

29. April 2016

Ergebnisdaten der Datenerhebung zur Berechnung des Zuschlags für global systemrelevante Institute per 31.12.2015

Die DZ BANK veröffentlicht in Anlage 1 die Ergebnisdaten der Datenerhebung zur Berechnung des Zuschlags für global systemrelevante Institute der DZ BANK Gruppe (aufsichtsrechtlicher Konsolidierungskreis) zum Stichtag 31.12.2015.

Diese Datenerhebung wird vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht (Basel Committee on Banking Supervision, BCBS) durchgeführt, um in einem jährlichen Turnus beurteilen zu können, welche Institutsgruppen als „global systemrelevant“ einzustufen sind.¹ Die DZ BANK Gruppe wird derzeit nicht als „global systemrelevant“ eingestuft.

Die Offenlegung der Ergebnisse erfolgt im Einklang mit der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1030/2014 der Europäischen Kommission vom 29. September 2014,² unter Berücksichtigung der Detailanpassungen im aktuellen Meldebogen.

Grundlage für die Beurteilung sind die in Anlage 1 angegebenen Indikatoren. Diese werden auf Basis der spezifischen Weisungen des BCBS berechnet und sind im Prinzip nicht mit anderen veröffentlichten Daten vergleichbar. So werden z.B. die hier vorliegenden Daten auf Basis des aufsichtsrechtlichen und nicht auf Basis des handelsrechtlichen Konsolidierungskreises ermittelt. Ferner können Anpassungen oder Präzisierungen in den Baseler Instruktionen für diese Datenerhebung Einfluss auf die Endergebnisse haben, so dass diese zum Teil nicht uneingeschränkt mit den offengelegten Vorjahreswerten vergleichbar sind.

Als Zentralbank der genossenschaftlichen FinanzGruppe übernimmt die DZ BANK die Liquiditätsausgleichsfunktion und den Risikotransfer in den Kapitalmarkt für die Volksbanken und Raiffeisenbanken. Auf Grund dieser Zentralbankfunktion für den Verbund wird im Rahmen der Kennziffern für die „Verflechtung mit dem Finanzsektor“ ein relativ hoher Anteil ausgewiesen. Der Verbundanteil an den Vermögenswerten innerhalb des Finanzsystems (Abschnitt 3) beträgt rd. 53% und bei den Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Abschnitt 4) rd. 35%.

¹ Das Dokument kann unter dem nachstehenden Link aufgerufen werden: www.bis.org/publ/bcbs255

² Das Dokument kann unter dem nachstehenden Link aufgerufen werden:
<http://eur-lex.europa.eu/legal-content/DE/TXT/?uri=CELEX:32014R1030>

Anlage 1

Kennziffern für global systemrelevante Banken per 31.12.2015

Allgemeine Bankdaten

Abschnitt 1: Allgemeine Informationen

(1) Datum der Meldung (JJJJ-MM-TT)	2015-12-31
(2) Meldewährung	EUR
(3) Euro-Umrechnungskurs	1
(4) Meldende Abteilung	Group Finance
(5) Rechnungslegungsstandard	IFRS

Größenindikator

Abschnitt 2: Gesamtrisikoposition

	Betrag
a. Derivate	
(1) Gegenparteiausfallrisiken aus Derivatkontrakten	6.438.105.628
(2) Angepasster Nominalwert aus Kreditderivatkontrakten	10.663.149.025
(3) Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert aus Derivatkontrakten	6.234.113.281
b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTs)	
(1) Angepasster Risikopositionswert aus SFTs	14.559.701.623
(2) Gegenparteiausfallrisiken aus SFTs	1.316.359.100
c. Sonstige Vermögenswerte	288.906.321.195
d. Risikopositionswert aus außerbilanziellen Positionen	
(1) Positionen mit einem Kreditkonversionsfaktor (CCF) von 0%	18.605.189.481
(2) Positionen mit einem CCF von 20%	6.029.668.670
(3) Positionen mit einem CCF von 50%	21.657.030.737
(4) Positionen mit einem CCF von 100%	3.200.369.711
e. Regulatorische Anpassungen	987.175.968
f. Indikator für die Gesamtrisikoposition (Gesamtrisikoposition vor regulatorischen Anpassungen) (Summe aus den Positionen 2.a.(1) bis 2.c dem 0,1-fachen von 2.d.(1), dem 0,2-fachen von 2d.(2), dem 0,5-fachen von 2d.(3) und 2d.(4)	345.213.087.612

