

M.M.Warburg & CO - Disclaimer

DISCLAIMER:

Dieses Dokument dient ausschließlich der allgemeinen Information über die M.M.Warburg Finanzholding Gruppe.

Die Informationen stellen weder eine Anlage- oder sonstige Beratung noch eine Aufforderung zur Teilnahme an einem Anlagegeschäft dar.

Dieses Dokument stellt weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Kauf von Wertpapieren oder anderen Anlagen oder Finanzprodukten dar. Die in diesem Dokument enthaltenen Informationen lassen aufgrund der in der Vergangenheit erzielten Ergebnisse keine verlässlichen Rückschlüsse auf die zukünftige Entwicklung zu.

Die M.M.Warburg Finanzholding Gruppe gibt keine ausdrückliche oder stillschweigende Zusicherung in Bezug auf die Richtigkeit, Zuverlässigkeit oder Vollständigkeit der in diesem Dokument enthaltenen Informationen. Die M.M.Warburg Finanzholding Gruppe lehnt jede ausdrückliche oder stillschweigende Gewährleistung in Bezug auf die hierin enthaltenen Informationen ab.

Die M.M.Warburg Finanzholding Gruppe oder mit ihr verbundene Unternehmen haften in keinem Fall für Verluste, Schäden, Kosten oder sonstige Aufwendungen jeglicher Art (einschließlich, aber nicht beschränkt auf direkte, indirekte, Folge- oder Sonderschäden oder entgangenen Gewinn), die sich aus oder im Zusammenhang mit der Verwendung der in diesem Dokument enthaltenen Informationen oder mit Handlungen ergeben, die im Vertrauen auf diese Informationen vorgenommen wurden. Die M.M.Warburg Finanzholding Gruppe übernimmt keine Verpflichtung, die in diesem Dokument enthaltenen Informationen zu aktualisieren. Der Inhalt dieses Dokuments darf nicht als Ersatz für eine professionelle Beratung angesehen werden.

Inhaltsverzeichnis

[Disclaimer](#)

EU LI1	Unterschiede zwischen dem Konsolidierungskreis für Rechnungslegungszwecke und dem aufsichtlichen Konsolidierungskreis und Zuordnung (Mapping) von Abschlusskategorien zu aufsichtsrechtlichen Risikokategorien
EU LI2	Hauptursachen für Unterschiede zwischen aufsichtsrechtlichen Risikopositionsbeträgen und Buchwerten im Jahresabschluss
EU PV1	Anpassungen aufgrund des Gebots der vorsichtigen Bewertung (PVA)
EU CC1	Zusammensetzung der aufsichtsrechtlichen Eigenmittel
EU CC2	Abstimmung der aufsichtsrechtlichen Eigenmittel mit der in den geprüften Abschlüssen enthaltenen Bilanz
EU CCA1	Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten
EU CCA2	Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals (AT1)
EU CCA3	Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten Instrumente des Ergänzungskapitals
EU OV1	Übersicht über die Gesamtrisikobeträge
EU CCR1	Analyse der CCR-Risikoposition nach Ansatz
EU CCR2	Eigenmittelanforderungen für das CVA-Risiko
EU CCR3	Standardansatz – CCR-Risikopositionen nach regulatorischer Risikopositionsklasse und Risikogewicht
EU CCR5	Zusammensetzung der Sicherheiten für CCR-Risikopositionen
EU CCR8	Risikopositionen gegenüber zentralen Gegenparteien (CCPs)
EU CCyB1	Geografische Verteilung der für die Berechnung des antizyklischen Kapitalpuffers wesentlichen Kreditrisikopositionen
EU CCyB2	Höhe des institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffers
EU CR1	Vertragsgemäß bediente und notleidende Risikopositionen und damit verbundene Rückstellungen
EU CR1-A	Restlaufzeit von Risikopositionen
EU CR2	Veränderung des Bestands notleidender Darlehen und Kredite
EU CQ1	Kreditqualität gestundeter Risikopositionen
EU CQ3	Kreditqualität vertragsgemäß bedienter und notleidender Risikopositionen nach Überfälligkeit in Tagen
EU CQ4	Qualität notleidender Risikopositionen nach geografischem Gebiet
EU CQ5	Kreditqualität von Darlehen und Kredite an nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften nach Wirtschaftszweig
EU AE1	Belastete und unbelastete Vermögenswerte
EU AE2	Entgegengenommene Sicherheiten und begebene eigene Schuldverschreibungen
EU AE3	Belastungsquellen
EU CR4	Standardansatz – Kreditrisiko und Wirkung der Kreditrisikominderung
EU CR5	Standardansatz
EU MR1	Marktrisiko beim Standardansatz
EU OR1	Eigenmittelanforderungen für das operationelle Risiko und risikogewichtete Positionsbeträge
EU KM1	Schlüsselparameter
EU IRRBB1	Zinsrisiken bei Geschäften des Anlagebuchs
EU LR1	LRSum – Summarische Abstimmung zwischen bilanzierten Aktiva und Risikopositionen für die Verschuldungsquote
EU LR2	LRCom – Einheitliche Offenlegung der Verschuldungsquote
EU LR3	LRSpl – Aufgliederung der bilanzwirksamen Risikopositionen
EU LIQ1	Quantitative Angaben zur LCR
EU LIQ2 31.12	Strukturelle Liquiditätsquote
EU LIQ2 30.09	Strukturelle Liquiditätsquote
EU LIQ2 30.06	Strukturelle Liquiditätsquote
EU LIQ2 31.03	Strukturelle Liquiditätsquote
EU CR3	Übersicht über Kreditrisikominderungstechniken: Offenlegung der Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken
EU REM1	Für das Geschäftsjahr gewährte Vergütung
EU REM2	Sonderzahlungen an Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Instituts haben (identifizierte Mitarbeiter)
EU REM4	Vergütungen von 1 Mio. EUR oder mehr pro Jahr
EU REM5	Angaben zur Vergütung der Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Instituts haben (identifizierte Mitarbeiter)
REM-InstitutsVergV	Gesamtvergütung für alle Mitarbeiter gem. § 16 Abs. 2 InstitutsVergV

**Meldebogen EU LI1 - Unterschiede zwischen dem Konsolidierungskreis für Rechnungslegungszwecke und dem aufsichtlichen Konsolidierungskreis und Zuordnung (Mapping)
von Abschlusskategorien zu aufsichtsrechtlichen Risikokategorien**

31.12.2022

		a	b	c	d	Buchwerte der Posten, die		g
in Mio. EUR		Buchwerte gemäß veröffentlichtem Jahresabschluss	Buchwerte gemäß aufsichtlichem Konsolidierungskreis	dem Kreditrisikorahmen unterliegen	dem CCR-Rahmen unterliegen	dem Verbriefungsrahmen unterliegen	dem Marktrisikorahmen unterliegen	keinen Eigenmittelanforderungen unterliegen oder die Eigenmittelabzügen unterliegen
Aufschlüsselung nach Aktivaklassen gemäß Bilanz im veröffentlichten Jahresabschluss								
1	Barreserve	106,28	106,27	106,27	---	---	---	---
2	Forderungen an Kreditinstitute	1.125,00	1.124,47	1.124,47	---	---	74,83	---
3	Forderungen an Kunden	2.145,85	2.145,89	2.145,89	---	---	29,79	---
4	Schuldverschreibungen und andere festverzinsliche Wertpapiere	2.020,17	2.020,17	2.020,17	---	---	---	---
5	Aktien und andere nicht festverzinsliche Wertpapiere	18,63	18,63	18,63	---	---	---	---
6	Handelsbestand	41,63	41,63	---	38,72	---	10,39	---
7	Beteiligungen	47,53	47,53	47,53	---	---	---	---
8	Anteile an verbundenen Unternehmen	0,08	5,13	5,13	---	---	---	---
9	Treuhandvermögen	269,00	269,00	---	---	---	---	269,00
10	Immaterielle Anlagenwerte	13,13	13,11	---	---	---	---	13,11
11	Sachanlagen	92,32	92,29	92,29	---	---	82,20	---
12	Sonstige Vermögensgegenstände	123,64	123,04	35,84	---	---	27,88	67,18
13	Rechnungsabgrenzungsposten	4,67	4,54	4,54	---	---	---	---
14	Aktive latente Steuern	0,00	---	---	---	---	---	---
15	Aktiva insgesamt	6.007,92	6.011,92	5.600,76	38,72	---	225,10	349,28
Aufschlüsselung nach Passivaklassen gemäß Bilanz im veröffentlichten Jahresabschluss								
1	Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstitute	203,26	203,29	---	---	---	52,47	150,81
2	Verbindlichkeiten gegenüber Kunden	4.420,31	4.424,59	---	---	---	1.049,55	3.375,04
3	Verbriefte Verbindlichkeiten	391,95	391,95	---	---	---	---	391,95
4	Handelsbestand	49,65	49,65	---	45,78	---	43,76	5,89
5	Treuhandverbindlichkeiten	269,00	269,00	---	---	---	---	269,00
6	Sonstige Verbindlichkeiten	151,37	151,26	---	---	---	0,18	151,08
7	Rechnungsabgrenzungsposten	2,93	2,69	---	---	---	---	2,69
8	Rückstellungen	146,90	145,48	---	---	---	---	145,48
9	Nachrangige Verbindlichkeiten	128,50	128,50	---	---	---	---	128,50
10	Fonds für allgemeine Bankrisiken	4,15	4,15	---	---	---	---	4,15
11	Eigenkapital	239,89	241,36	---	---	---	---	241,36
12	Passiva insgesamt	6.007,92	6.011,92	---	45,78	---	1.145,96	4.865,96

**Meldebogen EU LI2 - Hauptursachen für Unterschiede zwischen aufsichtsrechtlichen Risikopositionsbeträgen und Buchwerten im Jahresabschluss
31.12.2022**

in Mio. EUR		a	b	c	d	e
		Gesamt	Kredit- risikorahmen	Verbriefungs- rahmen	CCR-Rahmen	Marktrisiko- rahmen
1	Buchwert der Aktiva im aufsichtlichen Konsolidierungskreis (laut Meldebogen LI1)	5.662,64	5.600,76	---	38,72	225,10
2	Buchwert der Passiva im aufsichtlichen Konsolidierungskreis (laut Meldebogen LI1)	1.145,96	---	---	45,78	1.145,96
3	Gesamtnettobetrag im aufsichtlichen Konsolidierungskreis	4.516,68	5.600,76	---	-7,06	-920,86
4	Außerbilanzielle Beträge	972,12	972,12	---	---	
5	<i>Unterschiede in den Bewertungen</i>	---	-0,09	---	---	
6	<i>Unterschiede durch abweichende Nettingregeln außer den in Zeile 2 bereits berücksichtigten</i>	---	---	---	---	
7	<i>Unterschiede durch die Berücksichtigung von Rückstellungen</i>	---	6,01	---	---	
8	<i>Unterschiede durch Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken (CRMs)</i>	---	-132,95	---	-264,62	
9	<i>Unterschiede durch Kreditumrechnungsfaktoren</i>	---	-388,91	---	---	
10	<i>Unterschiede durch Verbriefung mit Risikotransfer</i>	---	---	---	---	
11	<i>Sonstige Unterschiede</i>	---	-16,94	---	609,22	
12	Für aufsichtsrechtliche Zwecke berücksichtigte Risikopositionsbeträge	6.416,84	6.039,99	---	337,54	39,31

Meldebogen **EU PV1** – Anpassungen aufgrund des Gebots der vorsichtigen Bewertung (PVA)
31.12.2022

		a	b	c	d	e	EU e1	EU e2	f	g	h
in Mio. EUR	Risikokategorie	Kategoriespezifische AVA – Bewertungsunsicherheiten		Kategorie- spezifischer Gesamtwert nach Diversifizierung		Davon: Gesamt- betrag Kern- konzept im Handelsbuch		Davon: Gesamtbe- trag Kernkonzept im Anlagebuch			
Kategoriespezifische AVA	Eigenkapitalposi- tionsrisiko	Zinsänderungs- risiko	Währungsrisiko	Kreditrisiko	Warenpositions- risiko	AVA für noch nicht eingenommene Kreditspreads	AVA für Investitions- und Finanzierungskosten				
1	Marktpreisunsicherheit	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
2	Entfällt										
3	Glattstellungskosten	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
4	Konzentrierte Positionen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
5	Vorzeitige Vertragsbeendigung	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
6	Modellrisiko	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
7	Operationelles Risiko	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
8	Entfällt										
9	Entfällt										
10	Künftige Verwaltungskosten	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
11	Entfällt										
12	Gesamtbetrag der zusätzlichen Bewertungsanpassungen (AVAs)							0,09	---	---	

