

**LB≡BW**

Bereit für Neues

Ergebnisdaten der quantitativen  
Analyse zur Bestimmung global  
systemrelevanter Institute 2021



# Ergebnisdaten der quantitativen Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute zum 31. Dezember 2021

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
- Vernetztheit der Gruppe mit dem Finanzsystem
- Ersetzbarkeit hinsichtlich der angebotenen Dienstleistungen und Finanzinfrastruktureinrichtungen der Gruppe
- Komplexität der Gruppe
- grenzüberschreitende Aktivitäten 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. 2021/1018 der EU-Kommission vom 22. Juni 2021 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 2021 wurden anhand der vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht veröffentlichten »Instructions for the end-2021 G-SIB assessment exercise«, Stand Januar 2022, ermittelt.

| Abschnitt 1: Allgemeine Informationen  | Response      |
|--|---------------|
| <b>a. Allgemeine, von der nationalen Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben</b>  |               |
| (1) Ländercode   | DE            |
| (2) Name der Bank  | LBBW          |
| (3) Meldestichtag (yyyy-mm-dd)   | 2021-12-31    |
| (4) Meldewährung   | EUR           |
| (5) Euro-Umrechnungskurs   | 1             |
| (6) Datum der Übermittlung (yyyy-mm-dd)  | 2022-04-29    |
| <b>b. Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben</b>   |               |
| (1) Meldeeinheit   | 1.000.000     |
| (2) Rechnungslegungsstandard   | IFRS          |
| <b>Abschnitt 2: Indikator für die Gesamtrisikoposition</b>   | <b>Betrag</b> |
| <b>a. Derivate</b>   |               |
| (1) Gegenparteien-Risiken aus Derivatkontrakten  | 8.548         |
| (2) Angepasster Nominalbetrag geschriebener Kreditderivate   | 2.019         |
| (3) Potenzielle zukünftige Forderungen aus Derivatkontrakten   | 8.697         |
| <b>b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</b>   |               |
| (1) Angepasster Bruttowert von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)   | 21.656        |
| (2) Gegenparteien-Risiken aus SFT  | 2.570         |
| <b>c. Sonstige Vermögenswerte</b>  | 234.286       |
| <b>d. Bruttonominalwert außerbilanzieller Positionen</b>   |               |
| (1) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem Kreditkonversionsfaktor (CCF) von 0 %   | 23.254        |
| (2) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 20 %  | 3.219         |
| (3) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 50 %  | 37.192        |
| (4) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 100 %   | 3.468         |
| <b>e. Regulatorische Anpassungen</b>   | 324           |
| 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)) | 302.810       |
| <b>g. Forderungen von Versicherungstöchtern, die nicht in 2.f. enthalten sind, nach Abzug der konzerninternen Forderungen:</b>   |               |
| (1) Bilanzwirksame und nicht bilanzwirksame Versicherungsvermögenswerte  | 0             |
| (2) Potenzielles künftiges Risiko aus Derivatverträgen für Versicherungstöchter  | 0             |
| (3) Investitionswert in konsolidierten Unternehmen   | 0             |
| <b>h. Unter 2.g gemeldete konzerninterne Forderungen an Versicherungstöchter, die in 2.f enthalten sind</b>  | 0             |
| <b>i. Indikator für Gesamtrisikopositionen, einschließlich Versicherungstochtergesellschaften (Summe der Positionen 2.f, 2.g.(1) bis 2.g.(2) minus 2.g.(3) bis 2.h)</b>            | 302.810       |

| <b>Abschnitt 3: Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems</b>   | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| <b>a. Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel</b>  | 63.490        |
| (1) Einlagezertifikate   | 15            |
| <b>b. Zugesagte aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden</b>   | 12.581        |
| <b>c. Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände</b>   |               |
| (1) Besicherte Schuldverschreibungen   | 15.280        |
| (2) Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen   | 14.706        |
| (3) Nachrangige Schuldverschreibungen  | 158           |
| (4) Geldmarktpapiere   | 241           |
| (5) Aktien   | 370           |
| (6) In Verbindung mit den unter Position 3.c.(5) bestimmten Aktienbeständen aufgerechneten Short-Positionen  | 207           |
| <b>d. Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten</b>   | 2.106         |
| <b>e. Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Zeitwert</b>  |               |
| (1) Positiver beizulegender Zeitwert   | 1.071         |
| (2) Potenzielle zukünftige Forderungen   | 2.437         |
| <b>f. Indikator für Aktiva innerhalb des Finanzsystems, einschließlich Versicherungstochtergesellschaften (Summe der Positionen 3.a, 3.b bis 3.c.(5), 3.d, 3.e.(1) und 3.e.(2), abzüglich 3.c.(6))</b> | 112.231       |

| <b>Abschnitt 4: Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems</b>   | <b>Betrag</b> |
|---|---------------|
| <b>a. Von anderen Finanzinstituten hinterlegte oder von diesen geliehene Geldmittel</b>   |               |
| (1) Einlagen durch Verwahrstellen   | 73.095        |
| (2) Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind   | 16.687        |
| (3) Von anderen Finanzinstituten erhaltene Mittel   | 429           |
| <b>b. Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden</b>   | 78            |
| <b>c. Aktuelle negative Nettoexposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten</b>  | 2.190         |
| <b>d. OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert</b>   |               |
| (1) Negativer beizulegender Zeitwert  | 2.695         |
| (2) Potenzielle zukünftige Forderungen  | 2.813         |
| <b>e. Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems, einschließlich Versicherungstochtergesellschaften (Summe der Positionen 4.a.(1) bis 4.d.(2))</b> | 97.989        |

