

28.04.2017

Ergebnisdaten der Datenerhebung zur Ermittlung global systemrelevanter Institute per 31.12.2016

DZ BANK AG
Deutsche Zentral-
Genossenschaftsbank

Investor Relations

Die DZ BANK veröffentlicht in Anlage 1 die Ergebnisdaten der DZ BANK Gruppe (aufsichtsrechtlicher Konsolidierungskreis) der Datenerhebung zur Ermittlung global systemrelevanter Institute zum Stichtag 31.12.2016.

Diese Datenerhebung wird vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht (Basel Committee on Banking Supervision, BCBS) durchgeführt, um in einem jährlichen Turnus beurteilen zu können, welche Institute 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 2014², unter Berücksichtigung der Detailanpassungen im aktuellen Meldebogen.

Grundlage für die Beurteilung sind die in Anlage 1 angegebenen Indikatoren und Kriterien. 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. Der Vergleich der aktuellen Werte zum Stichtag 31.12.2016 mit den Vorjahreswerten zum Stichtag 31.12.2015 wird zudem stark beeinflusst durch die Fusion der DZ BANK mit der WGZ BANK im Jahr 2016.

DZ BANK übernimmt als Zentralbank für die Unternehmen der Genossenschaftlichen FinanzGruppe die Liquiditätsausgleichsfunktion und den Risikotransfer in den Kapitalmarkt. Auf Grund dieser Zentralbankfunktion werden im Rahmen der Kennziffern für die Verflechtung mit dem Finanzsektor relativ hohe Werte ausgewiesen.

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

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 zur Ermittlung global systemrelevanter Institute per 31.12.2016

Allgemeine Bankdaten

Abschnitt 1: Allgemeine Informationen

(1) Datum der Meldung (JJJJ-MM-TT)	2016-12-31
(2) Meldewährung	EUR
(3) Euro-Umrechnungskurs	1
(4) Meldende Abteilung	AUP
(5) Rechnungslegungsstandard	IFRS

Größenindikator

Abschnitt 2: Gesamtrisikoposition

	Betrag
a. Derivate	
(1) Gegenparteiausfallrisiken aus Derivatkontrakten	8.403.874.790
(2) Angepasster Nominalwert aus Kreditderivatkontrakten	5.067.344.548
(3) Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert aus Derivatkontrakten	8.479.113.840
b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTs)	
(1) Angepasster Risikopositionswert aus SFTs	13.561.121.117
(2) Gegenparteiausfallrisiken aus SFTs	362.550.700
c. Sonstige Vermögenswerte	384.815.292.207
d. Risikopositionswert aus außerbilanziellen Positionen	
(1) Positionen mit einem Kreditkonversionsfaktor (CCF) von 0%	19.196.725.462
(2) Positionen mit einem CCF von 20%	8.428.313.037
(3) Positionen mit einem CCF von 50%	27.642.052.658
(4) Positionen mit einem CCF von 100%	5.228.578.605
e. Regulatorische Anpassungen	740.784.840
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)	443.344.237.290

Indikatoren für Verflechtungen

Abschnitt 3: Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems		Betrag in EUR
a.	Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	94.715.315.712
(1)	Einlagezertifikate	200.395.154
b.	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	21.859.494.750
c.	Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände:	
(1)	Besicherte Schuldverschreibungen	10.786.711.458
(2)	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	17.746.683.908
(3)	Nachrangige Schuldverschreibungen	468.749.131
(4)	Geldmarktpapiere	35.056.623
(5)	Beteiligungspapiere	2.640.617.009
(6)	In Verbindung mit den unter Position 3c)5) bestimmten Beteiligungspapierbeständen aufgerechnete Short-Positionen	10.258.232
d.	Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten (geänderte Definition)	340.809.999
e.	Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Nettozeitwert	
(1)	Positiver beizulegender Nettozeitwert	7.265.706.947
(2)	Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert	2.353.598.800
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))	158.202.486.105