Meldebogen EU CC1 - Zusammensetzung der aufsichtsrechtlichen Eigenmittel
31.12.2022

in Mio. EUR		a)	b)
		Beträge	Quelle nach Referenznummern/-buchstaben der Bilanz im aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis
Hartes Kernkapital (CET1): Instrumente und Rücklagen			
1	Kapitalinstrumente und das mit ihnen verbundene Agio	119,93	A
	davon: GmbH-Anteile	119,93	A
2	Einbehaltene Gewinne	---	*1
3	Kumuliertes sonstiges Ergebnis (und sonstige Rücklagen)	76,78	B + C
EU-3a	Fonds für allgemeine Bankrisiken	4,15	E
4	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 484 Absatz 3 CRR zuzüglich des damit verbundenen Agios, dessen Anrechnung auf das CET1 ausläuft	---	
5	Minderheitsbeteiligungen (zulässiger Betrag in konsolidiertem CET1)	21,70	D
EU-5a	Von unabhängiger Seite geprüfte Zwischengewinne, abzüglich aller vorhersehbaren Abgaben oder Dividenden	---	
6	Hartes Kernkapital (CET1) vor regulatorischen Anpassungen	222,56	
Hartes Kernkapital (CET1): regulatorische Anpassungen			
7	Zusätzliche Bewertungsanpassungen (negativer Betrag)	-0,09	
8	Immaterielle Vermögenswerte (verringert um entsprechende Steuerschulden) (negativer Betrag)	-13,11	F
9	Entfällt.		
10	Von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche mit Ausnahme jener, die aus temporären Differenzen resultieren (verringert um entsprechende Steuerschulden, wenn die Bedingungen nach Artikel 38 Absatz 3 CRR erfüllt sind) (negativer Betrag)	---	
11	Rücklagen aus Gewinnen oder Verlusten aus zeitwertbilanzierten Geschäften zur Absicherung von Zahlungsströmen für nicht zeitwertbilanzierte Finanzinstrumente	---	
12	Negative Beträge aus der Berechnung der erwarteten Verlustbeträge	---	
13	Anstieg des Eigenkapitals, der sich aus verbrieften Aktiva ergibt (negativer Betrag)	---	
14	Durch Veränderungen der eigenen Bonität bedingte Gewinne oder Verluste aus zum beizulegenden Zeitwert bewerteten eigenen Verbindlichkeiten	---	
15	Vermögenswerte aus Pensionsfonds mit Leistungszusage (negativer Betrag)	---	
16	Direkte, indirekte und synthetische Positionen eines Instituts in eigenen Instrumenten des harten Kernkapitals (negativer Betrag)	---	
17	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, die eine Überkreuzbeteiligung mit dem Institut eingegangen sind, die dem Ziel dient, dessen Eigenmittel künstlich zu erhöhen (negativer Betrag)	---	
18	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	---	
19	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	---	
20	Entfällt.		
EU-20a	Risikopositionsbetrag aus folgenden Posten, denen ein Risikogewicht von 1250 % zuzuordnen ist, wenn das Institut als Alternative jenen Risikopositionsbetrag vom Betrag der Posten des harten Kernkapitals abzieht	---	
EU-20b	davon: aus qualifizierten Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors (negativer Betrag)	---	
EU-20c	davon: aus Verbriefungspositionen (negativer Betrag)	---	
EU-20d	davon: aus Vorleistungen (negativer Betrag)	---	
21	Latente Steueransprüche, die aus temporären Differenzen resultieren (über dem Schwellenwert von 10 %, verringert um entsprechende Steuerschulden, wenn die Bedingungen von Artikel 38 Absatz 3 CRR erfüllt sind) (negativer Betrag)	---	
22	Betrag, der über dem Schwellenwert von 17,65 % liegt (negativer Betrag)	---	
23	davon: direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	---	
24	Entfällt.		
25	davon: latente Steueransprüche, die aus temporären Differenzen resultieren	---	
EU-25a	Verluste des laufenden Geschäftsjahres (negativer Betrag)	---	
EU-25b	Vorhersehbare steuerliche Belastung auf Posten des harten Kernkapitals, es sei denn, das Institut passt den Betrag der Posten des harten Kernkapitals in angemessener Form an, wenn eine solche steuerliche Belastung die Summe, bis zu der diese Posten zur Deckung von Risiken oder Verlusten dienen können, verringert (negativer Betrag)	---	
26	Entfällt.		
27	Betrag der von den Posten des zusätzlichen Kernkapitals in Abzug zu bringenden Posten, der die Posten des zusätzlichen Kernkapitals des Instituts überschreitet (negativer Betrag)	---	
27a	Sonstige regulatorische Anpassungen	-6,39	
28	Regulatorische Anpassungen des harten Kernkapitals (CET1) insgesamt	-19,59	
29	Hartes Kernkapital (CET1)	202,97	
Zusätzliches Kernkapital (AT1): Instrumente			
30	Kapitalinstrumente und das mit ihnen verbundene Agio	33,50	G
31	davon: gemäß anwendbaren Rechnungslegungsstandards als Eigenkapital eingestuft	---	
32	davon: gemäß anwendbaren Rechnungslegungsstandards als Passiva eingestuft	---	
33	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 484 Absatz 4 CRR zuzüglich des damit verbundenen Agios, dessen Anrechnung auf das zusätzliche Kernkapital ausläuft	---	
EU-33a	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 494a Absatz 1 CRR, dessen Anrechnung auf das zusätzliche Kernkapital ausläuft	---	
EU-33b	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 494b Absatz 1 CRR, dessen Anrechnung auf das zusätzliche Kernkapital ausläuft	---	
34	Zum konsolidierten zusätzlichen Kernkapital zählende Instrumente des qualifizierten Kernkapitals (einschließlich nicht in Zeile 5 enthaltener Minderheitsbeteiligungen), die von Tochterunternehmen begeben worden sind und von Drittparteien gehalten werden	8,30	G
35	davon: von Tochterunternehmen begebene Instrumente, deren Anrechnung ausläuft	---	
36	Zusätzliches Kernkapital (AT1) vor regulatorischen Anpassungen	41,80	
Zusätzliches Kernkapital (AT1): regulatorische Anpassungen			
37	Direkte, indirekte und synthetische Positionen eines Instituts in eigenen Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals (negativer Betrag)	---	
38	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, die eine Überkreuzbeteiligung mit dem Institut eingegangen sind, die dem Ziel dient, dessen Eigenmittel künstlich zu erhöhen (negativer Betrag)	---	
39	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	---	
40	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	---	
41	Entfällt.		

Meldebogen EU CC1 - Zusammensetzung der aufsichtsrechtlichen Eigenmittel
31.12.2022

in Mio. EUR		a)	b)
		Beträge	Quelle nach Referenznummern/-buchstaben der Bilanz im aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis
42	Betrag der von den Posten des Ergänzungskapitals in Abzug zu bringenden Posten, der die Posten des Ergänzungskapitals des Instituts überschreitet (negativer Betrag)	---	
42a	Sonstige regulatorische Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals	---	
43	Regulatorische Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals (AT1) insgesamt	---	
44	Zusätzliches Kernkapital (AT1)	41,80	
45	Kernkapital (T1 = CET1 + AT1)	244,77	
Ergänzungskapital (T2): Instrumente			
46	Kapitalinstrumente und das mit ihnen verbundene Agio	56,97	G
47	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 484 Absatz 5 CRR zuzüglich des damit verbundenen Agios, dessen Anrechnung auf das Ergänzungskapital nach Maßgabe von Artikel 486 Absatz 4 CRR ausläuft	---	
EU-47a	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 494a Absatz 2 CRR, dessen Anrechnung auf das Ergänzungskapital ausläuft	---	
EU-47b	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 494b Absatz 2 CRR, dessen Anrechnung auf das Ergänzungskapital ausläuft	---	
48	Zum konsolidierten Ergänzungskapital zählende qualifizierte Eigenmittelinstrumente (einschließlich nicht in Zeile 5 oder Zeile 34 dieses Meldebogens enthaltener Minderheitsbeteiligungen bzw. Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals), die von Tochterunternehmen begeben worden sind und von Drittparteien gehalten werden	12,30	G
49	davon: von Tochterunternehmen begebene Instrumente, deren Anrechnung ausläuft	---	
50	Kreditrisikoanpassungen	6,01	
51	Ergänzungskapital (T2) vor regulatorischen Anpassungen	75,28	
Ergänzungskapital (T2): regulatorische Anpassungen			
52	Direkte, indirekte und synthetische Positionen eines Instituts in eigenen Instrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangigen Darlehen (negativer Betrag)	---	
53	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangigen Darlehen von Unternehmen der Finanzbranche, die eine Überkreuzbeteiligung mit dem Institut eingegangen sind, die dem Ziel dient, dessen Eigenmittel künstlich zu erhöhen (negativer Betrag)	---	
54	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangigen Darlehen von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	---	
54a	Entfällt.	---	
55	Direkte, indirekte und synthetische Positionen des Instituts in Instrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangigen Darlehen von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	---	
56	Entfällt.	---	
EU-56a	Betrag der von den Posten der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten in Abzug zu bringenden Posten, der die Posten der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten des Instituts überschreitet (negativer Betrag)	---	
EU-56b	Sonstige regulatorische Anpassungen des Ergänzungskapitals	---	
57	Regulatorische Anpassungen des Ergänzungskapitals (T2) insgesamt	---	
58	Ergänzungskapital (T2)	75,28	
59	Gesamtkapital (TC = T1 + T2)	320,06	
60	Gesamtrisikobetrag	2.038,56	
Kapitalquoten und -anforderungen einschließlich Puffer			
61	Harte Kernkapitalquote	9,9568%	
62	Kernkapitalquote	12,0072%	
63	Gesamtkapitalquote	15,7001%	
64	Anforderungen an die harte Kernkapitalquote des Instituts insgesamt	8,3363%	
65	davon: Anforderungen im Hinblick auf den Kapitalerhaltungspuffer	2,5000%	
66	davon: Anforderungen im Hinblick auf den antizyklischen Kapitalpuffer	0,0706%	
67	davon: Anforderungen im Hinblick auf den Systemrisikopuffer	0,0000%	
EU-67a	davon: Anforderungen im Hinblick auf die von global systemrelevanten Instituten (G-SII) bzw. anderen systemrelevanten Institute (O-SII) vorzuhaltenden Puffer	0,0000%	
EU-67b	davon: zusätzliche Eigenmittelanforderungen zur Eindämmung anderer Risiken als des Risikos einer übermäßigen Verschuldung	1,2656%	
68	Harte Kernkapitalquote (ausgedrückt als Prozentsatz des Risikopositionsbetrags) nach Abzug der zur Erfüllung der Mindestkapitalanforderungen erforderlichen Werte	4,1911%	
Nationale Mindestanforderungen (falls abweichend von Basel III)			
69	Entfällt.		
70	Entfällt.		
71	Entfällt.		
Beträge unter den Schwellenwerten für Abzüge (vor Risikogewichtung)			
72	Direkte und indirekte Positionen in Eigenmittelinstrumenten oder Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (weniger als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen)	4,40	
73	Direkte und indirekte Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (unter dem Schwellenwert von 17,65 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen)	---	
74	Entfällt.		
75	Latente Steueransprüche, die aus temporären Differenzen resultieren (unter dem Schwellenwert von 17,65 %, verringert um den Betrag der verbundenen Steuerschulden, wenn die Bedingungen von Artikel 38 Absatz 3 CRR erfüllt sind)	---	
Anwendbare Obergrenzen für die Einbeziehung von Wertberichtigungen in das Ergänzungskapital			
76	Auf das Ergänzungskapital anrechenbare Kreditrisikoanpassungen in Bezug auf Forderungen, für die der Standardansatz gilt (vor Anwendung der Obergrenze)	5,53	
77	Obergrenze für die Anrechnung von Kreditrisikoanpassungen auf das Ergänzungskapital im Rahmen des Standardansatzes	19,14	
78	Auf das Ergänzungskapital anrechenbare Kreditrisikoanpassungen in Bezug auf Forderungen, für die der auf internen Beurteilungen basierende Ansatz gilt (vor Anwendung der Obergrenze)	---	
79	Obergrenze für die Anrechnung von Kreditrisikoanpassungen auf das Ergänzungskapital im Rahmen des auf internen Beurteilungen basierenden Ansatzes	---	
Eigenkapitalinstrumente, für die die Auslaufregelungen gelten (anwendbar nur vom 1. Januar 2014 bis zum 1. Januar 2022)			
80	Derzeitige Obergrenze für Instrumente des harten Kernkapitals, für die Auslaufregelungen gelten	---	
81	Wegen Obergrenze aus dem harten Kernkapital ausgeschlossener Betrag (Betrag über Obergrenze nach Tilgungen und Fälligkeiten)	---	
82	Derzeitige Obergrenze für Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals, für die Auslaufregelungen gelten	---	
83	Wegen Obergrenze aus dem zusätzlichen Kernkapital ausgeschlossener Betrag (Betrag über Obergrenze nach Tilgungen und Fälligkeiten)	---	
84	Derzeitige Obergrenze für Instrumente des Ergänzungskapitals, für die Auslaufregelungen gelten	---	
85	Wegen Obergrenze aus dem Ergänzungskapital ausgeschlossener Betrag (Betrag über Obergrenze nach Tilgungen und Fälligkeiten)	---	

Meldebogen EU CC1 - Zusammensetzung der aufsichtsrechtlichen Eigenmittel
31.12.2022

in Mio. EUR

a)	b)
Beträge	Quelle nach Referenznummern/ -buchstaben der Bilanz im aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis

zu ¹⁾ (Zeile 2) Der einbehaltene Gewinn ermittelt sich aus der Differenz des maximal zurechenbaren Gewinns im Aufsichtsrecht und der Konzernrücklage und Verlustvortrages des handelsrechtlich geprüften Konzernabschlusses. Hintergrund des Vorgehens ist, dass der Konzernabschluss für den aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis nicht von den Wirtschaftsprüfern testiert wird und dementsprechend diese Werte gemäß der CRR nicht für die aufsichtsrechtlichen Eigenmittel herangezogen werden dürfen. Siehe hierzu § 10a Abs. 5 i. V. m. Abs. 4 KWG

