

27. Mai 2015

Ergebnisdaten der Datenerhebung zur Berechnung des Zuschlags für global systemrelevante Institute per 31.12.2014

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 31.12.2014.

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

Grundlage für die Beurteilung sind die in Anlage 1 angegebenen Indikatoren. Diese werden auf Basis der spezifischen Weisungen des BCBS berechnet und sind folglich 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 basiert der Größenindikator „Indikator für die Gesamtrisikoposition“ (Abschnitt 2), der auf die Leverage Ratio referenziert, weder auf aktuellen Baseler Regelungen zur Leverage Ratio noch auf den aktuellen europaweit gültigen Regelungen der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen (Capital Requirements Regulation, kurz: CRR). Darüber hinaus 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.

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>

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. 30%.

Anlage 1

Kennziffern für global systemrelevante Banken per 31.12.2014

Allgemeine Bankdaten

Abschnitt 1: Allgemeine Informationen		Antwort
a)	Allgemeine, von der nationalen Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben:	
1)	Ländercode	DE
2)	Name der Bank	DZ BANK Gruppe
3)	Datum der Übermittlung (JJJJ-MM-TT)	
b)	Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben:	
1)	Datum der Meldung (JJJJ-MM-TT)	2014-12-31
2)	Meldewährung	EUR
3)	Euro-Umrechnungskurs	1
4)	Meldende Abteilung	Group Finance
5)	Rechnungslegungsstandard	IFRS

Größenindikator

Abschnitt 2: Gesamtrisikoposition		Betrag
a)	Gegenparteien-Risiken aus Derivatkontrakten (Methode 1)	11.341.215.822
b)	Bruttowert von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)	12.120.009.110
c)	Gegenparteien-Risiken aus SFT	2.340.238.521
d)	Sonstige Vermögenswerte	282.155.653.587
1)	In SFT erhaltene Sicherheiten, die als Vermögenswerte angesetzt werden	0
e)	Bilanzwirksame Positionen insgesamt (Summe aus den Positionen 2 a), 2 b), 2 c) und 2 d), abzüglich 2 d) Unterpunkt 1))	307.819.996.025
f)	Potenzielle zukünftige Forderungen aus Derivatkontrakten (Methode 1)	11.285.302.833
g)	Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 0 %	17.013.007.778
1)	Unbedingt kündbare Kreditkartenforderungen	0
2)	Sonstige unbedingt kündbare Verpflichtungen	17.013.007.778
h)	Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 20 %	5.671.074.410
i)	Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 50 %	20.460.271.715
j)	Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 100 %	5.799.283.044
k)	Außerbilanzielle Positionen insgesamt (Summe aus den Positionen 2 f), 2 g) und 2 h) bis 2 j), abzüglich dem 0,9-Fachen der Summe aus den Positionen 2 g) Unterpunkt 1) und 2 g) Unterpunkt 2))	44.917.232.780
l)	Für Bilanzzwecke, jedoch nicht für risikobasierte, regulatorische Zwecke konsolidierte Unternehmen:	
1)	Bilanzwirksame Vermögenswerte	3.812.188.302

2)	Potenzielle zukünftige Risikopositionen aus Derivatkontrakten	3.894.350
3)	Unbedingt kündbare Verpflichtungen	0
4)	Sonstige außerbilanzielle Verpflichtungen	268.939.767
5)	Investitionswert in Bezug auf die konsolidierten Unternehmen	725.395.883
m)	Regulatorische Anpassungen	715.289.170
n)	Indikator für die Gesamtrisikoposition (Summe aus den Positionen 2 e), 2 k), 2 l) Unterpunkt 1, 2 l) Unterpunkt 2, dem 0,1-Fachen von 2 l) Unterpunkt 3, 2 l) Unterpunkt 4, abzüglich der Summe aus den Positionen 2 l) Unterpunkt 5 und 2 m))	355.518.687.186

Indikatoren für Verflechtungen

Abschnitt 3: Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems		Betrag
a)	Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	72.415.520.707
1)	Einlagezertifikate	165.069.597
b)	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	19.419.407.430
c)	Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände:	
1)	Besicherte Schuldverschreibungen	14.084.494.931
2)	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	27.779.208.879
3)	Nachrangige Schuldverschreibungen	804.648.897
4)	Geldmarktpapiere	163.996.369
5)	Aktien (einschließlich des Nennbetrags und des Mehrwerts von Stamm- und Vorzugsaktien)	1.071.587.322
6)	In Verbindung mit den unter Position 3 c) Unterpunkt 5) bestimmten Aktienbeständen aufgerechnete Short-Positionen	2.289.766
d)	Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	188.290.463
e)	Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Nettozeitwert	
1)	Positiver beizulegender Nettozeitwert (einschließlich gehaltene Sicherheiten, wenn sie von der Netting-Rahmenvereinbarung abgedeckt werden)	4.243.989.431
2)	Potenzielle zukünftige Forderungen	1.665.273.400
f)	Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 3 a), 3 b) bis 3 c) Unterpunkt 5, 3 d), 3 e) Unterpunkt 1 und 3 e) Unterpunkt 2, abzüglich 3 c) Unterpunkt 6))	141.834.128.062

