



Die Eiche. Ihr langsames  
Wachstum führt zu der  
besonderen Dichte und  
Stabilität ihres Holzes.

**Gewachsene Stabilität.**  
Ergebnisdaten der quantitativen  
Analyse zur Bestimmung global  
systemrelevanter Institute 2016.

# Ergebnisdaten der quantitativen Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute zum 31. Dezember 2016.

Die Aufsicht bestimmt mindestens jährlich, welche Institute auf Grundlage einer quantitativen Analyse auf konsolidierter Ebene als global systemrelevant einzustufen sind. Bei dieser Analyse werden gemäß § 10f Absatz 2 KWG folgende Faktoren berücksichtigt:

- Größe der Gruppe
- grenzüberschreitende Aktivitäten der Gruppe
- Vernetztheit der Gruppe mit dem Finanzsystem
- Ersetzbarkeit hinsichtlich der angebotenen Dienstleistungen und Finanzinfrastruktureinrichtungen der Gruppe
- Komplexität der Gruppe.

Die vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht (Basel Committee on Banking Supervision, BCBS) geforderte quantitative Analyse zur Bestimmung global systemrelevanter Institute basiert auf der Durchführungsverordnung (EU) Nr. 1030/2014 der EU-Kommission vom 29. September 2014 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards in Bezug auf einheitliche Formate und Daten für die Offenlegung der Werte zur Bestimmung global systemrelevanter Institute gemäß CRR.

Die Landesbank Baden-Württemberg wird derzeit nicht als global systemrelevant eingestuft.

Die in der nachfolgenden Abbildung dargestellten Indikatoren zum Stichtag 31. Dezember 2016 wurden anhand der vom Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht veröffentlichten »Instructions for the end – 2016 G – SIB assessment exercise«, Stand 16. Januar 2017, ermittelt.

<b>Abschnitt 1: Allgemeine Informationen</b>	
<b>a. Allgemeine, von der nationalen Aufsichtsbehörde bereitgestellte Angaben</b>	
(1) Ländercode	DE
(2) Name der Bank	LBBW
(3) Meldestichtag (yyyy-mm-dd)	2016-12-31
(4) Meldewährung	EUR
(5) Euro-Umrechnungskurs	1
(6) Datum der Übermittlung (yyyy-mm-dd)	2016-05-04
<b>b. Allgemeine, vom meldenden Institut bereitgestellte Angaben</b>	
(1) Meldeeinheit	1 000 000
(2) Rechnungslegungsstandard	IFRS
<b>Betrag</b>	
<b>Abschnitt 2: Indikator für die Gesamtrisikoposition</b>	
<b>a. Derivate</b>	
(1) Gegenparteien-Risiken aus Derivatkontrakten	11 936
(2) Angepasster Nominalbetrag geschriebener Kreditderivate	3 779
(3) Potenzielle zukünftige Forderungen aus Derivatkontrakten	8 310
<b>b. Wertpapierfinanzierungsgeschäfte</b>	
(1) Angepasster Bruttowert von Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)	20 780
(2) Gegenparteien-Risiken aus SFT	4 690
<b>c. Sonstige Vermögenswerte</b>	
<b>d. Bruttonominalwert außerbilanzieller Positionen</b>	
(1) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem Kreditkonversionsfaktor (CCF) von 0 %	15 990
(2) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 20 %	3 781
(3) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 50 %	27 119
(4) Nominalwert außerbilanzieller Positionen mit einem CCF von 100 %	804
<b>e. Regulatorische Anpassungen</b>	
<b>f. Indikator für die Gesamtrisikoposition (Summe aus den Positionen 2.a.(1) bis 2.c., dem 0,1-Fachen von 2.d.(1), dem 0,2-Fachen von 2.d.(2), dem 0,5-Fachen 2.d.(3), und 2.d.(4))</b>	
	253 745
<b>Abschnitt 3: Indikator für Vermögenswerte innerhalb des Finanzsystems</b>	
<b>a. Bei anderen Finanzinstituten hinterlegte oder diesen geliehene Geldmittel</b>	
(1) Einlagezertifikate	52 243
(1) Einlagezertifikate	1 180
<b>b. Zugesagte aber nicht gezogene Kreditlinien, die anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden</b>	
	13 272
<b>c. Von anderen Finanzinstituten emittierte Wertpapierbestände</b>	
(1) Besicherte Schuldverschreibungen	2 977
(2) Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen	10 560
(3) Nachrangige Schuldverschreibungen	26
(4) Geldmarktpapiere	330
(5) Aktien	473
(6) In Verbindung mit den unter Position 3.c.(5) bestimmten Aktienbeständen aufgerechneten Short-Positionen	215
<b>d. Aktuelle positive Nettorisikoposition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten</b>	
	4 335
<b>e. Außerbörslich gehandelte (OTC-)Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem positiven beizulegenden Zeitwert</b>	
(1) Positiver beizulegender Zeitwert	2 545
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	2 138
<b>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))</b>	
	88 682
<b>Abschnitt 4: Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems</b>	
<b>a. Von anderen Finanzinstituten hinterlegte oder von diesen geliehene Geldmittel</b>	
(1) Einlagen durch Verwahrstellen	53 075
(2) Einlagen durch Finanzinstitute, die keine Verwahrstellen sind	16 834
(3) Von anderen Finanzinstituten erhaltene Mittel	1 545
<b>b. Zugesagte, aber nicht gezogene Kreditlinien, die von anderen Finanzinstituten eingeräumt wurden</b>	
	222
<b>c. Aktuelle negative Nettosition aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften mit anderen Finanzinstituten</b>	
	883
<b>d. OTC-Derivate mit anderen Finanzinstituten mit einem negativen beizulegenden Nettozeitwert</b>	
(1) Negativer beizulegender Zeitwert	2 849
(2) Potenzielle zukünftige Forderungen	4 323
<b>e. Indikator für Verbindlichkeiten innerhalb des Finanzsystems (Summe aus den Positionen 4.a.(1) bis 4.d.(2))</b>	
	79 732
<b>Abschnitt 5: Indikator für ausstehende Wertpapiere</b>	
<b>a. Besicherte Schuldverschreibungen</b>	
	13 389
<b>b. Vorrangige, unbesicherte Schuldverschreibungen</b>	
	20 558
<b>c. Nachrangige Schuldverschreibungen</b>	
	3 327
<b>d. Geldmarktpapiere</b>	
	6 005
<b>e. Einlagezertifikate</b>	
	3 273