Meldebogen EU CC2 - Abstimmung der aufsichtsrechtlichen Eigenmittel mit der in den geprüften Abschlüssen enthaltenen Bilanz

31.12.2022

		a)	b)	c)
		Bilanz in veröffentlichtem Abschluss	Im aufsichtlichen Konsolidierungskreis	Verweis
in Mio. EUR		Zum Ende des Zeitraums	Zum Ende des Zeitraums	
Aktiva – Aufschlüsselung nach Aktiva-Klassen gemäß der im veröffentlichten Jahresabschluss enthaltenen Bilanz				
1	Barreserve	106,28	106,27	
2	Forderungen an Kreditinstitute	1.125,00	1.124,70	
3	Forderungen an Kunden	2.145,85	2.145,89	
4	Schuldverschreibungen und andere festverzinsliche Wertpapiere	2.020,17	2.020,17	
5	Aktien und andere nicht festverzinsliche Wertpapiere	18,63	18,63	
6	Handelsbestand	41,63	41,63	
7	Beteiligungen	47,53	47,53	
8	Anteile an verbundenen Unternehmen	0,08	5,13	
9	Treuhandvermögen	269,00	269,00	
10	Immaterielle Anlagenwerte	13,13	13,11	F
11	Sachanlagen	92,32	92,29	
12	Sonstige Vermögensgegenstände	123,64	123,04	
13	Rechnungsabgrenzungsposten	4,67	4,54	
14	Aktive latente Steuern	0,00	---	
15	Gesamtaktiva	6.007,92	6.011,92	
Passiva – Aufschlüsselung nach Passiva-Klassen gemäß der im veröffentlichten Jahresabschluss enthaltenen Bilanz				
1	Verbindlichkeiten gegenüber Kreditinstitute	203,26	203,29	
2	Verbindlichkeiten gegenüber Kunden	4.420,31	4.424,59	
3	Verbriefte Verbindlichkeiten	391,95	391,95	
4	Handelsbestand	49,65	49,65	
5	Treuhandverbindlichkeiten	269,00	269,00	
6	Sonstige Verbindlichkeiten	151,37	151,26	
7	Rechnungsabgrenzungsposten	2,93	2,69	
8	Rückstellungen	146,90	145,48	
9	Nachrangige Verbindlichkeiten	128,50	128,50	G
10	Fonds für allgemeine Bankrisiken	4,15	4,15	E
11	Gesamtpassiva	5.768,03	5.770,57	
Eigenkapital				
1	Eigenkapital	239,89	241,36	
2	davon: gezeichnetes Kapital	119,93	119,93	A
3	davon: Kapitalrücklage	149,13	149,13	C
4	davon: Gewinnrücklage	80,11	80,53	B
5	davon: Anteile im Fremdbesitz	39,52	38,70	D
6	davon: Bilanzgewinn /-verlust	-148,80	-146,93	C
7	Gesamtaktienkapital	239,89	241,36	

**Tabelle EU CCA - Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten
Instrumente des harten Kernkapitals (CET1)
31.12.2022**

		a
1	Emittent	M.M.Warburg & CO Gruppe GmbH
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	Satzung
2a	Öffentliche Platzierung oder Privatplatzierung	k.A.
3	Für das Instrument geltendes Recht	Deutsches Recht
3a	Vertragliche Anerkennung von Herabschreibungs- oder Umwandlungsbefugnissen der Abwicklungsbehörden	Nein
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	Aktuelle Behandlung, gegebenenfalls unter Berücksichtigung der CRR-Übergangsregelungen	Hartes Kernkapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Hartes Kernkapital
6	Anrechenbar auf Einzel-/ (teil)konsolidierter Basis/ Einzel- und (teil)konsolidierter Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis
7	Instrumenttyp (Typen je nach Land zu spezifizieren)	GmbH-Anteile
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel oder berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	119,93 Mio. EUR
9	Nennwert des Instruments	119,93 Mio. EUR
EU-9a	Ausgabepreis	Diverse
EU-9b	Tilgungspreis	k.A.
10	Rechnungslegungsklassifikation	Eigenkapital
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	Diverse
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	Unbefristet
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	Keine Fälligkeit
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	Nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Nein
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	Variabel
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	k.A.
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	Nein
EU-20a	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	Gänzlich diskretionär
EU-20b	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	Gänzlich diskretionär
21	Bestehen einer Kostenansteigsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	Nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	Nicht kumulativ
23	Wandelbar oder nicht wandelbar	Nicht wandelbar
24	Wenn wandelbar: Auslöser für die Wandlung	k.A.
25	Wenn wandelbar: ganz oder teilweise	k.A.
26	Wenn wandelbar: Wandlungsrate	k.A.
27	Wenn wandelbar: Wandlung obligatorisch oder fakultativ	k.A.
28	Wenn wandelbar: Typ des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.
29	Wenn wandelbar: Emittent des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.
30	Herabschreibungsmerkmale	Nein
31	Bei Herabschreibung: Auslöser für die Herabschreibung	k.A.
32	Bei Herabschreibung: ganz oder teilweise	k.A.
33	Bei Herabschreibung: dauerhaft oder vorübergehend	k.A.
34	Bei vorübergehender Herabschreibung: Mechanismus der Wiederschreibung	k.A.
34a	Art der Nachrangigkeit (nur für berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten)	Vertraglich
EU-34b	Rang des Instruments in regulären Insolvenzverfahren	1
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Nachrangig zu Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	Nein
37	Gegebenenfalls Angabe unvorschriftsmäßiger Merkmale	k.A.
37a	Link zu den vollständigen Geschäftsbedingungen des Instruments (Verweis)	k.A.

Tabelle EU CCA – Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten Instrumente des zusätzlichen Kernkapitals (AT1)

31.12.2022

	a	b	c	d	
1	Emittent	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO Hypothekenbank AG	M.M.Warburg & CO Hypothekenbank AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	Bilateraler Vertrag	Bilateraler Vertrag	Bilateraler Vertrag	Bilateraler Vertrag
2a	Öffentliche Platzierung oder Privatplatzierung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
3	Für das Instrument geltendes Recht	Deutsche Recht	Deutsche Recht	Deutsche Recht	Deutsche Recht
3a	Vertragliche Anerkennung von Herabschreibungs- oder Umwandlungsbefugnissen der Abwicklungsbehörden	Nein	Nein	Nein	Nein
Aufsichtsrechtliche Behandlung					
4	Aktuelle Behandlung, gegebenenfalls unter Berücksichtigung der CRR-Übergangsregelungen	Zusätzliches Kernkapital	Zusätzliches Kernkapital	Zusätzliches Kernkapital	Zusätzliches Kernkapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Zusätzliches Kernkapital	Zusätzliches Kernkapital	Zusätzliches Kernkapital	Zusätzliches Kernkapital
6	Anrechenbar auf Einzel-/ (teil)konsolidierter Basis/ Einzel- und (teil)konsolidierter Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis
7	Instrumenttyp (Typen je nach Land zu spezifizieren)	nachrangige AT1-Namenschuldverschreibung gem. Art. 52 CRR			
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel oder berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	10 Mio. Euro	23,5 Mio. Euro	4 Mio. Euro	6 Mio. Euro
9	Nennwert des Instruments	10 Mio. Euro	23,5 Mio. Euro	4 Mio. Euro	6 Mio. Euro
EU-9a	Ausgabepreis	10 Mio. Euro	23,5 Mio. Euro	4 Mio. Euro	6 Mio. Euro
EU-9b	Tilgungspreis	10 Mio. Euro	23,5 Mio. Euro	4 Mio. Euro	6 Mio. Euro
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum - fortgeführter Einstandswert			
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	04.10.2017	04.10.2017	30.11.2018	10.12.2018
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	Unbefristet	Unbefristet	Unbefristet	Unbefristet
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	Ja	Ja	Ja	Ja
15	Wählbarer Kündigungsfrist, bedingte Kündigungsfristen und Tilgungsbetrag	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als zusätzliches Kernkapital (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); Kündigung aus steuerlichen Gründen (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); ordentliche Kündigung (mind. 30 Tage Kündigungsfrist zum 15.10.2022 bzw. jeden 5. Jahrestag nach diesem Datum). Alle Kündigungsrechte sind vorbehaltlich der Zustimmung der zuständigen Aufsichtsbehörde.	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als zusätzliches Kernkapital (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); Kündigung aus steuerlichen Gründen (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); ordentliche Kündigung (mind. 30 Tage Kündigungsfrist zum 15.10.2022 bzw. jeden 5. Jahrestag nach diesem Datum). Alle Kündigungsrechte sind vorbehaltlich der Zustimmung der zuständigen Aufsichtsbehörde.	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als zusätzliches Kernkapital (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); Kündigung aus steuerlichen Gründen (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); ordentliche Kündigung (mind. 30 Tage Kündigungsfrist zum 30.11.2023 bzw. jeden 5. Jahrestag nach diesem Datum). Alle Kündigungsrechte sind vorbehaltlich der Zustimmung der zuständigen Aufsichtsbehörde.	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als zusätzliches Kernkapital (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); Kündigung aus steuerlichen Gründen (mind. 30 Tage Kündigungsfrist, max. 60 Tage); ordentliche Kündigung (mind. 30 Tage Kündigungsfrist zum 30.11.2023 bzw. jeden 5. Jahrestag nach diesem Datum). Alle Kündigungsrechte sind vorbehaltlich der Zustimmung der zuständigen Aufsichtsbehörde.
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
Coupons/Dividenden					
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponszahlungen	Fest	Fest	Fest	Fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,5% p.a.	5,5% p.a.	4% p.a.	4% p.a.
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	Nein	Nein	Nein	Nein
EU-20a	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	Gänzlich diskretionär	Gänzlich diskretionär	Gänzlich diskretionär	Gänzlich diskretionär
EU-20b	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	Gänzlich diskretionär	Gänzlich diskretionär	Gänzlich diskretionär	Gänzlich diskretionär
21	Bestehen einer Kostenansteigsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	Nein	Nein	Nein	Nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ
23	Wandelbar oder nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar
24	Wenn wandelbar: Auslöser für die Wandlung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
25	Wenn wandelbar: ganz oder teilweise	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
26	Wenn wandelbar: Wandlungsrate	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
27	Wenn wandelbar: Wandlung obligatorisch oder fakultativ	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
28	Wenn wandelbar: Typ des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
29	Wenn wandelbar: Emittent des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
30	Herabschreibungsmerkmale	Ja	Ja	Ja	Ja
31	Bei Herabschreibung: Auslöser für die Herabschreibung	CET1-Quote < 5,125%	CET1-Quote < 5,125%	CET1-Quote < 5,125%	CET1-Quote < 5,125%
32	Bei Herabschreibung: ganz oder teilweise	Ganz oder teilweise	Ganz oder teilweise	Ganz oder teilweise	Ganz oder teilweise
33	Bei Herabschreibung: dauerhaft oder vorübergehend	Vorübergehend	Vorübergehend	Vorübergehend	Vorübergehend
34	Bei vorübergehender Herabschreibung: Mechanismus der Wiederschreibung	Bei entsprechenden Jahresüberschuss	Bei entsprechenden Jahresüberschuss	Bei entsprechenden Jahresüberschuss	Bei entsprechenden Jahresüberschuss
34a	Art der Nachrangigkeit (nur für berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten)	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich
EU-34b	Rang des Instruments in regulären Insolvenzverfahren	2	2	2	2
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Nachrangig nach Befriedigung aller Nachranggläubiger der M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	Nachrangig nach Befriedigung aller Nachranggläubiger der M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	Nachrangig nach Befriedigung aller Nachranggläubiger der M.M.Warburg & CO Hypothekenbank AG	Nachrangig nach Befriedigung aller Nachranggläubiger der M.M.Warburg & CO Hypothekenbank AG
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	Nein	Nein	Nein	Nein
37	Gegebenenfalls Angabe unvorschriftsmäßiger Merkmale	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
37a	Link zu den vollständigen Geschäftsbedingungen des Instruments (Verweis)	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.

(1) Ist ein Feld nicht anwendbar, bitte "k.A." angeben.