Indikatoren für Verflechtungen

Abschnitt 3: Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems		Betrag in EUR
a.	Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	79.247.767.762
(1)	Einlagezertifikate	276.375.598
b.	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	20.055.283.026
c.	Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände:	
(1)	Besicherte Schuldverschreibungen	10.394.079.589
(2)	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	17.527.340.583
(3)	Nachrangige Schuldverschreibungen	667.500.076
(4)	Geldmarktpapiere	0
(5)	Beteiligungspapiere	1.146.279.335
(6)	In Verbindung mit den unter Position 3c)5) bestimmten Beteiligungspapierbeständen aufgerechnete Short-Positionen	8.759.622
d.	Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	322.780.333
e.	Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Nettozeitwert	
(1)	Positiver beizulegender Nettozeitwert	6.541.073.999
(2)	Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert	1.678.941.718
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))	137.572.286.800

Abschnitt 4: Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems		Betrag in EUR
a.	Finanzmittel, die von anderen Finanzinstituten hinterlegt von diesen geliehen wurden	
(1)	Einlagen durch Verwahrstellen	41.464.986.142
(2)	Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	9.981.742.562
(3)	Erhaltene Darlehen von anderen Finanzinstituten	67.640.428.542
b.	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	1.901.361
c.	Aktuelle negative Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	773.062.828
d.	OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert:	
(1)	Negativer beizulegender Nettozeitwert	3.605.288.023
(2)	Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert	2.300.336.737
e.	Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4.a bis 4.d.(2))	125.767.746.195

Abschnitt 5: Ausstehende Wertpapiere		Betrag in EUR
a.	Besicherte Schuldverschreibungen	25.036.186.490
b.	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	27.363.713.940
c.	Nachrangige Schuldverschreibungen	3.291.013.795
d.	Geldmarktpapiere	2.445.240.945
e.	Einlagezertifikate	11.957.985.463
f.	Eigenkapital	0
g.	Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5.c nicht erfasst sind	329.381.137
h.	Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5.a bis 5.g)	70.423.521.770

Indikatoren für Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur

Abschnitt 6: Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen (ausgenommen Zahlungen innerhalb der Gruppe)		Betrag in EUR
a.	Australischen Dollar (AUD)	9.317.596.413
b.	Brasilianischen Real (BRL)	309.459.540
c.	Kanadischen Dollar (CAD)	5.439.376.551
d.	Schweizer Franken (CHF)	176.601.899.880
e.	Chinesischen Yuan (CNY)	877.237.711
f.	Euro (EUR)	4.358.248.360.640
g.	Britischen Pfund (GBP)	61.758.533.460
h.	Hongkong-Dollar (HKD)	9.567.736.863
i.	Indischen Rupien (INR)	293.990.360
j.	Japanischen Yen (JPY)	21.651.807.280
k.	Schwedischen Kronen (SEK)	6.567.165.287
l.	US-Dollar (USD)	406.468.702.451
m.	Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.l)	5.057.101.866.435

Abschnitt 7: Custody-Vermögen		Betrag in EUR
a.	Indikator für Custody-Vermögen	687.768.568.362

Abschnitt 8: Übernommene Transaktionen an Fremd- und Eigenkapitalmärkten		Betrag in EUR
a.	Aktienemissionsgeschäfte	80.000.000
b.	Anleihenemissionsgeschäfte	19.926.000.000
c.	Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b)	20.006.000.000

Indikatoren für Komplexität

Abschnitt 9: Nominalwert außerbörslich gehandelter (OTC-)Derivate		Betrag in EUR
a.	über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate	355.127.845.172
b.	bilateral abgewickelte OTC-Derivate	623.051.008.699
c.	Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9.a und 9.b)	978.178.853.871

Abschnitt 10: Wertpapiere des Handelsbestands und zur Veräußerung verfügbare Wertpapiere		Betrag in EUR
a.	Wertpapiere des Handelsbestands (HFT)	22.042.032.374
b.	Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere	38.671.274.197
c.	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen	36.869.783.834
d.	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen	6.906.221.556
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)	16.937.301.181

Abschnitt 11: Vermögenswerte der Stufe 3		Betrag in EUR
a.	Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3	2.105.726.412

Indikatoren für rechtsräumeübergreifende Geschäfte

Abschnitt 12: Rechtsräumeübergreifende Forderungen		Betrag in EUR
a.	Indikator für rechtsräumeübergreifende Forderungen	78.908.776.853

Abschnitt 13: Rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten		Betrag in EUR
a.	Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)	45.453.358.851
(1)	Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13.a	28.512.620.491
b.	Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäfte)	9.864.396.766
c.	Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13.a und 13.b, abzüglich 13.a.(1))	26.805.135.126