

# KENNZAHLEN

## OFFENLEGUNG GEMÄSS FINMA-RS 2016/01

in 1'000 CHF und in %

|   | T= Quartal   | a<br>T  | b<br>T-1 | c<br>T-2 | d<br>T-3 | e<br>T-4 |
|---|--|---------|----------|----------|----------|----------|
| <b>Anrechenbare Eigenmittel (CHF)</b>                         |  |         |          |          |          |          |
| 1   | Hartes Kernkapital (CET1)  | 23'423  | 23'368   | 23'368   | 23'368   | 23'368   |
| 1a  | Hartes Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste  | 23'423  | 23'368   | 23'368   | 23'368   | 23'368   |
| 2   | Kernkapital (T1)   | 23'423  | 23'368   | 23'368   | 23'368   | 23'368   |
| 2a  | Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste   | 23'423  | 23'368   | 23'368   | 23'368   | 23'368   |
| 3   | Gesamtkapital total  | 23'423  | 23'368   | 23'368   | 23'368   | 23'368   |
| 3a  | Gesamtkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste   | 23'423  | 23'368   | 23'368   | 23'368   | 23'368   |
| <b>Risikogewichtete Positionen (RWA) (CHF)</b>                |  |         |          |          |          |          |
| 4   | RWA  | 130'360 | 146'987  | 152'117  | 129'343  | 118'066  |
| 4a  | Mindesteigenmittel (CHF)   | 10'909  | 11'759   | 12'169   | 10'347   | *10'000  |
| <b>Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)</b>            |  |         |          |          |          |          |
| 5   | CET1-Quote (%)   | 17.18%  | 15.90%   | 15.36%   | 18.07%   | 19.79%   |
| 5a  | CET1-Quote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)  | 17.18%  | 15.90%   | 15.36%   | 18.07%   | 19.79%   |
| 6   | Kernkapitalquote (%)   | 17.18%  | 15.90%   | 15.36%   | 18.07%   | 19.79%   |
| 6a  | Kernkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)  | 17.18%  | 15.90%   | 15.36%   | 18.07%   | 19.79%   |
| 7   | Gesamtkapitalquote (%)   | 17.18%  | 15.90%   | 15.36%   | 18.07%   | 19.79%   |
| 7a  | Gesamtkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)  | 17.18%  | 15.90%   | 15.90%   | 18.07%   | 19.79%   |
| <b>CET1-Pufferanforderungen (in % der RWA)</b>                |  |         |          |          |          |          |
| 8   | Eigenmittelpuffer nach Basler Mindeststandards (2.5% ab 2019) (%)  | 2.50%   | 2.50%    | 2.50%    | 2.50%    | 2.50%    |
| 9   | Antizyklischer Puffer (Art. 44a ERV) nach Basler Mindeststandards (%)  | 0.00%   | 0.00%    | 0.00%    | 0.00%    | 0.00%    |
| 10  | Zusätzlicher Eigenmittelpuffer wegen internationaler oder nationaler Systemrelevanz (%)  | 0.00%   | 0.00%    | 0.00%    | 0.00%    | 0.00%    |
| 11  | Gesamte Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards in CET1-Qualität (%)  | 2.50%   | 2.50%    | 2.50%    | 2.50%    | 2.50%    |
| 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) (%) | 9.92%   | 7.9%     | 7.36%    | 10.07%   | 11.79%   |
| <b>Kapitalzielquoten nach Anhang 8 der ERV (in % der RWA)</b> |  |         |          |          |          |          |
| 12a   | Eigenmittelpuffer gemäss Anhang 8 ERV (%)  | 2.50%   | 2.50%    | 2.50%    | 2.50%    | 2.50%    |
| 12b   | Antizyklische Puffer (Art. 44 und 44a ERV) (%)   | 0.00%   | 0.00%    | 0.00%    | 0.00%    | 0.00%    |
| 12c   | CET1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 der ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV   | 7.00%   | 7.00%    | 7.00%    | 7.00%    | 7.00%    |
| 12d   | T1-Zielquote in (%) gemäss Anhang 8 der ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV   | 8.50%   | 8.50%    | 8.50%    | 8.50%    | 8.50%    |
| 12e   | Gesamtkapital-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 der ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV  | 10.50%  | 10.50%   | 10.50%   | 10.50%   | 10.50%   |
| <b>Basel III Leverage Ratio</b>                               |  |         |          |          |          |          |
| 13  | Gesamtengagement (CHF)   | 624'768 | 664'592  | 658'124  | 604'023  | 605'378  |
| 14  | Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)  | 3.75%   | 3.52%    | 3.55%    | 3.87%    | 3.86%    |
| 14a   | Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements) ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste   | 3.75%   | 3.52%    | 3.55%    | 3.87%    | 3.86%    |
| <b>Liquiditätsquote (LCR)</b>                                 |  |         |          |          |          |          |
| 15  | Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (CHF)  | 53'780  | 52'281   | 48'557   | 45'773   | 44'793   |
| 16  | Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (CHF)   | 38'934  | 43'190   | 42'285   | 32'388   | 30'245   |
| 17  | Liquiditätsquote, LCR (in %)   | 140.01% | 121.47%  | 115.28%  | 141.77%  | 148.18%  |

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.

\*Ausweis gemäss Art. 15 und 16 BankV, Die Mindesteigenmittel entsprechen der Mindesteigenmittelvorgabe von CHF 10 Mio. und nicht 8 % der RWA, da dieser Wert tiefer wäre.