| <b>Abschnitt 5: Indikator für ausstehende Wertpapiere</b>  | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Besicherte Schuldverschreibungen  | 11.241        |
| b. Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen  | 25.938        |
| c. Nachrangige Schuldverschreibungen   | 4.604         |
| d. Geldmarktpapiere  | 5.574         |
| e. Einlagezertifikate  | 8.226         |
| f. Eigenkapital  | 0             |
| g. Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5.c nicht erfasst sind   | 0             |
| <b>h. Indikator für ausstehende Wertpapiere, einschließlich der von Versicherungstochtergesellschaften ausgegebenen Wertpapiere (Summe der Positionen 5.a bis 5.g)</b> | 55.582        |

| <b>Abschnitt 6 - Indikator für Zahlungsaktivität (ohne konzerninterne Zahlungen)</b> | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Australische Dollar (AUD)   | 8.987         |
| b. Kanadische Dollar (CAD)   | 30.931        |
| c. Schweizer Franken (CHF)   | 331.919       |
| d. Chinesische Yuan (CNY)  | 21.285        |
| e. Euros (EUR)   | 2.767.137     |
| f. Britische Pfund (GBP)   | 337.402       |
| g. Hongkong Dollar (HKD)   | 1.272         |
| h. Indische Rupien (INR)   | 9             |
| i. Japanische Yen (JPY)  | 39.598        |
| j. Neuseeland Dollar (NZD)   | 2.504         |
| k. Schwedische Kronen (SEK)  | 28.034        |
| l. US Dollar (USD)   | 2.291.687     |
| m. Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.l)            | 5.860.765     |

| <b>Abschnitt 7: Indikator für Custody-Vermögen</b> | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Verwahrte Vermögenswerte                        | 370.899       |

| <b>Abschnitt 8: Indikator für Emissionsgeschäfte</b>                       | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Aktienemissionsgeschäfte  | 400           |
| b. Anleihenemissionsgeschäfte  | 41.413        |
| c. Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b) | 41.813        |

| <b>Abschnitt 9: Handelsvolumen</b>  | <b>Betrag</b> |
|---|---------------|
| a. Handelsvolumen von Wertpapieren, die von anderen öffentlichen Stellen ausgegeben werden, ohne konzerninterne Transaktionen | 71.346        |
| b. Handelsvolumen von sonstigen festverzinslichen Wertpapieren, ohne konzerninterne Transaktionen                             | 156.271       |
| c. Teilindikator "Handelsvolumen festverzinsliche Wertpapiere" (Summe der Positionen 9.a und 9.b)                             | 227.616       |
| d. Handelsvolumen börsennotierter Aktien, ohne konzerninterne Transaktionen   | 24.092        |
| e. Handelsvolumen aller anderen Wertpapiere, ohne konzerninterne Transaktionen  | 37.229        |
| f. Teilindikator Handelsvolumen Aktien und sonstige Wertpapiere (Summe der Positionen 9.d und 9.e)                            | 61.321        |

| <b>Abschnitt 10: Indikator für OTC-Derivate</b>  | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate  | 3.566.595     |
| b. Bilateral abgewickelte OTC-Derivate   | 710.192       |
| c. Nennwert des Indikators für außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate, einschließlich Versicherungstochtergesellschaften (Summe der Positionen 10.a und 10.b) | 4.276.787     |

| <b>Abschnitt 11: Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (Afs)-Wertpapiere</b>  | <b>Betrag</b> |
|---|---------------|
| a. Wertpapiere des Handelsbestands  | 7.401         |
| b. Zur Veräußerung verfügbare (Afs-)Wertpapiere   | 29.801        |
| c. Wertpapiere des Handelsbestands und Afs-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen                            | 13.578        |
| d. Wertpapiere des Handelsbestands und Afs-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen   | 7.942         |
| e. Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (Afs)-Wertpapiere (Summe der Positionen 11.a und 11.b abzüglich der Summe von 11.c und 11.d) | 15.682        |

| <b>Abschnitt 12: Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3</b>                    | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3, einschließlich Versicherungstöchter | 1.626         |

| <b>Abschnitt 13: Indikator für rechtsgebietsübergreifende Forderungen</b>                    | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Gesamte Auslandsforderungen   | 98.777        |
| b. Ausländische Derivateforderungen  | 1.071         |
| c. Indikator für rechtsgebietsübergreifende Forderungen (Summe der Positionen 13.a und 13.b) | 99.848        |

| <b>Abschnitt 14: Indikator für rechtsgebietsübergreifende Verbindlichkeiten</b>                                  | <b>Betrag</b> |
|--|---------------|
| a. Ausländische Verbindlichkeiten, ohne Derivate und einschließlich lokaler Verbindlichkeiten in lokaler Währung | 18.171        |
| b. Ausländische derivative Verbindlichkeiten   | 2.474         |
| c. Indikator für rechtsgebietsübergreifende Verbindlichkeiten (Summe der Positionen 14.a und 14.b)               | 20.645        |

**Landesbank Baden-Württemberg**

[www.LBBW.de](http://www.LBBW.de)  
[kontakt@LBBW.de](mailto:kontakt@LBBW.de)

**Hauptsitze**

**Stuttgart**

Am Hauptbahnhof 2  
70173 Stuttgart  
Telefon 0711 127-0

**Karlsruhe**

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

**Mannheim**

Augustaanlage 33  
68165 Mannheim  
Telefon 0621 428-0

**Mainz**

Rheinallee 86  
55120 Mainz  
Telefon 06131 64-0