

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)	30'010	30'010	30'010	30'010	27'077
1a	Hartes Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	30'010	30'010	30'010	30'010	27'077
2	Kernkapital (T1)	30'010	30'010	30'010	30'010	27'077
2a	Kernkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	30'010	30'010	30'010	30'010	27'077
3	Gesamtkapital total	30'010	30'010	30'010	30'010	27'077
3a	Gesamtkapital ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	30'010	30'010	30'010	30'010	27'077
Risikogewichtete Positionen (RWA) (CHF)						
4	RWA	61'199	63'492	60'385	64'282	76'237
4a	Mindesteigenmittel (CHF)	4'896	5'079	4'831	5'143	6'099
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)						
5	CET1-Quote (%)	49.0%	47.3%	49.7%	46.7%	35.5%
5a	CET1-Quote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	49.0%	47.3%	49.7%	46.7%	35.5%
6	Kernkapitalquote (%)	49.0%	47.3%	49.7%	46.7%	35.5%
6a	Kernkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	49.0%	47.3%	49.7%	46.7%	35.5%
7	Gesamtkapitalquote (%)	49.0%	47.3%	49.7%	46.7%	35.5%
7a	Gesamtkapitalquote ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste (%)	49.0%	47.3%	49.7%	46.7%	35.5%
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) (%)	41.0%	39.3%	41.7%	38.7%	27.5%
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)	365'681	365'133	374'770	407'600	393'535
14	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	8.2%	8.2%	8.0%	7.4%	6.9%
14a	Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements) ohne Auswirkung von Übergangsbestimmungen für erwartete Verluste	8.2%	8.2%	8.0%	7.4%	6.9%
Liquiditätsquote (LCR)						
15	Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (CHF)	52'913	56'566	57'710	59'547	62'733
16	Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (CHF)	15'270	9'675	13'891	25'763	22'097
17	Liquiditätsquote, LCR (in %)	374.7%	602.8%	456.8%	360.8%	308.1%
Finanzierungsquote (NSFR)						
15	Verfügbare stabile Refinanzierung (in CHF)	182'305		196'918		127'404
16	Erforderliche stabile Refinanzierung (in CHF)	115'145		110'329		103'952
17	Finanzierungsquote, NSFR (in %)	158.3%		178.5%		122.6%

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.