Tabelle EU CCA – Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten Instrumente des Ergänzungskapitals
31.12.2022

	a	b	c	d	e	f	g	h	
1	Emittent	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO Hypothekenbank AG	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA	
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	Nachrangiger Schuldschein	Bilateraler Vertrag	Bilateraler Vertrag	Nachrangiger Schuldschein	Nachrangiger Schuldschein	Nachrangiger Schuldschein	Bilateraler Vertrag	
2a	Öffentliche Platzierung oder Privatplatzierung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	
3	Für das Instrument geltendes Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	
3a	Vertragliche Anerkennung von Herabschreibungs- oder Umwandlungsbefugnissen der Abwicklungsbehörden	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	
Aufsichtsrechtliche Behandlung									
4	Aktuelle Behandlung, gegebenenfalls unter Berücksichtigung der CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital Amortisierender Betrag nicht anrechenbar	Ergänzungskapital Amortisierender Betrag nicht anrechenbar	Ergänzungskapital Amortisierender Betrag nicht anrechenbar	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	
6	Anrechenbar auf Einzel-/ (teil)konsolidierter Basis/ Einzel- und (teil)konsolidierter Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	
7	Instrumenttyp (Typen je nach Land zu spezifizieren)	Nachrangdarlehen gem. Art. 63 CRR	Nachrangdarlehen gem. Art. 63 CRR	Nachrangdarlehen gem. Art. 63 CRR	Nachrangdarlehen gem. Art. 63 CRR				
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel oder berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	6,13 Mio. Euro	14,51 Mio. Euro	0,76 Mio. Euro	4,84 Mio. Euro	3,24 Mio. Euro	2,44 Mio. Euro	0,83 Mio. Euro	4,78 Mio. Euro
9	Nennwert des Instruments	11 Mio. Euro	20 Mio. Euro	1 Mio. Euro	6 Mio. Euro	4 Mio. Euro	3 Mio. Euro	1 Mio. Euro	5 Mio. Euro
EU-9a	Ausgabepreis	11 Mio. Euro	20 Mio. Euro	1 Mio. Euro	6 Mio. Euro	4 Mio. Euro	3 Mio. Euro	1 Mio. Euro	5 Mio. Euro
EU-9b	Tilgungspreis	11 Mio. Euro	20 Mio. Euro	1 Mio. Euro	6 Mio. Euro	4 Mio. Euro	3 Mio. Euro	1 Mio. Euro	5 Mio. Euro
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum - fortgeführter Einstandswert	Passivum - fortgeführter Einstandswert	Passivum - fortgeführter Einstandswert	Passivum - fortgeführter Einstandswert	Passivum - fortgeführter Einstandswert			
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	13.10.2015	17.08.2016	12.10.2015	13.01.2017	18.01.2017	25.01.2017	01.03.2017	12.10.2015
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	13.10.2025	17.08.2026	12.10.2026	13.01.2027	18.01.2027	25.01.2027	28.02.2027	12.10.2027
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	k.A.	k.A.	k.A.	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als Ergänzungskapital	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als Ergänzungskapital	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als Ergänzungskapital	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als Ergänzungskapital	k.A.
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
Coupons/Dividenden									
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	Fest	Fest	Fest	Fest	Fest	Fest	Fest	Fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	4,00% p.a.	2,77% p.a.	4,00% p.a.	3,50% p.a.	3,50% p.a.	3,50% p.a.	3,50% p.a.	4,10% p.a.
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
EU-20a	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend
EU-20b	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ
23	Wandelbar oder nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar
24	Wenn wandelbar: Auslöser für die Wandlung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
25	Wenn wandelbar: ganz oder teilweise	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
26	Wenn wandelbar: Wandlungsrate	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
27	Wenn wandelbar: Wandlung obligatorisch oder fakultativ	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
28	Wenn wandelbar: Typ des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
29	Wenn wandelbar: Emittent des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
30	Herabschreibungsmerkmale	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
31	Bei Herabschreibung: Auslöser für die Herabschreibung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
32	Bei Herabschreibung: ganz oder teilweise	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
33	Bei Herabschreibung: dauerhaft oder vorübergehend	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
34	Bei vorübergehender Herabschreibung: Mechanismus der Wiederzuschreibung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
34a	Art der Nachrangigkeit (nur für berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten)	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich
EU-34b	Rang des Instruments in regulären Insolvenzverfahren	3	3	3	3	3	3	3	3
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
37	Gegebenenfalls Angabe unvorschriftsmäßiger Merkmale	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
37a	Link zu den vollständigen Geschäftsbedingungen des Instruments (Verweis)	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.

(1) Ist ein Feld nicht anwendbar, bitte "k.A." angeben.

Tabelle EU CCA - Hauptmerkmale von Instrumenten aufsichtsrechtlicher Eigenmittel und Instrumenten berücksichtigungsfähiger Verbindlichkeiten Instrumente des Ergänzungskapitals
31.12.2022

	j	k	l	m	n	o	
1	Emittent	M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA					
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für	Bilateraler Vertrag					
2a	Öffentliche Platzierung oder Privatplatzierung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
3	Für das Instrument geltendes Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht	Deutsches Recht
3a	Vertragliche Anerkennung von Herabschreibungs- oder Umwandlungsbefugnissen der Abwicklungsbehörden	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
Aufsichtsrechtliche Behandlung							
4	Aktuelle Behandlung, gegebenenfalls unter Berücksichtigung der CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Einzel-/ (teil)konsolidierter Basis/ Einzel- und (teil)konsolidierter Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis	Einzel- und (teil)konsolidierte Basis
7	Instrumenttyp (Typen je nach Land zu spezifizieren)	Nachrangdarlehen gem. Art. 63 CRR					
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel oder berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	3 Mio. Euro	5 Mio. Euro	6 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro
9	Nennwert des Instruments	3 Mio. Euro	5 Mio. Euro	6 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro
EU-9a	Ausgabepreis	3 Mio. Euro	5 Mio. Euro	6 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro
EU-9b	Tilgungspreis	3 Mio. Euro	5 Mio. Euro	6 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro	5 Mio. Euro
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum - fortgeführter Einstandswert					
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	13.10.2015	12.10.2015	14.10.2015	04.11.2015	11.11.2015	19.03.2021
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin	Mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	13.12.2028	12.10.2029	15.10.2030	04.11.2030	11.11.2030	19.03.2031
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Ja
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	Kündigung bei einem regulatorischen Ereignis oder keine Behandlung des Darlehens mehr als Ergänzungskapital; Das Kündigungsrecht ist vorbehaltlich der Zustimmung der zuständigen Aufsichtsbehörde, falls dies aufgrund von Rechtsvorschriften erforderlich ist.
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
Coupons/Dividenden							
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	Fest	Fest	Fest	Fest	Fest	Fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	4,15% p.a.	4,25% p.a.	4,40% p.a.	4,25% p.a.	4,30% p.a.	4,50% p.a.
19	Bestehen eines „Dividenden-Stoppes“	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
EU-20a	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend
EU-20b	Gänzlich diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend	Zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ	Nicht kumulativ
23	Wandelbar oder nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar	Nicht wandelbar
24	Wenn wandelbar: Auslöser für die Wandlung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
25	Wenn wandelbar: ganz oder teilweise	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
26	Wenn wandelbar: Wandlungsrate	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
27	Wenn wandelbar: Wandlung obligatorisch oder fakultativ	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
28	Wenn wandelbar: Typ des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
29	Wenn wandelbar: Emittent des Instruments, in das gewandelt wird	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
30	Herabschreibungsmerkmale	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
31	Bei Herabschreibung: Auslöser für die Herabschreibung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
32	Bei Herabschreibung: ganz oder teilweise	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
33	Bei Herabschreibung: dauerhaft oder vorübergehend	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
34	Bei vorübergehender Herabschreibung: Mechanismus der Wiederzuschreibung	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
34a	Art der Nachrangigkeit (nur für berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten)	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich	Vertraglich
EU-34b	Rang des Instruments in regulären Insolvenzverfahren	3	3	3	3	3	3
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Nachrangig zu Insolvenzgläubigern					
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein	Nein
37	Gegebenenfalls Angabe unvorschriftsmäßiger Merkmale	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.
37a	Link zu den vollständigen Geschäftsbedingungen des Instruments (Verweis)	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.	k.A.

(1) Ist ein Feld nicht anwendbar, bitte "k.A." angeben.

**Meldebogen EU OV1 – Übersicht über die Gesamtrisikobeträge
31.12.2022**

		Gesamtrisikobetrag (RWA)		Eigenmittel-
				anforderungen
		a	b	insgesamt
	in Mio. EUR	31.12.2022	31.12.2021	31.12.2022
1	Kreditrisiko (ohne Gegenparteiausfallrisiko)	1.488,51	1.945,58	119,08
2	Davon: Standardansatz	1.488,51	1.945,58	119,08
3	Davon: IRB-Basisansatz (F-IRB)	---	---	---
4	Davon: Slotting-Ansatz	---	---	---
EU 4a	Davon: Beteiligungspositionen nach dem einfachen Risikogewichtungsansatz	---	---	---
5	Davon: Fortgeschrittener IRB-Ansatz (A-IRB)	---	---	---
6	Gegenparteiausfallrisiko – CCR	60,84	124,49	4,87
7	Davon: Standardansatz	32,45	87,06	2,60
8	Davon: Auf einem internen Modell beruhende Methode (IMM)	---	---	---
EU 8a	Davon: Risikopositionen gegenüber einer CCP	9,99	4,76	0,80
EU 8b	Davon: Anpassung der Kreditbewertung (CVA)	17,35	31,54	1,39
9	Davon: Sonstiges CCR	1,05	1,14	0,08
10	Entfällt			
11	Entfällt			
12	Entfällt			
13	Entfällt			
14	Entfällt			
15	Abwicklungsrisiko	0,16	0,09	0,01
16	Verbriefungspositionen im Anlagebuch (nach Anwendung der Obergrenze)	---	---	---
17	Davon: SEC-IRBA	---	---	---
18	Davon: SEC-ERBA (einschl. IAA)	---	---	---
19	Davon: SEC-SA	---	---	---
EU 19a	Davon: 1 250 % / Abzug	---	---	---
20	Positions-, Währungs- und Warenpositionsrisiken (Marktrisiko)	39,31	40,49	3,14
21	Davon: Standardansatz	39,31	40,49	3,14
22	Davon: IMA	---	---	---
EU 22a	Großkredite	---	---	---
23	Operationelles Risiko	449,74	397,70	35,98
EU 23a	Davon: Basisindikatoransatz	449,74	397,70	35,98
EU 23b	Davon: Standardansatz	---	---	---
EU 23c	Davon: Fortgeschrittener Messansatz	---	---	---
24	Beträge unter den Abzugsschwellenwerten (mit einem Risikogewicht von 250 %)	---	---	---
25	Entfällt			
26	Entfällt			
27	Entfällt			
28	Entfällt			
29	Gesamt	2.038,56	2.508,35	163,08

Meldebogen EU CCR1 - Analyse der CCR-Risikoposition nach Ansatz
31.12.2022

in Mio. EUR		a	b	c	d	e	f	g	h
		Wiederbeschaffungskosten (RC)	Potenzieller künftiger Risikopositionswert (PFE)	EEPE	Zur Berechnung des aufsichtlichen Risikopositionswerts verwendeter Alpha-Wert	Risikopositionswert vor CRM	Risikopositionswert nach CRM	Risikopositionswert	RWEA
EU1	EU - Ursprungsrisikomethode (für Derivate)	1,53	0,40		1,4	2,70	1,43	1,43	0,29
EU2	EU – Vereinfachter SA-CCR (für Derivate)	---	---		1,4	---	---	---	---
1	SA-CCR (für Derivate)	73,88	139,80		1,4	240,50	86,28	86,28	32,45
2	IMM (für Derivate und SFTs)			---	1,4	---	---	---	---
2a	Davon Netting-Sätze aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften			---		---	---	---	---
2b	Davon Netting-Sätze aus Derivaten und Geschäften mit langer Abwicklungsfrist			---		---	---	---	---
2c	Davon aus vertraglichen produktübergreifenden Netting-Sätzen			---		---	---	---	---
3	Einfache Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (für SFTs)					---	---	---	---
4	Umfassende Methode zur Berücksichtigung finanzieller Sicherheiten (für SFTs)					---	---	---	---
5	VAR für SFTs					---	---	---	---
6	Insgesamt					243,20	87,72	87,72	32,74

Meldebogen EU CCR2 - Eigenmittelanforderungen für das CVA-Risiko
31.12.2022

in Mio. EUR		a	b
		Risikopositionswert	RWEA
1	Gesamtgeschäfte nach der fortgeschrittenen Methode	---	---
2	(i) VaR-Komponente (einschließlich Dreifach-Multiplikator)	---	---
3	(ii) VaR-Komponente unter Stressbedingungen (sVaR) (einschließlich Dreifach-Multiplikator)	---	---
4	Geschäfte nach der Standardmethode	87,23	17,35
EU-4	Geschäfte nach dem alternativen Ansatz (auf Grundlage der Ursprungsrisikomethode)	---	---
5	Gesamtgeschäfte mit Eigenmittelanforderungen für das CVA-Risiko	87,23	17,35

Meldebogen EU CCR3 - Standardansatz - CCR-Risikopositionen nach regulatorischer Risikopositionsklasse und Risikogewicht
31.12.2022

		Risikogewicht											Wert der Risikoposition insgesamt
		a	b	c	d	e	f	g	h	i	j	k	
in Mio. EUR	Risikopositionsklassen	0%	2%	4%	10%	20%	50%	70%	75%	100%	150%	Sonstige	
1	Zentralstaaten oder Zentralbanken	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
2	Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	0,34	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,34
3	Öffentliche Stellen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
4	Multilaterale Entwicklungsbanken	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
5	Internationale Organisationen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
6	Institute	---	---	249,82	---	49,89	22,54	---	---	---	---	---	322,26
7	Unternehmen	---	---	---	---	---	---	---	---	14,94	---	---	14,94
8	Mengengeschäft	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
9	Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
10	Sonstige Positionen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
11	Wert der Risikoposition insgesamt	0,34	---	249,82	---	49,89	22,54	---	---	14,94	---	---	337,54

