. Dezember 2020

Die Aufsicht bestimmt mindestens jährlich, welche Institute auf Grundlage einer quantitativen Analyse auf konsolidierter Ebene als global systemrelevant einzustufen sind. Bei dieser Analyse werden gemäß § 10f Absatz 2 KWG folgende Faktoren berücksichtigt:

- Größe der Gruppe
- grenzüberschreitende Aktivitäten der Gruppe
- Vernetztheit der Gruppe mit dem Finanzsystem
- Ersetzbarkeit hinsichtlich der angebotenen Dienstleistungen und Finanzinfrastruktureinrichtungen der Gruppe
- Komplexität der Gruppe.

Die vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht (Basel Committee on Banking Supervision, BCBS) geforderte quantitative Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute basiert auf der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1030/2014 der EU-Kommission vom 29. September 2014 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf einheitliche Formate und Daten für die Offenlegung der Werte zur Bestimmung global systemrelevanter Institute gemäß CRR.

Die Landesbank Baden-Württemberg wird derzeit nicht als global systemrelevant eingestuft.

Die in der nachfolgenden Abbildung dargestellten Indikatoren zum Stichtag 31. Dezember 2020 wurden anhand der vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht veröffentlichten »Instructions for the end – 2020 G – SIB assessment exercise«, Stand Januar 2021, ermittelt.

2

Abschnitt 1: Allgemeine Informationen

a. Allgemeine, von der nationalen Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben	
(1) Ländercode	DE
(2) Name der Bank	LBBW
(3) Meldestichtag (yyyy-mm-dd)	31.12.2020
(4) Meldewährung	EUR
(5) Euro-Umrechnungskurs	1
(6) Datum der Übermittlung (yyyy-mm-dd)	30.04.2021
b. Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben	
(1) Meldeeinheit	1 000 000
(2) Rechnungslegungsstandard	IFRS
	Betrag
Abschnitt 2: Indikator für die Gesamtrisikoposition	
a. Derivate	
(1) Gegenparteien-Risiken aus Derivatkontrakten	17.524
(2) Angepasster Nominalbetrag geschriebener Kreditderivate	2.017

(3) Potenzielle zukünftige Forderungen aus Derivatkontrakten	9.561
b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	
(1) Angepasster Bruttowert von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)	20.482
(2) Gegenparteien-Risiken aus SFT	2.491
c. Sonstige Vermögenswerte	220.707
d. Bruttonominalwert außerbilanzieller Positionen	
(1) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem Kreditkonversionsfaktor (CCF) von 0 %	23.304
(2) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 20 %	3.216
(3) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 50 %	33.141
(4) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 100 %	3.332
e. Regulatorische Anpassungen	272
f. Indikator für die Gesamtrisikoposition (Summe aus den Positionen 2.a.(1) bis 2.c., dem 0,1-Fachen von 2.d.(1), dem 0,2-Fachen von 2.d.(2), dem 0,5-Fachen 2.d.(3), und 2.d.(4))	295.660

Abschnitt 3: Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems

a. Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	57.136
(1) Einlagezertifikate	0
b. Zugesagte aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	9.563
c. Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände	
(1) Besicherte Schuldverschreibungen	16.018
(2) Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	12.955
(3) Nachrangige Schuldverschreibungen	334
(4) Geldmarktpapiere	134
(5) Aktien	430
(6) In Verbindung mit den unter Position 3.c.(5) bestimmten Aktienbeständen aufgerechneten Short-Positionen	317
d. Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	1.946
e. Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Zeitwert	
(1) Positiver beizulegender Zeitwert	3.073
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	3.689
f. Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 3.a, 3.b bis 3.c.(5), 3.d, 3.e.(1) und 3.e.(2) abzüglich 3.c.(6))	104.960

Abschnitt 4: Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems

a. Von anderen Finanzinstituten hinterlegte oder von diesen geliehene Geldmittel	
(1) Einlagen durch Verwahrstellen	67.175
(2) Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	16.607
(3) Von anderen Finanzinstituten erhaltene Mittel	506
b. Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	214
c. Aktuelle negative Nettoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	2.413
d. OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert	
(1) Negativer beizulegender Zeitwert	4.582
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	3.489
e. Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4.a.(1) bis 4.d.(2))	94.986

Abschnitt 5: Indikator für ausstehende Wertpapiere

a. Besicherte Schuldverschreibungen	13.910
b. Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	24.946
c. Nachrangige Schuldverschreibungen	5.151
d. Geldmarktpapiere	4.631
e. Einlagezertifikate	6.279
f. Eigenkapital	0
g. Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5.c nicht erfasst sind	0
h. Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5.a bis 5.g)	54.917

Abschnitt 6: Indikator für Zahlungsaktivität

Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen in:

a. Australischen Dollar	12.501
b. Brasilianischen Real	0
c. Kanadischen Dollar	32.178
d. Schweizer Franken	307.544
e. Chinesischen Yuan	23.394
f. Euro	2.678.245
g. Britischen Pfund	411.010
h. Hongkong-Dollar	1.980
i. Indischen Rupien	4
j. Japanischen Yen	49.558
k. Mexikanischen Pesos	5.664
l. Schwedischen Kronen	27.556
m. US-Dollar	1.597.569
n. Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.m)	5.147.203

Abschnitt 7: Indikator für Custody-Vermögen

331.742

Abschnitt 8: Indikator für Emissionsgeschäfte

a. Aktienemissionsgeschäfte	64
b. Anleihenemissionsgeschäfte	26.783
c. Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b)	26.847

Abschnitt 9: Indikator für OTC-Derivate

a. Über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate	3.242.668
b. Bilateral abgewickelte OTC-Derivate	842.126
c. Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9.a und 9.b)	4.084.794

Abschnitt 10: Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (AFS)-Wertpapiere

a. Wertpapiere des Handelsbestands	6.105
b. Zur Veräußerung verfügbare (AFS-)Wertpapiere	31.039
c. Wertpapiere des Handelsbestands und AFS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen	2.065
d. Wertpapiere des Handelsbestands und AFS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen	12.615

<i>e. Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (AFS)-Wertpapiere (Summe aus den Positionen 10.a und 10.b, abzüglich der Summe von 10.c und 10.d)</i>	22.465
Abschnitt 11: Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3	2.166
Abschnitt 12: Indikator für rechtsräumeübergreifende Forderungen	85.813
Abschnitt 13: Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten	
a. Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)	28.075
(1) Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13.a	17.466
b. Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäften)	6.016
<i>c. Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13.a und 13.b, abzüglich 13.a.(1))</i>	16.625

Abbildung: Ergebnisdaten der quantitativen Analyse für global systemrelevante Institute.

Landesbank Baden-Württemberg

www.LBBW.de
kontakt@LBBW.de

Hauptsitze

Stuttgart

Am Hauptbahnhof 2
70173 Stuttgart
Telefon 0711 127-0
Telefax 0711 127-43544

Karlsruhe

Ludwig-Erhard-Allee 4
76131 Karlsruhe
Telefon 0721 142-0
Telefax 0721 142-23012

Mannheim

Augustaanlage 33
68165 Mannheim
Telefon 0621 428-0
Telefax 0621 428-72591

Mainz

Große Bleiche 54-56
55116 Mainz
Telefon 06131 64-37800
Telefax 06131 64-35701