

Ergebnisdaten der quantitativen Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute 2022



Ergebnisdaten der quantitativen Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute zum 31. Dezember 2022 (G-SIB Bericht)

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 2022 wurden anhand der vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht veröffentlichten „Instructions for the end-2022 G-SIB assessment exercise“, Stand Januar 2023, ermittelt.

Abschnitt 1: Allgemeine Informationen	Response
a. Allgemeine, von der zuständigen Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben	
(1) Ländercode	DE
(2) Name der Bank	LBBW
(3) Datum der Meldung (JJJJ-MM-TT)	2022-12-31
(4) Meldewährung	EUR
(5) Euro-Umrechnungskurs	1
(6) Datum der Übermittlung (JJJJ-MM-TT)	2022-05-02
b. Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben	
(1) Meldeeinheit	1.000.000
(2) Rechnungslegungsstandard	IFRS

Abschnitt 2: Indikator für die Gesamtrisikoposition**Betrag**

	Betrag
a. Derivate	
(1) Gegenparteien-Risiken aus Derivatkontrakten	3.902
(2) Nominalwert von Kreditderivaten (Obergrenze)	1.459
(3) Potenzielle zukünftige Risikopositionen aus Derivatkontrakten	10.577
b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT)	
(1) Angepasster Bruttowert von SFT	19.474
(2) Gegenparteien-Risiken aus SFT	1.609
c. Sonstige Vermögenswerte	287.052
d. Bruttonominalwert außerbilanzieller Positionen	
(1) Positionen mit einem CCF von 0 % (CCF = Kreditrechnungsfaktor)	24.521
(2) Positionen mit einem CCF von 20 %	2.659
(3) Positionen mit einem CCF von 50 %	46.553
(4) Positionen mit einem CCF von 100 %	4.311
e. Regulatorische Anpassungen	473
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))	354.644
g. Forderungen von Versicherungstöchtern, die nicht in 2.f. enthalten sind, nach Abzug der konzerninternen Forderungen:	
(1) Bilanzwirksame und nicht bilanzwirksame Versicherungsvermögenswerte	0
(2) Potenzielles künftiges Risiko aus Derivatverträgen für Versicherungstöchter	0
(3) Investitionswert in konsolidierten Unternehmen	0
h. Unter 2.g gemeldete konzerninterne Forderungen an Versicherungstöchter, die in 2.f enthalten sind	0
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)	354.644

Abschnitt 3: Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems**Betrag**

a. Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	65.643
(1) Einlagezertifikate	15
b. Zugesagte aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	14.587
c. Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände	
(1) Besicherte Schuldverschreibungen	16.864
(2) Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	16.197
(3) Nachrangige Schuldverschreibungen	150
(4) Geldmarktpapiere	1.292
(5) Aktien	258
(6) In Verbindung mit den unter Position 3.c.(5) bestimmten Aktienbeständen aufgerechneten Short-Positionen	51
d. Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	1.373
e. Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Zeitwert	
(1) Positiver beizulegender Zeitwert	3.148
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	3.073
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))	122.533

Abschnitt 4: Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems**Betrag**

a. Von anderen Finanzinstituten hinterlegte oder von diesen geliehene Geldmittel	
(1) Einlagen durch Verwahrstellen	76.214
(2) Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	19.353
(3) Von anderen Finanzinstituten erhaltene Mittel	699
b. Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	95
c. Aktuelle negative Nettoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	1.345
d. OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert	
(1) Negativer beizulegender Zeitwert	6.058
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	4.106
e. Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems, einschließlich Versicherungstochtergesellschaften (Summe der Positionen 4.a.(1) bis 4.d.(2))	107.870

Abschnitt 5: Indikator für ausstehende Wertpapiere

	Betrag
a. Besicherte Schuldverschreibungen	14.383
b. Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	23.183
c. Nachrangige Schuldverschreibungen	3.739
d. Geldmarktpapiere	6.594
e. Einlagezertifikate	9.056
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, einschließlich der von Versicherungstochtergesellschaften ausgegebenen Wertpapiere (Summe der Positionen 5.a bis 5.g)	56.954