Meldebogen EU CCR5 - Zusammensetzung der Sicherheiten für CCR-Risikopositionen
31.12.2022

in Mio. EUR	Art der Sicherheit(en)	a				b			
		Sicherheit(en) für Derivatgeschäfte				Sicherheit(en) für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte			
		Beizulegender Zeitwert der empfangenen Sicherheiten		Beizulegender Zeitwert der gestellten Sicherheiten		Beizulegender Zeitwert der empfangenen Sicherheiten		Beizulegender Zeitwert der gestellten Sicherheiten	
Getrennt	Nicht getrennt	Getrennt	Nicht getrennt	Getrennt	Nicht getrennt	Getrennt	Nicht getrennt		
1	Bar – Landeswährung	---	---	---	---	---	---	---	---
2	Bar – andere Währungen	---	---	---	---	---	---	---	---
3	Inländische Staatsanleihen	---	---	---	---	---	---	---	---
4	Andere Staatsanleihen	---	---	---	---	---	---	---	---
5	Schuldtitle öffentlicher Anleger	---	---	---	---	---	---	---	---
6	Unternehmensanleihen	---	---	---	---	---	---	---	---
7	Dividendenwerte	---	---	---	---	---	---	---	---
8	Sonstige Sicherheiten	---	---	---	---	---	---	---	---
9	Insgesamt	---	---	---	---	---	---	---	---

Meldebogen EU CCR8 - Risikopositionen gegenüber zentralen Gegenparteien (CCPs)
31.12.2022

in Mio. EUR		a	b
		Risikopositionswert	RWEA
1	Risikopositionen gegenüber qualifizierten CCPs (insgesamt)	---	9,99
2	Risikopositionen aus Geschäften bei qualifizierten CCPs (ohne Ersteinschusszahlungen und Beiträge zum Ausfallfonds). Davon:	249,82	9,99
3	(i) OTC-Derivate	109,48	4,38
4	(ii) Börsennotierte Derivate	140,34	5,61
5	(iii) SFTs	---	---
6	(iv) Netting-Sätze, bei denen produktübergreifendes Netting zugelassen wurde	---	---
7	Getrennte Ersteinschüsse	---	---
8	Nicht getrennte Ersteinschüsse	---	---
9	Vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds	---	---
10	Nicht vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds	---	---
11	Risikopositionen gegenüber nicht qualifizierten Gegenparteien (insgesamt)	---	---
12	Risikopositionen aus Geschäften bei nicht qualifizierten Gegenparteien (ohne Ersteinschusszahlungen und Beiträge zum Ausfallfonds) Davon:	---	---
13	(i) OTC-Derivate	---	---
14	(ii) Börsennotierte Derivate	---	---
15	(iii) SFTs	---	---
16	(iv) Netting-Sätze, bei denen produktübergreifendes Netting zugelassen wurde	---	---
17	Getrennte Ersteinschüsse	---	---
18	Nicht getrennte Ersteinschüsse	---	---
19	Vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds	---	---
20	Nicht vorfinanzierte Beiträge zum Ausfallfonds	---	---

Meldebogen EU CCyB1 - Geografische Verteilung der für die Berechnung des antizyklischen Kapitalpuffers wesentlichen Kreditrisikopositionen
31.12.2022

	a)	b)	c)	d)	e)	f)	g)	h)	i)	j)	k)	l)	m)
	Allgemeine Kreditrisikopositionen		Wesentliche Kreditrisikopositionen – Marktrisiko		Verbriefungs- risikopositionen – Risikopositions- wert im Anlagebuch	Risikopositions- gesamtwert	Eigenmittelanforderungen			Insgesamt	Risikogewichtete Positionsbeträge	Gewichtungen d. Eigenmittel- anforderungen (in %)	Quote des antizyklischen Kapitalpuffers (in %)
in Mio. EUR	Risikopositions- wert nach dem Standardansatz	Risikopositions- wert nach dem IRB-Ansatz	Summe der Kauf- und Verkaufspositionen der Risikopositionen im Handelsbuch nach dem Standardansatz	Wert der Risikopositionen im Handelsbuch (interne Modelle)			Wesentliche Kreditrisiko- positionen – Kreditrisiko	Wesentliche Kreditrisiko- positionen – Marktrisiko	Wesentliche Kreditrisikopositionen – Verbriefungspositionen im Anlagebuch				
010	Aufschlüsselung nach Ländern¹												
Republic of Armenia	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Republic of Austria	23,47	---	---	---	---	23,47	0,48	---	---	0,48	6,02	0,4216	---
Australia	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Kingdom of Belgium	0,61	---	---	---	---	0,61	0,02	---	---	0,02	0,27	0,0187	---
Swiss Confederation	23,55	---	0,02	---	---	23,57	1,88	0,00	---	1,89	23,57	1,6500	---
Republic of Cyprus	1,60	---	---	---	---	1,60	0,10	---	---	0,10	1,22	0,0854	---
Federal Republic of Germany	2.200,60	---	1,87	---	---	2.202,48	98,50	0,15	---	98,65	1.233,11	86,3229	---
Kingdom of Denmark	8,27	---	---	---	---	8,27	0,30	---	---	0,30	3,75	0,2628	2,0000
Kingdom of Spain	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Republic of Finland	38,79	---	---	---	---	38,79	0,23	---	---	0,23	2,85	0,1998	---
French Republic	52,02	---	---	---	---	52,02	0,42	---	---	0,42	5,31	0,3718	---
Great Britain and Northern Ireland	0,42	---	0,01	---	---	0,42	0,03	0,00	---	0,03	0,42	0,0293	1,0000
Hellenic Republic	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Republic of Guatemala	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Ireland	17,17	---	---	---	---	17,17	---	---	---	---	---	---	---
State of Israel	10,45	---	---	---	---	10,45	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Italian Republic	0,05	---	---	---	---	0,05	0,01	---	---	0,01	0,07	0,0050	---
Cayman Islands	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Republic of Liberia	2,21	---	---	---	---	2,21	0,18	---	---	0,18	2,21	0,1545	---
Grand Duchy of Luxembourg	166,52	---	0,02	---	---	166,54	8,76	0,00	---	8,76	109,53	7,6678	0,5000
Republic of the Marshall Islands	7,72	---	---	---	---	7,72	0,58	---	---	0,58	7,24	0,5072	---
Republic of Malta	2,63	---	---	---	---	2,63	0,21	---	---	0,21	2,63	0,1838	---
Republic of Namibia	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Kingdom of Netherlands	15,00	---	---	---	---	15,00	0,61	---	---	0,61	7,64	0,5350	---
Kingdom of Norway	165,11	---	---	---	---	165,11	1,32	---	---	1,32	16,51	1,1559	2,0000
Portuguese Republic	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Kingdom of Sweden	51,93	---	---	---	---	51,93	0,42	---	---	0,42	5,19	0,3635	1,0000
Republic of Singapore	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Republic of Turkey	0,09	---	---	---	---	0,09	0,01	---	---	0,01	0,09	0,0064	---
United States of America	268,91	---	---	---	---	268,91	0,07	---	---	0,07	0,84	0,0585	---
Virgin Islands (British)	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
Republic of South Africa	0,00	---	---	---	---	0,00	0,00	---	---	0,00	0,00	---	---
20	Insgesamt	3.057,12	---	1,92	---	3.059,04	114,13	0,15	---	114,28	1.428,49	100,0000%	---

¹ Zuordnung gemäß Delegierte Verordnung (EU) Nr. 1152/2014

Meldebogen EU CCyB2 - Höhe des institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffers
31.12.2022

	in Mio. EUR	a)
1	Gesamtrisikobetrag	2.038,56
2	Quote des institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffers	0,0706%
3	Anforderung an den institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffer	1,44

Meldebogen EU CR1: Vertragsgemäß bediente und notleidende Risikopositionen und damit verbundene Rückstellungen
31.12.2022

	a	b	c	d	e	f	g	h	i	j	k	l	m	n	o
	Bruttobuchwert / Nominalbetrag						Kumulierte Wertminderung, kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken und Rückstellungen						Empfangene Sicherheiten und Finanzgarantien		
	Vertragsgemäß bediente Risikopositionen		Notleidende Risikopositionen				Vertragsgemäß bediente Risikopositionen - kumulierte Wertminderung und Rückstellungen		Notleidende Risikopositionen – kumulierte Wertminderung, kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken und Rückstellungen				Kumulierte teilweise Abschreibung	Bei vertragsgemäß bedienten Risikopositionen	Bei notleidenden Risikopositionen
	Davon Stufe 1	Davon Stufe 2	Davon Stufe 2		Davon Stufe 3	Davon Stufe 1	Davon Stufe 2	Davon Stufe 2		Davon Stufe 3					
005	Guthaben bei Zentralbanken und Sichtguthaben	1.207,94			---								---	50,42	---
010	Darlehen und Kredite	2.170,09			37,07								-1,06	1.950,27	17,55
020	Zentralbanken	---			---								---	---	---
030	Sektor Staat	30,00			---								---	30,00	---
040	Kreditinstitute	7,12			---								---	---	---
050	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	565,01			6,27								-0,00	538,06	---
060	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	1.456,31			19,55								-0,84	1.301,77	13,65
070	Davon: KMU	1.188,03			4,06								---	1.133,09	1,27
080	Haushalte	111,64			11,24								-0,22	80,44	3,90
090	Schuldverschreibungen	1.961,91			---								---	75,79	---
100	Zentralbanken	---			---								---	---	---
110	Sektor Staat	937,65			---								---	9,00	---
120	Kreditinstitute	972,80			---								---	56,53	---
130	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	51,45			---								---	10,26	---
140	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	---			---								---	---	---
150	Außerbilanzielle Risikopositionen	454,51			8,33									108,98	4,21
160	Zentralbanken	---			---									---	---
170	Sektor Staat	3,37			---									0,08	---
180	Kreditinstitute	13,30			---									---	---
190	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	210,98			---									64,31	---
200	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	162,53			8,33									34,92	4,21
210	Haushalte	64,32			---									9,66	---
220	Insgesamt	5.794,45			45,39								-1,06	2.185,45	21,76

Die Spalten b, c, e, f, h, i, k und l werden gem. Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 nicht berichtet, da die Warburg FHG eine NPL-Quote < 5,0% aufweist.

Meldebogen EU CR1-A: Restlaufzeit von Risikopositionen
31.12.2022

		a	b	c	d	e	f
		Netto-Risikopositionswert					
in Mio. EUR		Jederzeit kündbar	<= 1 Jahr	> 1 Jahr <= 5 Jahre	> 5 Jahre	Keine angegebene Restlaufzeit	Insgesamt
1	Darlehen und Kredite	185,13	260,38	732,01	1.010,34	7,28	2.195,14
2	Schuldverschreibungen	---	231,13	1.401,36	329,41	---	1.961,91
3	Insgesamt	185,13	491,51	2.133,38	1.339,75	7,28	4.157,05

Meldebogen EU CR2: Veränderung des Bestands notleidender Darlehen und Kredite
31.12.2022

in Mio. EUR		a
		Bruttobuchwert
010	Ursprünglicher Bestand notleidender Darlehen und Kredite	89,72
020	Zuflüsse zu notleidenden Portfolios	55,07
030	Abflüsse aus notleidenden Portfolios	-107,72
040	Abflüsse aufgrund von Abschreibungen	-0,09
050	Abfluss aus sonstigen Gründen	-107,64
060	Endgültiger Bestand notleidender Darlehen und Kredite	37,07

Meldebogen EU CQ1: Kreditqualität gestundeter Risikopositionen

31.12.2022

		a	b	c	d	e		f	g	h
		Bruttobuchwert / Nominalbetrag der Risikopositionen mit Stundungsmaßnahmen				Kumulierte Wertminderung, kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken und Rückstellungen		Empfangene Sicherheiten und empfangene Finanzgarantien für gestundete Risikopositionen		
		Notleidend gestundet				Bei vertragsgemäß bedienten gestundeten Risikopositionen		Bei notleidend gestundeten Risikopositionen		
in Mio. EUR		Vertragsgemäß bedient gestundet	Davon: ausgefallen		Davon: wertgemindert	Bei vertragsgemäß bedienten gestundeten Risikopositionen	Bei notleidend gestundeten Risikopositionen	Davon: Empfangene Sicherheiten und Finanzgarantien für notleidende Risikopositionen mit Stundungsmaßnahmen		
005	Guthaben bei Zentralbanken und Sichtguthaben	---	---	---	---	---	---	---	---	---
010	Darlehen und Kredite	1,48	0,04	0,04	0,04	-0,02	---	0,45	0,00	
020	Zentralbanken	---	---	---	---	---	---	---	---	
030	Sektor Staat	---	---	---	---	---	---	---	---	
040	Kreditinstitute	---	---	---	---	---	---	---	---	
050	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	---	---	---	---	---	---	---	---	
060	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	1,03	0,00	0,00	0,00	-0,01	---	0,00	0,00	
070	Haushalte	0,46	0,03	0,03	0,03	-0,01	---	0,45	---	
080	Schuldverschreibungen	0,00	---	---	---	---	---	---	---	
090	Erteilte Kreditzusagen	---	---	---	---	---	---	---	---	
100	Insgesamt	1,48	0,04	0,04	0,04	-0,02	---	0,45	0,00	

