

KENNZAHLEN

OFFENLEGUNG GEMÄSS FINMA-RS 2016/01

in 1'000 CHF und in %

	T= Quartal	a T	b T-1	c T-2	d T-3	e T-4
Anrechenbare Eigenmittel (CHF)						
1	Hartes Kernkapital (CET1)	25'137	25'137	25'137	25'137	25'137
1a	Hartes Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	25'137	25'137	25'137	25'137	25'137
2	Kernkapital (T1)	25'137	25'137	25'137	25'137	25'137
2a	Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	25'137	25'137	25'137	25'137	25'137
3	Gesamtkapital total	25'137	25'137	25'137	25'137	25'137
3a	Gesamtkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	25'137	25'137	25'137	25'137	25'137
Risikogewichtete Positionen (RWA) (CHF)						
4	RWA	84'522	98'963	117'117	112'124	103'768
4a	Mindesteigenmittel (CHF)	6'762	7'917	9'369	8'970	8'301
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)						
5	CET1-Quote (%)	29.7%	25.4%	21.5%	22.4%	24.2%
5a	CET1-Quote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	29.7%	25.4%	21.5%	22.4%	24.2%
6	Kernkapitalquote (%)	29.7%	25.4%	21.5%	22.4%	24.2%
6a	Kernkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	29.7%	25.4%	21.5%	22.4%	24.2%
7	Gesamtkapitalquote (%)	29.7%	25.4%	21.5%	22.4%	24.2%
7a	Gesamtkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	29.7%	25.4%	21.5%	22.4%	24.2%
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) (%)	21.7%	17.4%	13.5%	14.4%	16.2%
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)	542'265	651'065	678'804	707'799	679'823
14	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	4.6%	3.9%	3.7%	3.6%	3.7%
14a	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements) ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	4.6%	3.9%	3.7%	3.6%	3.7%
Liquiditätsquote (LCR)						
15	Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (CHF)	62'739	63'593	65'179	62'560	63'825
16	Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (CHF)	30'565	36'682	36'867	37'133	43'114
17	Liquiditätsquote, LCR (in %)	205.98%	174.32%	176.84%	168.8%	150.8%
Finanzierungsquote (NSFR)						
15	Verfügbare stabile Refinanzierung (in CHF)	264'653		312'129		321'627
16	Erforderliche stabile Refinanzierung (in CHF)	132'554		107'265		97'689
17	Finanzierungsquote, NSFR (in %)	199.7%		282%		329.2%

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 (Marktwertmethode). Die Bank ist als Gruppengesellschaft der Van Lanschot NV Gruppe von weiteren Eigenmittelfreistellungspflichten befreit. Entsprechende Angaben sind im Geschäftsbericht der Van Lanschot Kempen N.V. Gruppe zu finden.