

Juli 2014

Ergebnisdaten der quantitativen Analyse für global systemrelevante Banken per 31.12.2013

Die DZ BANK veröffentlicht in **Anlage 1** die Ergebnisdaten der quantitativen Analyse für global systemrelevante Banken der DZ BANK Gruppe (aufsichtsrechtlicher Konsolidierungskreis) zum Stichtag 31.12.2013.

Diese quantitative Analyse wird von dem Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht (Basel Committee on Banking Supervision, BCBS) durchgeführt, um beurteilen zu können, welche Institutsgruppen als „global systemrelevant“ einzustufen sind.¹ Der BCBS bewertet die Systemrelevanz von Banken regelmäßig in einem globalen Kontext. Die DZ BANK Gruppe wird derzeit nicht als „global systemrelevant“ eingestuft.

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 uneingeschränkt 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 „Risikomessgröße für Leverage Ratio“ auf den zum Jahresende 2013 aktuellen Baseler Regelungen, die von den aktuellen europaweit gültigen Regelungen der Capital Requirements Regulation (CRR) zur Leverage Ratio abweichen.

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 „Vernetzung mit dem Finanzsektor“ eine relativ hohe Verflechtung ausgewiesen. Der Verbundanteil an den Aktiva gegenüber dem Finanzsektor beträgt 53% und bei den Verbindlichkeiten mit dem Finanzsektor 29%.

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

Anlage 1

Kennziffern für global systemrelevante Banken per 31.12.2013

Indikatoren	Kennziffern	Beträge in Mio. EUR
Größe	Risikomessgröße für Leverage Ratio gem. Basler Regelungen	335.984
Vernetztheit mit dem Finanzsektor	Aktiva gegenüber dem Finanzsektor	140.782
	Verbindlichkeiten mit dem Finanzsektor	123.554
	Wertpapiere im Umlauf	61.762
Ersetzbarkeit/ Infrastruktur	Zahlungsverkehrsumsätze (Kalenderjahr 2013)	4.100.120
	Aktiva in Verwahrung	525.145
	Emissionsgeschäfte in Aktien und Anleihe (Kalenderjahr 2013)	17.147
Komplexität	Nominalwert OTC-Derivate	970.582
	Wertpapiere „held for trading“ und „available for sale“	19.370
	Level 3-Aktiva	3.120
Grenzüberschreitende Aktivität	Grenzüberschreitende Forderungen	80.160
	Grenzüberschreitende Verbindlichkeiten	24.293