Abschnitt 4: Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems		Betrag in EUR
a.	Finanzmittel, die von anderen Finanzinstituten hinterlegt von diesen geliehen wurden	
(1)	Einlagen durch Verwahrstellen	67.433.479.834
(2)	Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	28.076.621.046
(3)	Erhaltene Darlehen von anderen Finanzinstituten	67.856.166.694
b.	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	174.123.005
c.	Aktuelle negative Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten (geänderte Definition)	474.951.052
d.	OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert:	
(1)	Negativer beizulegender Nettozeitwert	3.437.339.243
(2)	Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert	2.216.156.220
e.	Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4.a bis 4.d.(2))	169.668.837.094

Abschnitt 5: Ausstehende Wertpapiere		Betrag in EUR
a.	Besicherte Schuldverschreibungen	30.951.152.923
b.	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	35.436.528.911
c.	Nachrangige Schuldverschreibungen	2.862.212.848
d.	Geldmarktpapiere	3.650.271.857
e.	Einlagezertifikate	22.918.336.499
f.	Eigenkapital	0
g.	Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5.c nicht erfasst sind	322.341.134
h.	Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5.a bis 5.g)	96.140.844.172

Indikatoren für Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur

Abschnitt 6: Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen (ausgenommen Zahlungen innerhalb der Gruppe)		Betrag in EUR
a.	Australischen Dollar (AUD)	10.585.498.329
b.	Brasilianischen Real (BRL)	523.605.003
c.	Kanadischen Dollar (CAD)	6.809.707.880
d.	Schweizer Franken (CHF)	340.046.295.909
e.	Chinesischen Yuan (CNY)	869.615.081
f.	Euro (EUR)	5.457.222.177.173
g.	Britischen Pfund (GBP)	55.437.677.782
h.	Hongkong-Dollar (HKD)	16.354.864.073
i.	Indischen Rupien (INR)	368.680.067
j.	Japanischen Yen (JPY)	26.391.160.040
k.	Schwedischen Kronen (SEK)	8.933.399.122
l.	US-Dollar (USD)	430.975.473.398
m.	Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.l)	6.354.518.153.857

Abschnitt 7: Custody-Vermögen		Betrag in EUR
a.	Indikator für Custody-Vermögen	869.750.756.272

Abschnitt 8: Übernommene Transaktionen an Fremd- und Eigenkapitalmärkten		Betrag in EUR
a.	Aktienemissionsgeschäfte	311.000.000
b.	Anleihenemissionsgeschäfte	28.905.930.000
c.	Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b)	29.216.930.000

Indikatoren für Komplexität

Abschnitt 9: Nominalwert außerbörslich gehandelter (OTC-)Derivate		Betrag in EUR
a.	über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate	409.886.898.057
b.	bilateral abgewickelte OTC-Derivate	751.970.992.677
c.	Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9.a und 9.b)	1.161.857.890.734

Abschnitt 10: Wertpapiere des Handelsbestands und zur Veräußerung verfügbare Wertpapiere		Betrag in EUR
a.	Wertpapiere des Handelsbestands (HFT)	21.156.897.360
b.	Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere	49.425.732.101
c.	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen	41.608.906.809
d.	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen	11.798.380.146
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)	17.175.342.506

Abschnitt 11: Vermögenswerte der Stufe 3		Betrag in EUR
a.	Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3	3.705.069.938

Indikatoren für rechtsräumeübergreifende Geschäfte

Abschnitt 12: Rechtsräumeübergreifende Forderungen		Betrag in EUR
a.	Indikator für rechtsräumeübergreifende Forderungen	91.717.195.910

Abschnitt 13: Rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten		Betrag in EUR
a.	Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)	51.564.034.720
(1)	Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13.a	32.364.075.834
b.	Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäfte)	12.965.772.982
c.	Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13.a und 13.b, abzüglich 13.a.(1))	32.165.731.868