

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)	27'077	27'077	27'077	27'077	25'137
1a	Hartes Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	27'077	27'077	27'077	27'077	25'137
2	Kernkapital (T1)	27'077	27'077	27'077	27'077	25'137
2a	Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	27'077	27'077	27'077	27'077	25'137
3	Gesamtkapital total	27'077	27'077	27'077	27'077	25'137
3a	Gesamtkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	27'077	27'077	27'077	27'077	25'137
Risikogewichtete Positionen (RWA) (CHF)						
4	RWA	76'237	61'063	64'553	61'651	84'522
4a	Mindesteigenmittel (CHF)	6'099	4'885	5'164	4'932	6'762
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)						
5	CET1-Quote (%)	35.5%	44.3%	41.9%	43.9%	29.7%
5a	CET1-Quote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	35.5%	44.3%	41.9%	43.9%	29.7%
6	Kernkapitalquote (%)	35.5%	44.3%	41.9%	43.9%	29.7%
6a	Kernkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	35.5%	44.3%	41.9%	43.9%	29.7%
7	Gesamtkapitalquote (%)	35.5%	44.3%	41.9%	43.9%	29.7%
7a	Gesamtkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	35.5%	44.3%	41.9%	43.9%	29.7%
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) (%)	27.5%	36.3%	33.9%	35.9%	21.7%
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)	393'535	383'071	432'159	433'888	542'265
14	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	6.9%	7.1%	6.3%	6.2%	4.6%
14a	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements) ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	6.9%	7.1%	6.3%	6.2%	4.6%
Liquiditätsquote (LCR)						
15	Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (CHF)	62'733	59'702	59'223	59'063	62'739
16	Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (CHF)	22'097	23'645	19'838	22'097	30'565
17	Liquiditätsquote, LCR (in %)	308.1%	270.3%	299.9%	270.2%	206.0%
Finanzierungsquote (NSFR)						
15	Verfügbare stabile Refinanzierung (in CHF)	127'404		170'225		264'653
16	Erforderliche stabile Refinanzierung (in CHF)	103'952		101'629		132'554
17	Finanzierungsquote, NSFR (in %)	122.6%		167.5%		199.7%

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 Eigenmittelloffenlegungspflichten befreit. Entsprechende Angaben sind im Geschäftsbericht der Van Lanschot Kempen N.V. Gruppe zu finden. Ab 01.07.2023 wendet die Bank ein Nettingagreement mit Van Lanschot Kempen N.V. an.