Abschnitt 6 - Indikator für Zahlungsaktivität (ohne konzerninterne Zahlungen)

	Betrag
a. Australische Dollar (AUD)	10.000
b. Kanadische Dollar (CAD)	47.964
c. Schweizer Franken (CHF)	177.711
d. Chinesische Yuan (CNY)	26.432
e. Euros (EUR)	3.393.133
f. Britische Pfund (GBP)	472.924
g. Hongkong Dollar (HKD)	1.220
h. Indische Rupien (INR)	14
i. Japanische Yen (JPY)	76.728
j. Neuseeland Dollar (NZD)	3.183
k. Schwedische Kronen (SEK)	23.622
l. US Dollar (USD)	2.542.297
m. Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.l)	6.775.226

Abschnitt 7: Indikator für Custody-Vermögen

	Betrag
a. Verwahrte Vermögenswerte	366.160

Abschnitt 8: Indikator für Emissionsgeschäfte

	Betrag
a. Aktienemissionsgeschäfte	0
b. Anleihenemissionsgeschäfte	32.466
c. Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b)	32.466

Abschnitt 9: Handelsvolumen

	Betrag
a. Handelsvolumen von Wertpapieren, die von anderen öffentlichen Stellen ausgegeben werden, ohne konzerninterne Transaktionen	48.541
b. Handelsvolumen von sonstigen festverzinslichen Wertpapieren, ohne konzerninterne Transaktionen	259.434
c. Teilindikator "Handelsvolumen festverzinsliche Wertpapiere" (Summe der Positionen 9.a und 9.b)	307.975
d. Handelsvolumen börsennotierter Aktien, ohne konzerninterne Transaktionen	25.759
e. Handelsvolumen aller anderen Wertpapiere, ohne konzerninterne Transaktionen	31.228
f. Teilindikator Handelsvolumen Aktien und sonstige Wertpapiere (Summe der Positionen 9.d und 9.e)	56.987

Abschnitt 10: Indikator für OTC-Derivate

	Betrag
a. Über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate	3.572.960
b. Bilateral abgewickelte OTC-Derivate	963.358
c. Nennwert des Indikators für außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate, einschließlich Versicherungstochtergesellschaften (Summe der Positionen 10.a und 10.b)	4.536.319

Abschnitt 11: Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (AfS)-Wertpapiere	Betrag
a. Wertpapiere des Handelsbestands	8.483
b. Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere	33.474
c. Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen	17.316
d. Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen	8.136
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)	16.505

Abschnitt 12: Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3	Betrag
a. Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3, einschließlich Versicherungstöchter	1.674

Abschnitt 13: Indikator für rechtsgebietsübergreifende Forderungen	Betrag
a. Gesamte Auslandsforderungen	111.580
b. Ausländische Derivateforderungen	1.052
c. Indikator für rechtsgebietsübergreifende Forderungen (Summe der Positionen 13.a und 13.b)	112.632

Abschnitt 14: Indikator für rechtsgebietsübergreifende Verbindlichkeiten	Betrag
a. Ausländische Verbindlichkeiten, ohne Derivate und einschließlich lokaler Verbindlichkeiten in lokaler Währung	11.748
b. Ausländische derivative Verbindlichkeiten	1.529
c. Indikator für rechtsgebietsübergreifende Verbindlichkeiten (Summe der Positionen 14.a und 14.b)	13.277

Abschnitt 21: Gerichtsbarkeitsübergreifende Aktivitäten	Betrag
e. Gesamte Auslandsforderungen auf Basis des letzten Risikos (unter Berücksichtigung der SRM als eine einzige Gerichtsbarkeit)	70.348
f. Forderungen aus ausländischen Derivaten auf der Basis des letzten Risikos (unter Berücksichtigung der SRM als eine einzige Gerichtsbarkeit)	506
g. Auslandsverbindlichkeiten auf Basis des unmittelbaren Risikos, einschließlich Derivate (unter Berücksichtigung der SRM als eine einzige Gerichtsbarkeit)	5.692

Landesbank Baden-Württemberg

www.LBBW.de
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