Meldebogen EU CQ3: Kreditqualität vertragsgemäß bedienter und notleidender Risikopositionen nach Überfälligkeit in Tagen
31.12.2022

		a	b	c	d	e	Bruttobuchwert / Nominalbetrag						l
		Vertragsgemäß bediente Risikopositionen				Notleidende Risikopositionen							
in Mio. EUR		Nicht überfällig oder ≤ 30 Tage überfällig	Überfällig > 30 Tage ≤ 90 Tage		Wahrscheinlicher Zahlungsausfall bei Risiko-positionen, die nicht überfällig oder ≤ 90 Tage überfällig sind	Überfällig > 90 Tage ≤ 180 Tage	Überfällig > 180 Tage ≤ 1 Jahr	Überfällig > 1 Jahr ≤ 2 Jahre	Überfällig > 2 Jahre ≤ 5 Jahre	Überfällig > 5 Jahre ≤ 7 Jahre	Überfällig > 7 Jahre	Davon: ausgefallen	
005	Guthaben bei Zentralbanken und Sichtguthaben	1.207,94	1.207,94	---	0,00	0,00	---	---	---	---	---	---	
010	Darlehen und Kredite	2.170,09	2.170,09	---	37,07	5,38	10,20	6,12	2,92	0,42	9,38	2,65	37,07
020	Zentralbanken	---	---	---	0,00	0,00	---	---	---	---	---	---	
030	Sektor Staat	30,00	30,00	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
040	Kreditinstitute	7,12	7,12	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
050	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	565,01	565,01	---	6,27	5,30	---	---	---	0,96	0,02	6,27	
060	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	1.456,31	1.456,31	---	19,55	---	10,20	6,00	0,80	0,05	1,92	0,58	19,55
070	Davon: KMU	1.188,03	1.188,03	---	4,06	---	---	4,06	---	---	---	---	4,06
080	Haushalte	111,64	111,64	---	11,24	0,08	---	0,12	2,13	0,36	6,50	2,05	11,24
090	Schuldverschreibungen	1.961,91	1.961,91	---	0,00	0,00	---	---	---	---	---	---	
100	Zentralbanken	---	---	---	0,00	0,00	---	---	---	---	---	---	
110	Sektor Staat	937,65	937,65	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
120	Kreditinstitute	972,80	972,80	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
130	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	51,45	51,45	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
140	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	
150	Außerbilanzielle Risikopositionen	454,51			8,33							8,33	
160	Zentralbanken	---			---							---	
170	Sektor Staat	3,37			---							---	
180	Kreditinstitute	13,30			---							---	
190	Sonstige finanzielle Kapitalgesellschaften	210,98			---							---	
200	Nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften	162,53			8,33							8,33	
210	Haushalte	64,32			---							---	
220	Insgesamt	5.794,45	5.339,94	---	45,39	5,38	10,20	6,12	2,92	0,42	9,38	2,65	45,39

Meldebogen EU CQ4: Qualität notleidender Risikopositionen nach geografischem Gebiet
31.12.2022

		a	b	c	d	e	f	g
		Bruttobuchwert / Nominalbetrag				Kumulierte Wertminderung	Rückstellungen für außerbilanzielle Verbindlichkeiten aus Zusagen und erteilte Finanzgarantien	Kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken bei notleidenden Risikopositionen
in Mio. EUR		Davon: notleidend		Davon: der Wertminderung unterliegend				
		Davon: ausgefallen						
010	Bilanzwirksame Risikopositionen	4.169,08		37,07		-23,41		---
020	Deutschland	3.123,21		36,95		-22,85		---
030	Luxemburg	177,14		---		-0,11		---
040	Norwegen	173,89		---		-0,00		---
050	Vereinigte Staaten von Amerika	153,04		---		-0,01		---
060	Frankreich	144,62		---		-0,08		---
070	Sonstige Länder	397,19		0,12		-0,36		---
080	Außerbilanzielle Risikopositionen	462,84		8,33			0,01	
090	Deutschland	430,16		8,33			0,01	
100	Schweiz	14,10		---			---	
140	Sonstige Länder	18,57		---			---	
390	Insgesamt	4.631,92		45,39		-23,41	0,01	---

Die Spalten b und d werden nicht berichtet, da die Warburg FHG gem. Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 eine NPL-Quote von unter 5% hat.

Meldebogen EU CQ5: Kreditqualität von Darlehen und Kredite an nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften nach Wirtschaftszweig
31.12.2022

		a	b	c	d	e	f
		Bruttobuchwert					
		Davon: notleidend			Davon: der Wertminderung unterliegende Darlehen und Kredite	Kumulierte Wertminderung	Kumulierte negative Änderungen beim beizulegenden Zeitwert aufgrund von Ausfallrisiken bei notleidenden Risikopositionen
in Mio. EUR			Davon: ausgefallen				
010	Land- und Forstwirtschaft, Fischerei	5,74		---		-0,08	
020	Bergbau und Gewinnung von Steinen und Erden	---		---		---	
030	Herstellung	4,44		0,09		-0,14	
040	Energieversorgung	0,38		---		-0,01	
050	Wasserversorgung	---		---		---	
060	Baugewerbe	28,22		3,76		-0,24	
070	Handel	19,45		5,11		-2,93	
080	Transport und Lagerung	22,51		2,21		-6,75	
090	Gastgewerbe/Beherbergung und Gastronomie	0,46		---		-0,01	
100	Information und Kommunikation	0,76		0,76		-0,53	
110	Erbringung von Finanz- und Versicherungsdienstleistungen	---		---		---	
120	Grundstücks- und Wohnungswesen	1.274,74		5,30		-3,44	
130	Erbringung von freiberuflichen, wissenschaftlichen und technischen Dienstleistungen	24,07		0,36		-0,31	
140	Erbringung von sonstigen wirtschaftlichen Dienstleistungen	54,76		1,83		-2,42	
150	Öffentliche Verwaltung, Verteidigung; Sozialversicherung	---		---		---	
160	Bildung	---		---		---	
170	Gesundheits- und Sozialwesen	3,74		0,11		-0,05	
180	Kunst, Unterhaltung und Erholung	0,83		---		-0,00	
190	Sonstige Dienstleistungen	35,75		0,01		-0,07	
200	Insgesamt	1.475,86		19,55		-16,97	

Die Spalten b und d werden nicht berichtet, da die Warburg FHG gem. Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 eine NPL-Quote < 5,0% aufweist.

Meldebogen EU AE1 – Belastete und unbelastete Vermögenswerte
31.12.2022

	Buchwert belasteter Vermögenswerte		Beizulegender Zeitwert belasteter Vermögenswerte		Buchwert unbelasteter Vermögenswerte		Beizulegender Zeitwert unbelasteter Vermögenswerte	
	davon: unbelastet als EHQLA und HQLA einstuftbar		davon: unbelastet als EHQLA und HQLA einstuftbar		davon: EHQLA und HQLA		davon: EHQLA und HQLA	
	010	030	040	050	060	080	090	100
in Mio. EUR								
010	Vermögenswerte des offenlegenden Instituts	2.018,47	325,41			4.532,71	2.798,25	
030	Eigenkapitalinstrumente	---	---	---	---	39,39	5,62	43,25
040	Schuldverschreibungen	365,47	325,41	342,29	305,82	1.385,14	1.363,40	1.280,58
050	davon: gedeckte Schuldverschreibungen	92,07	92,07	85,38	85,38	430,49	430,49	399,29
060	davon: Verbriefungen	---	---	---	---	---	---	---
070	davon: von Staaten begeben	136,92	136,92	133,04	133,04	669,29	669,38	627,43
080	davon: von Finanzunternehmen begeben	236,00	195,94	216,33	179,86	715,84	694,03	653,15
090	davon: von Nichtfinanzunternehmen begeben	---	---	---	---	0,00	---	0,00
120	Sonstige Vermögenswerte	1.642,38	---			3.279,41	1.576,85	

Meldebogen EU AE2 - Entgegengenommene Sicherheiten und begebene eigene Schuldverschreibungen
31.12.2022

in Mio. EUR	Beizulegender Zeitwert belasteter entgegengenommener Sicherheiten oder belasteter begebener eigener Schuldverschreibungen		Unbelastet	
	010	davon: unbelastet als EHQLA und HQLA einstuftbar 030	040	davon: EHQLA und HQLA 060
130	---	---	72,65	---
140	---	---	---	---
150	---	---	---	---
160	---	---	---	---
170	---	---	---	---
180	---	---	---	---
190	---	---	---	---
200	---	---	---	---
210	---	---	---	---
220	---	---	---	---
230	---	---	72,65	---
240	---	---	---	---
241	---	---	---	---
250	2.018,47	325,41	---	---

Meldebogen EU AE3 - Belastungsquellen
31.12.2022

in Mio. EUR		Kongruente Verbindlichkeiten, Eventualverbindlichkeiten oder verliehene Wertpapiere	Belastete Vermögenswerte, belastete entgegengenommene Sicherheiten und belastete begebene eigene Schuldverschreibungen außer gedeckten Schuldverschreibungen und forderungsunterlegten Wertpapieren
		010	030
010	Buchwert ausgewählter finanzieller Verbindlichkeiten	1.547,05	1.705,22

Meldebogen EU CR4 – Standardansatz – Kreditrisiko und Wirkung der Kreditrisikominderung
31.12.2022

Risikopositionsklassen	Risikopositionen vor Kreditumrechnungsfaktoren (CCF) und Kreditrisikominderung (CRM)		Risikopositionen nach CCF und CRM		Risikogewichtete Aktiva (RWA) und RWA- Dichte	
	Bilanzielle Risikopositionen	Außerbilanzielle Risikopositionen	Bilanzielle Risikopositionen	Außerbilanzielle Risikopositionen	Risikogewichtete Aktiva (RWA)	RWA-Dichte (%)
in Mio. EUR	a	b	c	d	e	f
1 Zentralstaaten oder Zentralbanken	1.364,09	198,05	1.408,37	198,05	2,38	0,1484%
2 Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	724,59	3,36	735,27	---	---	0,0000%
3 Öffentliche Stellen	363,00	0,02	367,64	---	0,00	0,0000%
4 Multilaterale Entwicklungsbanken	---	---	---	---	---	0,0000%
5 Internationale Organisationen	34,89	---	34,89	---	---	0,0000%
6 Institute	260,42	21,98	220,66	21,98	45,04	18,5611%
7 Unternehmen	587,72	707,74	453,40	333,48	423,51	53,8215%
8 Mengengeschäft	---	---	---	---	---	0,0000%
9 Durch Grundpfandrechte auf Immobilien besicherte Risikopositionen	1.408,69	8,64	1.408,69	4,41	545,00	38,5680%
10 Ausgefallene Positionen	11,12	8,33	10,81	2,20	16,82	129,3142%
11 Mit besonders hohem Risiko verbundene Risikopositionen	159,51	23,99	152,58	11,87	246,68	150,0000%
12 Gedeckte Schuldverschreibungen	517,76	---	517,76	---	52,27	10,0953%
13 Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	---	---	---	---	---	0,0000%
14 Organismen für gemeinsame Anlagen	0,07	---	0,07	---	0,90	1250,0000%
15 Beteiligungen	57,61	---	57,61	---	57,61	100,0000%
16 Sonstige Posten	100,26	---	100,26	---	98,30	98,0525%
17 INSGESAMT	5.589,74	972,12	5.468,01	571,99	1.488,51	24,6442%

Meldebogen EU CR5 - Standardansatz

31.12.2022

		Risikogewicht															Summe	Ohne Rating
in Mio. EUR	Risikopositions-klassen	0 %	2 %	4 %	10 %	20 %	35 %	50 %	70 %	75 %	100 %	150 %	250 %	370 %	1.250 %	Sonstige		
		a	b	c	d	e	f	g	h	i	j	k	l	m	n	o	p	q
1	Zentralstaaten oder Zentralbanken	1.601,64	---	---	---	---	---	4,77	---	---	---	---	---	---	---	---	1.606,41	1.386,47
2	Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	735,27	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	735,27	708,31
3	Öffentliche Stellen	367,64	---	---	---	---	---	---	---	---	0,00	---	---	---	---	---	367,64	372,67
4	Multilaterale Entwicklungsbanken	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
5	Internationale Organisationen	34,89	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	34,89	34,89
6	Institute	11,35	---	92,89	---	92,94	---	45,47	---	---	---	---	---	---	---	---	242,64	154,94
7	Unternehmen	307,14	---	---	---	0,25	---	---	0,66	---	478,83	---	---	---	---	---	786,88	777,19
8	Risikopositionen aus dem Mengengeschäft	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
9	Durch Grundpfandrechte auf Immobilien besicherte Risikopositionen	---	---	---	---	---	360,27	1.052,83	---	---	---	---	---	---	---	---	1.413,10	1.413,10
10	Ausgefallene Positionen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	5,27	7,73	---	---	---	---	13,00	15,82
11	Mit besonders hohem Risiko verbundene Risikopositionen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	164,45	---	---	---	---	164,45	164,45
12	Gedekte Schuldverschreibungen	---	---	---	515,85	0,91	---	1,00	---	---	---	---	---	---	---	---	517,76	---
13	Risikopositionen gegenüber Instituten und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---
14	Anteile an Organismen für gemeinsame Anlagen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	0,07	---	0,07	0,07
15	Beteiligungspositionen	---	---	---	---	---	---	---	---	---	57,61	---	---	---	---	---	57,61	60,51
16	Sonstige Posten	1,95	---	---	---	---	---	---	---	---	98,30	---	---	---	---	---	100,26	95,06
17	INSGESAMT	3.059,89	---	92,89	515,85	94,10	360,27	1.104,07	0,66	---	640,02	172,18	---	---	0,07	---	6.039,99	5.183,48