Abschnitt 4: Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems		Betrag
a)	Einlagen durch Verwahrstellen	79.705.233.194
b)	Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	32.028.076.165
c)	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	4.409.180
d)	Aktuelle negative Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	905.544.387
e)	OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert:	
1)	Negativer beizulegender Nettozeitwert (einschließlich Sicherheiten, wenn sie von der Netting-Rahmenvereinbarung abgedeckt werden)	4.438.345.715
2)	Potenzielle zukünftige Forderungen	2.281.860.595
f)	Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4 a) bis 4 e) Unterpunkt 2))	119.363.469.236

Abschnitt 5: Ausstehende Wertpapiere		Betrag
a)	Besicherte Schuldverschreibungen	25.952.497.494
b)	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	30.964.733.074
c)	Nachrangige Schuldverschreibungen	2.684.934.680
d)	Geldmarktpapiere	3.257.298.618
e)	Einlagezertifikate	12.800.129.087
f)	Eigenkapital	11.079.041.765
g)	Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5 c) nicht erfasst sind	365.158.846
h)	Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5 a) bis 5 g))	87.103.793.563

Indikatoren für Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur

Abschnitt 6: Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen (ausgenommen Zahlungen innerhalb der Gruppe)		Ausgewiesen in:	Betrag in angegebener Währung	Betrag
a)	Australischen Dollar	AUD	12.566.163.595	8.543.719.863
b)	Brasilianischen Real	BRL	1.207.268.442	387.248.645
c)	Kanadischen Dollar	CAD	5.173.478.802	3.531.581.747
d)	Schweizer Franken	CHF	66.849.573.942	55.040.006.891
e)	Chinesischen Yuan	CNY	2.242.256.437	274.427.456
f)	Euro	EUR	4.229.050.553.681	4.229.050.553.681
g)	Britischen Pfund	GBP	41.722.272.315	51.779.857.340
h)	Hongkong-Dollar	HKD	123.023.266.653	11.960.418.434
i)	Indischen Rupien	INR	16.803.778.375	207.603.944

j)	Japanischen Yen	JPY	2.505.125.077.255	17.863.828.980
k)	Schwedischen Kronen	SEK	36.106.029.645	3.969.838.715
l)	US-Dollar	USD	403.862.586.961	304.488.380.938
m)	Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6 a) bis 6 l))			4.687.097.466.634

Abschnitt 7: Custody-Vermögen				Betrag
a)	Indikator für Custody-Vermögen			634.806.987.991

Abschnitt 8: Übernommene Transaktionen an Fremd- und Eigenkapitalmärkten				Betrag
a)	Aktienemissionsgeschäfte			0
b)	Anleihenemissionsgeschäfte			20.478.410.000
c)	Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8 a) und 8 b))			20.478.410.000

Indikatoren für Komplexität

Abschnitt 9: Nominalwert außerbörslich gehandelter (OTC-)Derivate				Betrag
a)	über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate			240.820.143.864
b)	bilateral abgewickelte OTC-Derivate			616.015.111.416
c)	Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9 a) und 9 b))			856.835.255.280

Abschnitt 10: Wertpapiere des Handelsbestands und zur Veräußerung verfügbare Wertpapiere				Betrag
a)	Wertpapiere des Handelsbestands			23.884.941.440
b)	Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere			40.160.708.157
c)	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen			25.179.371.374
d)	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen			7.932.486.260
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))			30.933.791.963

Abschnitt 11: Vermögenswerte der Stufe 3				Betrag
a)	Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3			3.747.110.954

Indikatoren für rechtsräumeübergreifende Geschäfte

Abschnitt 12: Rechtsräumeübergreifende Forderungen		Betrag
a)	Indikator für rechtsräumeübergreifende Forderungen (Position 12 a))	80.184.949.820
Abschnitt 13: Rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten		Betrag
a)	Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)	45.468.547.739
1)	Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13 a)	22.688.850.790
b)	Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäfte)	4.824.748.917
d)	Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13 a) und 13 b), abzüglich 13 a) Unterpunkt 1))	27.604.445.866