

KENNZAHLEN

OFFENLEGUNG GEMÄSS FINMA-RS 2016/01

in 1'000 CHF und in %

T= Quartal		a	b	c	d	e
		T	T-1	T-2	T-3	T-4
Anrechenbare Eigenmittel (CHF)						
1	Hartes Kernkapital (CET1)	25'137	23'423	23'423	23'423	23'423
1a	Hartes Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	25'137	23'423	23'423	23'423	23'423
2	Kernkapital (T1)	25'137	23'423	23'423	23'423	23'423
2a	Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	25'137	23'423	23'423	23'423	23'423
3	Gesamtkapital total	25'137	23'423	23'423	23'423	23'423
3a	Gesamtkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	25'137	23'423	23'423	23'423	23'423
Risikogewichtete Positionen (RWA) (CHF)						
4	RWA	103'768	102'118	120'359	129'220	130'360
4a	Mindesteigenmittel (CHF)	8'301	8'169	9'629	10'338	10'909
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)						
5	CET1-Quote (%)	24.2%	22.9%	19.5%	18.1%	17.2%
5a	CET1-Quote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	24.2%	22.9%	19.5%	18.1%	17.2%
6	Kernkapitalquote (%)	24.2%	22.9%	19.5%	18.1%	17.2%
6a	Kernkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	24.2%	22.9%	19.5%	18.1%	17.2%
7	Gesamtkapitalquote (%)	24.2%	22.9%	19.5%	18.1%	17.2%
7a	Gesamtkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	24.2%	22.9%	19.5%	18.1%	17.2%
CET1-Pufferanforderungen (in % der RWA)						
8	Eigenmittelpuffer nach Basler Mindeststandards (2.5% ab 2019) (%)	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%
9	Antizyklischer Puffer (Art. 44a ERV) nach Basler Mindeststandards (%)	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
10	Zusätzlicher Eigenmittelpuffer wegen internationaler oder nationaler Systemrelevanz (%)	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
11	Gesamte Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards in CET1-Qualität (%)	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%
12	Verfügbares CET1 zur Deckung der Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards (nach Abzug von CET1 zur Deckung der Mindestanforderungen und ggf. zur Deckung von TLAC-Anforderungen) (%)	16.2%	14.9%	11.5%	10.1%	9.9%
Kapitalzielquoten nach Anhang 8 der ERV (in % der RWA)						
12a	Eigenmittelpuffer gemäss Anhang 8 ERV (%)	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%	2.5%
12b	Antizyklische Puffer (Art. 44 und 44a ERV) (%)	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%	0.0%
12c	CET1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 der ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	7.0%	7.0%	7.0%	7.0%	7.0%
12d	T1-Zielquote in (%) gemäss Anhang 8 der ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	8.5%	8.5%	8.5%	8.5%	8.5%
12e	Gesamtkapital-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 der ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	10.5%	10.5%	10.5%	10.5%	10.5%
Basel III Leverage Ratio						
13	Gesamtengagement (CHF)	679'823	700'855	710'981	696'213	624'768
14	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	3.7%	3.3%	3.3%	3.4%	3.8%
14a	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements) ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	3.7%	3.3%	3.3%	3.4%	3.8%
Liquiditätsquote (LCR)						
15	Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (CHF)	63'825	52'597	51'088	51'857	53'780
16	Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (CHF)	43'114	40'082	42'054	38'854	38'934
17	Liquiditätsquote, LCR (in %)	150.8%	131.3%	121.5%	133.5%	140.0%
Finanzierungsquote (NSFR)						
15	Verfügbare stabile Refinanzierung (in CHF)	321'627		332'278		310'012
16	Erforderliche stabile Refinanzierung (in CHF)	97'689		161'707		138'043
17	Finanzierungsquote, NSFR (in %)	329.2%		205.0%		225.0%

Die Offenlegung der Eigenmittelanforderungen, der Leverage Ratio und der Liquidity Coverage Ratio erfolgen in Übereinstimmung mit den Vorgaben aus FINMA-RS 2016/1. Bis T-2 wurden die Kreditäquivalente von Derivaten nach SA-CCR berechnet. Ab T-1 wieder mit dem alten Ansatz (Markwertmethode). Die Bank ist als Gruppengesellschaft der Van Lanschot NV Gruppe von weiteren Eigenmittelloffenlegungspflichten befreit. Entsprechende Angaben sind im Geschäftsbericht der Van Lanschot Kempen N.V. Gruppe zu finden.