Meldebogen EU MR1 - Marktrisiko beim Standardansatz
31.12.2022

in Mio. EUR		a
		Risikogewichtete Positionsbeträge (RWAs)
Outright-Termingeschäfte		
1	Zinsrisiko (allgemein und spezifisch)	7,82
2	Aktienkursrisiko (allgemein und spezifisch)	3,13
3	Fremdwährungsrisiko	28,18
4	Warenpositionsrisiko	---
Optionen		
5	Vereinfachter Ansatz	---
6	Delta-Plus-Ansatz	0,18
7	Szenario-Ansatz	---
8	Verbriefung (spezifisches Risiko)	---
9	Gesamtsumme	39,31

Meldebogen EU OR1 - Eigenmittelanforderungen für das operationelle Risiko und risikogewichtete Positionsbrträge

31.12.2022

in Mio. EUR	Banktätigkeiten	a	b	c	d	e
		2020	Maßgeblicher Indikator 2021	2022	Eigenmittelanforderungen	Risikopositionsbetrag
1	Banktätigkeiten, bei denen nach dem Basisindikatoransatz (BIA) verfahren wird	230,44	247,53	241,61	35,98	449,74
2	Banktätigkeiten, bei denen nach dem Standardansatz (SA)/dem alternativen Standardansatz (ASA) verfahren wird	---	---	---	---	---
3	Anwendung des Standardansatzes	---	---	---		
4	Anwendung des alternativen Standardansatzes	---	---	---		
5	Banktätigkeiten, bei denen nach fortgeschrittenen Messansätzen (AMA) verfahren wird	---	---	---	---	---

Meldebogen EU KM1 - Schlüsselparameter

31.12.2022

in Mio. EUR		a	b	c	d	e
		31.12.2022	k. A.	30.06.2022	k. A.	31.12.2021
Verfügbare Eigenmittel (Beträge)						
1	Hartes Kernkapital (CET1)	202,97		256,83		265,98
2	Kernkapital (T1)	244,77		300,67		309,95
3	Gesamtkapital	320,06		382,66		395,32
Risikogewichtete Positionsbeträge						
4	Gesamtrisikobetrag	2.038,56		2.231,76		2.508,35
Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)						
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	9,9568%		11,5078%		10,6037%
6	Kernkapitalquote (%)	12,0072%		13,4724%		12,3569%
7	Gesamtkapitalquote (%)	15,7001%		17,1461%		15,7602%
Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für andere Risiken als das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)						
EU 7a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für andere Risiken als das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	2,2500%		5,0000%		4,5417%
EU 7b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	1,2656%		2,8125%		2,5547%
EU 7c	Davon: in Form von T1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	1,6875%		3,7500%		3,4063%
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	10,2500%		13,0000%		12,5417%
Kombinierte Kapitalpuffer- und Gesamtkapitalanforderung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)						
8	Kapitalerhaltungspuffer (%)	2,5000%		2,5000%		2,5000%
EU 8a	Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats (%)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
9	Institutspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	0,0706%		0,0532%		0,0447%
EU 9a	Systemrisikopuffer (%)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
10	Puffer für global systemrelevante Institute (%)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
EU 10a	Puffer für sonstige systemrelevante Institute (%)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
11	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (%)	2,5706%		2,5532%		2,5447%
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	12,8206%		15,5532%		15,0864%
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1 (%)	4,1911%		3,7224%		2,9506%
Verschuldungsquote						
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	6.481,28		6.913,39		6.417,88
14	Verschuldungsquote (%)	3,7766%		4,3491%		4,8295%
Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)						
EU 14a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
EU 14b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	3,0000%		3,0000%		3,0000%
Anforderung für den Puffer bei der Verschuldungsquote und die Gesamtverschuldungsquote (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)						
EU 14d	Puffer bei der Verschuldungsquote (%)	0,0000%		0,0000%		0,0000%
EU 14e	Gesamtverschuldungsquote (%)	3,0000%		3,0000%		3,0000%
Liquiditätsdeckungsquote						
15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	2.538,80		3.001,01		2.639,44
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	1.293,79		1.441,29		1.435,18
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	43,29		74,14		64,48
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	1.250,50		1.367,16		1.370,70
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	203,0217%		219,5074%		192,5617%
Strukturelle Liquiditätsquote						
18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	3.679,58		3.964,88		3.813,89
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	2.291,85		2.341,34		2.460,96
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	160,5507%		169,3421%		154,9759%

Die Spalten b und d werden nicht berichtet, da sie für die Warburg FHG als anderes, börsennotiertes Institut gemäß CRR keine Offenlegungsstichtage waren.

Zeile 12, Spalte c und e wurden nachträglich angepasst an die Änderungen im EBA Mapping Tool

Meldebogen EU IRRBB1 - Zinsrisiken bei Geschäften des Anlagebuchs
31.12.2022

Aufsichtliche Schockszenarien		a		b		c		d	
		Änderungen des wirtschaftlichen Werts des Eigenkapitals				Änderungen der Nettozinserträge			
in Mio. EUR		Laufender Zeitraum	Letzter Zeitraum	Laufender Zeitraum	Letzter Zeitraum	Laufender Zeitraum	Letzter Zeitraum	Laufender Zeitraum	Letzter Zeitraum
1	Paralleler Aufwärtsschock	-3,59	-3,54	---	---				
2	Paralleler Abwärtsschock	-0,17	3,65	---	---				
3	Steepener-Schock	5,16	12,26						
4	Flattener-Schock	-6,43	-15,01						
5	Aufwärtsschock bei den kurzfristigen Zinsen	-6,57	-15,04						
6	Abwärtsschock bei den kurzfristigen Zinsen	4,90	10,29						

Meldebogen EU LR1 - LRSum - Summarische Abstimmung zwischen bilanzierten Aktiva und Risikopositionen für die Verschuldungsquote

31.12.2022

in Mio. EUR		a)
		Maßgeblicher Betrag
1	Summe der Aktiva laut veröffentlichtem Abschluss	6.007,92
2	Anpassung bei Unternehmen, die für Rechnungslegungszwecke konsolidiert werden, aber aus dem aufsichtlichen Konsolidierungskreis ausgenommen sind	4,01
3	(Anpassung bei verbrieften Risikopositionen, die die operativen Anforderungen für die Anerkennung von Risikoübertragungen erfüllen)	---
4	(Anpassung bei vorübergehendem Ausschluss von Risikopositionen gegenüber Zentralbanken (falls zutreffend))	---
5	(Anpassung bei Treuhandvermögen, das nach dem geltenden Rechnungslegungsrahmen in der Bilanz angesetzt wird, aber gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe i CRR bei der Gesamtrisikopositionsmessgröße unberücksichtigt bleibt)	-269,00
6	Anpassung bei marktüblichen Käufen und Verkäufen finanzieller Vermögenswerte gemäß dem zum Handelstag geltenden Rechnungslegungsrahmen	---
7	Anpassung bei berücksichtigungsfähigen Liquiditätsbündelungsgeschäften	---
8	Anpassung bei derivativen Finanzinstrumenten	737,51
9	Anpassung bei Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs)	---
10	Anpassung bei außerbilanziellen Posten (d. h. Umrechnung außerbilanzieller Risikopositionen in Kreditäquivalenzbeträge)	103,89
11	(Anpassung bei Anpassungen aufgrund des Gebots der vorsichtigen Bewertung und spezifischen und allgemeinen Rückstellungen, die eine Verringerung des Kernkapitals bewirkt haben)	---
EU-11a	(Anpassung bei Risikopositionen, die gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe c CRR aus der Gesamtrisikopositionsmessgröße ausgeschlossen werden)	---
EU-11b	(Anpassung bei Risikopositionen, die gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe j CRR aus der Gesamtrisikopositionsmessgröße ausgeschlossen werden)	---
12	Sonstige Anpassungen	-103,04
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	6.481,28

Meldebogen EU LR2 - LCom - Einheitliche Offenlegung der Verschuldungsquote

31.12.2022

in Mio. EUR		Risikopositionen für die CRR-Verschuldungsquote	
		a) 31.12.2022	b) 31.12.2021
Bilanzwirksame Risikopositionen (ohne Derivate und SFTs)			
1	Bilanzwirksame Posten (ohne Derivate und SFTs, aber einschließlich Sicherheiten)	5.613,94	5.866,91
2	Hinzurechnung des Betrags von im Zusammenhang mit Derivaten gestellten Sicherheiten, die nach dem geltenden Rechnungslegungsrahmen von den Bilanzaktiva abgezogen werden	---	---
3	(Abzüge von Forderungen für in bar geleistete Nachschüsse bei Derivatgeschäften)	---	---
4	(Anpassung bei im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften entgegengenommenen Wertpapieren, die als Aktiva erfasst werden)	---	---
5	(Allgemeine Kreditrisikoanpassungen an bilanzwirksamen Posten)	---	---
6	(Bei der Ermittlung des Kernkapitals abgezogene Aktivabträge)	-13,11	-9,89
7	Summe der bilanzwirksamen Risikopositionen (ohne Derivate und SFTs)	5.600,83	5.857,02
Risikopositionen aus Derivaten			
8	Wiederbeschaffungskosten für Derivatgeschäfte nach SA-CCR (d. h. ohne anrechenbare, in bar erhaltene Nachschüsse)	345,63	139,25
EU-8a	Abweichende Regelung für Derivate: Beitrag der Wiederbeschaffungskosten nach vereinfachtem Standardansatz	---	---
9	Aufschläge für den potenziellen künftigen Risikopositionswert im Zusammenhang mit SA-CCR-Derivatgeschäften	437,21	321,79
EU-9a	Abweichende Regelung für Derivate: Potenzieller künftiger Risikopositionsbeitrag nach vereinfachtem Standardansatz	---	---
EU-9b	Risikoposition gemäß Ursprungsrisikomethode	1,76	1,32
10	(Ausgeschlossener CCP-Teil kundengeclearter Handelsrisikopositionen) (SA-CCR)	-8,03	-25,34
EU-10a	(Ausgeschlossener CCP-Teil kundengeclearter Handelsrisikopositionen) (vereinfachter Standardansatz)	---	---
EU-10b	(Ausgeschlossener CCP-Teil kundengeclearter Handelsrisikopositionen) (Ursprungsrisikomethode)	---	---
11	Angepasster effektiver Nominalwert geschriebener Kreditderivate	---	---
12	(Aufrechnungen der angepassten effektiven Nominalwerte und Abzüge der Aufschläge für geschriebene Kreditderivate)	---	---
13	Gesamtsumme der Risikopositionen aus Derivaten	776,57	437,02
Risikopositionen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFTs)			
14	Brutto-Aktiva aus SFTs (ohne Anerkennung von Netting), nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte	---	---
15	(Aufgerechnete Beträge von Barverbindlichkeiten und -forderungen aus Brutto-Aktiva aus SFTs)	---	---
16	Gegenparteausfallrisikoposition für SFT-Aktiva	---	---
EU-16a	Abweichende Regelung für SFTs: Gegenparteausfallrisikoposition gemäß Artikel 429e Absatz 5 und Artikel 222 CRR	---	---
17	Risikopositionen aus als Beauftragter getätigten Geschäften	---	---
EU-17a	(Ausgeschlossener CCP-Teil kundengeclearter SFT-Risikopositionen)	---	---
18	Gesamtsumme der Risikopositionen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	---	---
Sonstige außerbilanzielle Risikopositionen			
19	Außerbilanzielle Risikopositionen zum Bruttonominalwert	460,68	510,64
20	(Anpassungen für die Umrechnung in Kreditäquivalenzbeträge)	-356,79	-386,80
21	(Bei der Bestimmung des Kernkapitals abgezogene allgemeine Rückstellungen sowie spezifische Rückstellungen in Verbindung mit außerbilanziellen Risikopositionen)	---	---
22	Außerbilanzielle Risikopositionen	103,89	123,84
Ausgeschlossene Risikopositionen			
EU-22a	(Risikopositionen, die gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe c CRR aus der Gesamtrisikopositionsmessgröße ausgeschlossen werden)	---	---
EU-22b	((Bilanzielle und außerbilanzielle) Risikopositionen, die gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe j CRR ausgeschlossen werden)	---	---
EU-22c	(Ausgeschlossene Risikopositionen öffentlicher Entwicklungsbanken (oder als solche behandelte Einheiten) – öffentliche Investitionen)	---	---
EU-22d	(Ausgeschlossene Risikopositionen öffentlicher Entwicklungsbanken (oder als solche behandelte Einheiten) – Förderdarlehen)	---	---
EU-22e	(Ausgeschlossene Risikopositionen aus der Weitergabe von Förderdarlehen durch Institute, die keine öffentlichen Entwicklungsbanken (oder als solche behandelte Einheiten) sind)	---	---
EU-22f	(Ausgeschlossene garantierte Teile von Risikopositionen aus Exportkrediten)	---	---
EU-22g	(Ausgeschlossene überschüssige Sicherheiten, die bei Triparty Agents hinterlegt wurden)	---	---
EU-22h	(Von CSDs/Instituten erbrachte CSD-bezogene Dienstleistungen, die gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe o CRR ausgeschlossen werden)	---	---
EU-22i	(Von benannten Instituten erbrachte CSD-bezogene Dienstleistungen, die gemäß Artikel 429a Absatz 1 Buchstabe p CRR ausgeschlossen werden)	---	---
EU-22j	(Verringerung des Risikopositionswerts von Vorfinanzierungs- oder Zwischenkrediten)	---	---
EU-22k	Gesamtsumme der ausgeschlossenen Risikopositionen	---	---
Kernkapital und Gesamtrisikopositionsmessgröße			
23	Kernkapital	244,77	309,95
24	Gesamtrisikopositionsmessgröße	6.481,28	6.417,88
Verschuldungsquote			
25	Verschuldungsquote (in %)	3,7766	4,8295
EU-25	Verschuldungsquote (ohne die Auswirkungen der Ausnahmeregelung für öffentliche Investitionen und Förderdarlehen) (in %)	3,7766	4,8295
25a	Verschuldungsquote (ohne die Auswirkungen etwaiger vorübergehender Ausnahmeregelungen für Zentralbankreserven) (in %)	3,7766	4,8295
26	Regulatorische Mindestanforderung an die Verschuldungsquote (in %)	3,0000	3,0000
EU-26a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen zur Eindämmung des Risikos einer übermäßigen Verschuldung (in %)	---	---
EU-26b	davon: in Form von hartem Kernkapital	---	---
27	Anforderung an den Puffer der Verschuldungsquote (in %)	---	---
EU-27a	Gesamtanforderungen an die Verschuldungsquote (in %)	3,0000	3,0000