f. Eigenkapital	0
g. Vorzugsaktien und jede andere Form nachrangiger Finanzierungen, die unter Position 5.c nicht erfasst sind	0
h. Indikator für ausstehende Wertpapiere (Summe aus den Positionen 5.a bis 5.g)	46 553
<b>Abschnitt 6: Indikator für Zahlungsaktivität</b>	
Im Berichtsjahr geleistete Zahlungen in:	
a. Australischen Dollar	14 002
b. Brasilianischen Real	0
c. Kanadischen Dollar	23 453
d. Schweizer Franken	349 493
e. Chinesischen Yuan	9 753
f. Euro	2 049 250
g. Britischen Pfund	346 588
h. Hongkong-Dollar	7 964
i. Indischen Rupien	9
j. Japanischen Yen	12 924
k. Schwedischen Kronen	10 989
l. US-Dollar	1 716 370
m. Indikator für Zahlungsaktivität (Summe aus den Positionen 6.a bis 6.l)	4 540 796
<b>Abschnitt 7: Indikator für Custody-Vermögen</b>	
	283 330
<b>Abschnitt 8: Indikator für Emissionsgeschäfte</b>	
a. Aktienemissionsgeschäfte	7
b. Anleihenemissionsgeschäfte	26 143
c. Indikator für Emissionsgeschäfte (Summe aus den Positionen 8.a und 8.b)	26 150
<b>Abschnitt 9: Indikator für OTC-Derivate</b>	
a. Über eine zentrale Gegenpartei abgewickelte OTC-Derivate	785 499
b. Bilateral abgewickelte OTC-Derivate	745 044
c. Indikator für OTC-Derivate (Summe aus den Positionen 9.a und 9.b)	1 530 543
<b>Abschnitt 10: Indikator für Wertpapiere des Handelsbestands und (AfS)-Wertpapiere</b>	
a. Wertpapiere des Handelsbestands	10 314
b. Zur Veräußerung verfügbare (AfS-)Wertpapiere	19 384
c. Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 1 entsprechen	12 476
d. Wertpapiere des Handelsbestands und AfS-Wertpapiere, die der Definition von Vermögenswerten der Stufe 2 entsprechen, zzgl. Risikoaufschlägen	2 376
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)	14 846
<b>Abschnitt 11: Indikator für Vermögenswerte der Stufe 3</b>	
	2 185
<b>Abschnitt 12: Indikator für rechtsräumeübergreifende Forderungen</b>	
	66 817
<b>Abschnitt 13: Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten</b>	
a. Auslandsverbindlichkeiten (ausgenommen Derivate und Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung)	32 534
(1) Alle Auslandsverbindlichkeiten gegenüber verbundenen Niederlassungen unter Position 13.a	16 343
b. Inlandsverbindlichkeiten in Landeswährung (ausgenommen Derivategeschäften)	18 810
c. Indikator für rechtsräumeübergreifende Verbindlichkeiten (Summe aus den Positionen 13.a und 13.b, abzüglich 13.a.(1))	35 001

Abbildung: Ergebnisdaten der quantitativen Analyse für global systemrelevante Institute.

**Landesbank Baden-Württemberg**

Hauptsitze

**Stuttgart**

70144 Stuttgart  
Am Hauptbahnhof 2  
70173 Stuttgart  
Telefon 0711 127-0  
Telefax 0711 127-43544  
[www.LBBW.de](http://www.LBBW.de)  
[kontakt@LBBW.de](mailto:kontakt@LBBW.de)

**Karlsruhe**

76245 Karlsruhe  
Ludwig-Erhard-Allee 4  
76131 Karlsruhe  
Telefon 0721 142-0  
Telefax 0721 142-23012  
[www.LBBW.de](http://www.LBBW.de)  
[kontakt@LBBW.de](mailto:kontakt@LBBW.de)

**Mannheim**

Postfach 10 03 52  
68003 Mannheim  
Augustaanlage 33  
68165 Mannheim  
Telefon 0621 428-0  
Telefax 0621 428-72591  
[www.LBBW.de](http://www.LBBW.de)  
[kontakt@LBBW.de](mailto:kontakt@LBBW.de)

**Mainz**

55098 Mainz  
Große Bleiche 54 – 56  
55116 Mainz  
Telefon 06131 64-37800  
Telefax 06131 64-35701  
[www.LBBW.de](http://www.LBBW.de)  
[kontakt@LBBW.de](mailto:kontakt@LBBW.de)