

27.04.2018

# Ergebnisdaten der Datenerhebung zur Ermittlung global systemrelevanter Institute per 31.12.2017

**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 31.12.2017.

Diese Datenerhebung wird vom Basler 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.<sup>1</sup>

Die Offenlegung der Ergebnisse erfolgt im Einklang mit der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1030/2014 der Europäischen Kommission vom 29. September 2014<sup>2</sup> unter Berücksichtigung der Detailanpassungen im aktuellen Meldebogen.

Die Ergebnisdaten sind Gegenstand einer planmäßigen Überprüfung durch die Aufsicht und können gegebenenfalls Korrekturen erfahren.

Die DZ BANK Gruppe wird derzeit nicht als global systemrelevant eingestuft.

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 Basler Instruktionen für diese Datenerhebung Einfluss auf die Endergebnisse haben, so dass diese zum Teil nicht uneingeschränkt mit den offengelegten Vorjahreswerten vergleichbar sind.

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.

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

<sup>2</sup> 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 31.12.2017

#### Allgemeine Bankdaten

##### Abschnitt 1: Allgemeine Informationen

(1) Datum der Meldung (JJJJ-MM-TT)	2017-12-31
(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	6.390.546.364
(2) Angepasster Nominalwert aus Kreditderivatkontrakten	3.922.278.922
(3) Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert aus Derivatkontrakten	9.482.444.266
b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFTs)	
(1) Angepasster Risikopositionswert aus SFTs	10.243.663.683
(2) Gegenparteiausfallrisiken aus SFTs	343.918.390
c. Sonstige Vermögenswerte	380.331.365.617
d. Risikopositionswert aus außerbilanziellen Positionen	
(1) Positionen mit einem Kreditkonversionsfaktor (CCF) von 0%	20.197.145.468
(2) Positionen mit einem CCF von 20%	9.778.206.195
(3) Positionen mit einem CCF von 50%	25.079.227.264
(4) Positionen mit einem CCF von 100%	5.674.309.284
e. Regulatorische Anpassungen	799.646.539
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)	432.903.495.944

## Indikatoren für Verflechtungen

<b>Abschnitt 3: Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel	95.855.144.854
(1)	Einlagezertifikate	194.950.432
b.	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	21.644.431.529
c.	Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände:	
(1)	Besicherte Schuldverschreibungen	9.779.234.574
(2)	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	14.503.638.441
(3)	Nachrangige Schuldverschreibungen	280.557.085
(4)	Geldmarktpapiere	78.670.376
(5)	Beteiligungspapiere	2.127.076.913
(6)	In Verbindung mit den unter Position 3c)5) bestimmten Beteiligungspapierbeständen aufgerechnete Short-Positionen	10.139.704
d.	Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	381.173.407
e.	Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Nettozeitwert	
(1)	Positiver beizulegender Nettozeitwert	5.344.967.814
(2)	Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert	2.353.809.211
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))	152.338.564.500

<b>Abschnitt 4: Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Finanzmittel, die von anderen Finanzinstituten hinterlegt von diesen geliehen wurden	
(1)	Einlagen durch Verwahrstellen	52.635.587.732
(2)	Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	33.163.984.063
(3)	Erhaltene Darlehen von anderen Finanzinstituten	87.817.286.791
b.	Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden	387.947.908
c.	Aktuelle negative Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten	1.773.248.700
d.	OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert:	
(1)	Negativer beizulegender Nettozeitwert	1.828.975.423
(2)	Potenziell künftiger Wiederbeschaffungswert	1.857.790.298
e.	Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4.a bis 4.d.(2))	179.464.820.915

<b>Abschnitt 5: Ausstehende Wertpapiere</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Besicherte Schuldverschreibungen	30.789.540.120
b.	Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	44.321.187.489
c.	Nachrangige Schuldverschreibungen	2.562.246.404
d.	Geldmarktpapiere	4.554.969.792
e.	Einlagezertifikate	7.865.168.945
f.	Eigenkapital	18.251.544.446
g.	Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5.c nicht erfasst sind	312.732.390
h.	Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5.a bis 5.g)	108.657.389.586

### Indikatoren für Ersetzbarkeit/Finanzinfrastruktur

<b>Abschnitt 6: Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen (ausgenommen Zahlungen innerhalb der Gruppe)</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Australischen Dollar (AUD)	8.891.071.173
b.	Brasilianischen Real (BRL)	334.463.362
c.	Kanadischen Dollar (CAD)	7.326.315.492
d.	Schweizer Franken (CHF)	388.001.708.929
e.	Chinesischen Yuan (CNY)	539.682.149
f.	Euro (EUR)	5.801.067.248.342
g.	Britischen Pfund (GBP)	56.133.128.960
h.	Hongkong-Dollar (HKD)	12.018.251.093
i.	Indischen Rupien (INR)	339.133.005
j.	Japanischen Yen (JPY)	20.319.722.159
k.	Mexican pesos (MXN)	8.836.049.490
l.	Schwedischen Kronen (SEK)	9.000.318.104
m.	US-Dollar (USD)	380.076.969.099
n.	Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.l)	6.692.884.061.357

<b>Abschnitt 7: Custody-Vermögen</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Indikator für Custody-Vermögen	936.047.503.868

<b>Abschnitt 8: Übernommene Transaktionen an Fremd- und Eigenkapitalmärkten</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Aktienemissionsgeschäfte	4.020.720
b.	Anleihenemissionsgeschäfte	17.101.310.000
c.	Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b)	17.105.330.720

## Indikatoren für Komplexität

<b>Abschnitt 9: Nominalwert außerbörslich gehandelter (OTC-)Derivate</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate	550.693.027.360
b.	bilateral abgewickelte OTC-Derivate	582.895.883.978
c.	Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9.a und 9.b)	1.133.588.911.338

<b>Abschnitt 10: Wertpapiere des Handelsbestands und zur Veräußerung verfügbare Wertpapiere</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Wertpapiere des Handelsbestands (HFT)	19.823.293.526
b.	Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere	39.007.853.506
c.	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen	33.116.688.659
d.	Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen	8.496.802.567
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)	17.217.655.806

<b>Abschnitt 11: Vermögenswerte der Stufe 3</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3	3.421.578.033

## Indikatoren für rechtsräumeübergreifende Geschäfte

<b>Abschnitt 12: Rechtsräumeübergreifende Forderungen</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Indikator für rechtsräumeübergreifende Forderungen	79.266.313.334

<b>Abschnitt 13: Rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten</b>		<b>Betrag in EUR</b>
a.	Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)	43.243.934.564
(1)	Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13.a	20.796.671.525
b.	Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäfte)	9.072.363.217
c.	Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13.a und 13.b, abzüglich 13.a.(1))	31.519.626.256