Meldebogen EU LR2 - LRCom - Einheitliche Offenlegung der Verschuldungsquote

31.12.2022

Risikopositionen für die
CRR-Verschuldungsquote

in Mio. EUR		Risikopositionen für die CRR-Verschuldungsquote	
		a) 31.12.2022	b) 31.12.2021
Gewählte Übergangsregelung und maßgebliche Risikopositionen			
EU-27b	Gewählte Übergangsregelung für die Definition der Kapitalmessgröße	/ollständig eingeführt	Vollständig eingeführt
Offenlegung von Mittelwerten			
28	Mittelwert der Tageswerte der Brutto-Aktiva aus SFTs nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte und Aufrechnung der Beträge damit verbundener Barverbindlichkeiten und -forderungen	---	---
29	Quartalsendwert der Brutto-Aktiva aus SFTs nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte und Aufrechnung der Beträge damit verbundener Barverbindlichkeiten und -forderungen	---	---
30	Gesamtrisikopositionsmessgröße (einschließlich der Auswirkungen etwaiger vorübergehender Ausnahmeregelungen für Zentralbankreserven) unter Einbeziehung der in Zeile 28 offengelegten Mittelwerte der Brutto- Aktiva aus SFTs (nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte und Aufrechnung der Beträge damit verbundener Barverbindlichkeiten und -forderungen)	6.481,28	6.417,88
30a	Gesamtrisikopositionsmessgröße (ohne die Auswirkungen etwaiger vorübergehender Ausnahmeregelungen für Zentralbankreserven) unter Einbeziehung der in Zeile 28 offengelegten Mittelwerte der Brutto-Aktiva aus SFTs (nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte und Aufrechnung der Beträge damit verbundener Barverbindlichkeiten und -forderungen)	6.481,28	6.417,88
31	Verschuldungsquote (einschließlich der Auswirkungen etwaiger vorübergehender Ausnahmeregelungen für Zentralbankreserven) unter Einbeziehung der in Zeile 28 offengelegten Mittelwerte der Brutto-Aktiva aus SFTs (nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte und Aufrechnung der Beträge damit verbundener Barverbindlichkeiten und -forderungen) (in %)	3,7766	4,8295
31a	Verschuldungsquote (ohne die Auswirkungen etwaiger vorübergehender Ausnahmeregelungen für Zentralbankreserven) unter Einbeziehung der in Zeile 28 offengelegten Mittelwerte der Brutto-Aktiva aus SFTs (nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte und Aufrechnung der Beträge damit verbundener Barverbindlichkeiten und -forderungen) (in %)	3,7766	4,8295

**Meldebogen EU LR3 - LRSpl - Aufgliederung der bilanzwirksamen Risikopositionen
(ohne Derivate, SFTs und ausgenommene Risikopositionen)
31.12.2022**

in Mio. EUR		a)
		Risikopositionen für die CRR-Verschuldungsquote
EU-1	Gesamtsumme der bilanzwirksamen Risikopositionen (ohne Derivate, SFTs und ausgenommene Risikopositionen), davon:	5.613,28
EU-2	Risikopositionen im Handelsbuch	1,46
EU-3	Risikopositionen im Anlagebuch, davon:	5.611,82
EU-4	Risikopositionen in Form gedeckter Schuldverschreibungen	517,76
EU-5	Risikopositionen, die wie Risikopositionen gegenüber Staaten behandelt werden	2.471,47
EU-6	Risikopositionen gegenüber regionalen Gebietskörperschaften, multilateralen Entwicklungsbanken, internationalen Organisationen und öffentlichen Stellen, die nicht wie Staaten behandelt werden	15,10
EU-7	Risikopositionen gegenüber Instituten	261,55
EU-8	Durch Grundpfandrechte an Immobilien besicherte Risikopositionen	1.408,69
EU-9	Risikopositionen aus dem Mengengeschäft	---
EU-10	Risikopositionen gegenüber Unternehmen	587,72
EU-11	Ausgefallene Risikopositionen	11,14
EU-12	Sonstige Risikopositionen (z. B. Beteiligungen, Verbriefungen und sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind)	338,39

Meldebogen EU LIQ1 - Quantitative Angaben zur LCR
31.12.2022

Konsolidierungskreis:	konsolidiert	a)	b)	c)	d)	e)	f)	g)	h)
Währung und Einheit:	in Mio. EUR	Ungewichteter Gesamtwert (Durchschnitt)				Gewichteter Gesamtwert (Durchschnitt)			
EU 1a	Quartal endet am	31.12.2022	30.09.2022	30.06.2022	31.03.2022	31.12.2022	30.09.2022	30.06.2022	31.03.2022
EU 1b	Anzahl der bei der Berechnung der Durchschnittswerte verwendeten Datenpunkte	12	12	12	12	12	12	12	12
HOCHWERTIGE LIQUIDE VERMÖGENSWERTE									
1	Hochwertige liquide Vermögenswerte insgesamt (HQLA)					2.422,91	2.592,23	2.674,25	2.721,70
MITTELABFLÜSSE									
2	Privatkundeneinlagen und Einlagen von kleinen Geschäftskunden, davon:	794,46	798,37	806,83	817,69	84,81	85,67	87,46	90,18
3	Stabile Einlagen	222,22	225,47	226,64	227,25	11,11	11,27	11,33	11,36
4	Weniger stabile Einlagen	512,23	516,67	527,25	542,91	73,70	74,40	76,13	78,82
5	Unbesicherte großvolumige Finanzierung	2.510,34	2.612,34	2.638,31	2.615,31	1.173,00	1.202,90	1.210,39	1.178,18
6	Operative Einlagen (alle Gegenparteien) und Einlagen in Netzwerken von Genossenschaftsbanken	712,93	753,44	706,19	665,30	175,51	185,49	172,92	162,29
7	Nicht operative Einlagen (alle Gegenparteien)	1.797,42	1.858,90	1.929,25	1.940,55	997,49	1.017,41	1.034,59	1.006,42
8	Unbesicherte Schuldtitel	---	---	2,88	9,46	---	---	2,88	9,46
9	Besicherte großvolumige Finanzierung					2,25	2,60	3,37	3,45
10	Zusätzliche Anforderungen	211,61	177,92	149,55	132,99	110,09	96,00	82,79	70,92
11	Abflüsse im Zusammenhang mit Derivate-Risikopositionen und sonstigen Anforderungen an Sicherheiten	101,56	88,53	74,64	64,28	97,03	84,78	73,08	62,73
12	Abflüsse im Zusammenhang mit dem Verlust an Finanzmitteln aus Schuldtiteln	---	---	---	---	---	---	---	---
13	Kredit- und Liquiditätsfazilitäten	110,05	89,38	74,92	68,70	13,05	11,22	9,70	8,19
14	Sonstige vertragliche Finanzierungsverpflichtungen	37,35	34,49	37,73	40,59	7,60	4,40	4,28	3,59
15	Sonstige Eventualfinanzierungsverpflichtungen	466,50	453,59	446,10	439,39	78,34	114,50	134,05	131,97
16	GESAMTMITTELABFLÜSSE					1.456,10	1.506,08	1.522,34	1.478,29
MITTELZUFLÜSSE									
17	Besicherte Kreditvergabe (z. B. Reverse Repos)	---	---	---	---	---	---	---	---
18	Zuflüsse von in vollem Umfang bedienten Risikopositionen	160,71	162,69	149,91	117,80	111,52	112,24	101,67	78,12
19	Sonstige Mittelzuflüsse	15,51	14,66	18,76	16,34	14,81	13,98	18,10	16,32
EU-19a	(Differenz zwischen der Summe der gewichteten Zuflüsse und der Summe der gewichteten Abflüsse aus Drittländern, in denen Transferbeschränkungen gelten, oder die auf nichtkonvertierbare Währungen lauten)					---	---	---	---
EU-19b	(Überschüssige Zuflüsse von einem verbundenen spezialisierten Kreditinstitut)					---	---	---	---
20	GESAMTMITTELZUFLÜSSE	176,22	177,34	168,67	134,14	126,33	126,22	119,77	94,44
EU-20a	Vollständig ausgenommene Zuflüsse	---	---	---	---	---	---	---	---
EU-20b	Zuflüsse mit der Obergrenze von 90 %	---	---	---	---	---	---	---	---
EU-20c	Zuflüsse mit der Obergrenze von 75 %	176,22	177,34	168,67	134,14	126,33	126,22	119,77	94,44
BEREINIGTER GESAMTWERT									
EU-21	LIQUIDITÄTSPUFFER					2.422,91	2.592,23	2.674,25	2.721,70
22	GESAMTE NETTOMITTELABFLÜSSE					1.329,77	1.379,86	1.402,57	1.383,85
23	LIQUIDITÄTSDECKUNGSQUOTE					183,0300%	188,6600%	191,3400%	197,2900%

Meldebogen EU LIQ2: Strukturelle Liquiditätsquote
31.12.2022

in Mio. EUR		a	b	c	d	e
		Ungewichteter Wert nach Restlaufzeit				Gewichteter Wert
		Keine Restlaufzeit	< 6 Monate	6 Monate bis < 1 Jahr	≥ 1 Jahr	
Posten der verfügbaren stabilen Refinanzierung (ASF)						
1	Kapitalposten und -instrumente	258,07	---	---	89,96	348,03
2	<i>Eigenmittel</i>	258,07	---	---	75,28	333,35
3	<i>Sonstige Kapitalinstrumente</i>	---	---	---	14,68	14,68
4	Privatkundeneinlagen	---	814,52	4,62	4,46	753,17
5	<i>Stabile Einlagen</i>	---	229,42	0,26	1,80	220,00
6	<i>Weniger stabile Einlagen</i>	---	585,10	4,35	2,66	533,16
7	Großvolumige Finanzierung:	---	2.623,71	413,44	1.279,62	2.578,38
8	<i>Operative Einlagen</i>	---	697,23	222,45	633,59	895,05
9	<i>Sonstige großvolumige Finanzierung</i>	---	1.926,48	190,99	646,03	1.683,33
10	Interdependente Verbindlichkeiten	---	267,68	1,38	13,10	---
11	Sonstige Verbindlichkeiten:	---	160,93	---	---	---
12	<i>NSFR für Derivatverbindlichkeiten</i>	---	---	---	---	---
13	<i>Sämtliche anderen Verbindlichkeiten und Kapitalinstrumente, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind</i>	---	160,93	---	---	---
14	Verfügbare stabile Refinanzierung (ASF) insgesamt					3.679,58
Posten der erforderlichen stabilen Refinanzierung (RSF)						
15	Hochwertige liquide Vermögenswerte insgesamt (HQLA)					184,69
EU-15a	Mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr belastete Vermögenswerte im Deckungspool		113,09	30,78	1.071,35	1.032,95
16	Einlagen, die zu operativen Zwecken bei anderen Finanzinstituten gehalten werden		---	---	---	---
17	Vertragsgemäß bediente Darlehen und Wertpapiere:		379,69	126,99	626,48	734,47
18	<i>Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch HQLA der Stufe 1 besichert, auf die ein Haircut von 0 % angewandt werden kann</i>		---	---	---	---
19	<i>Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch andere Vermögenswerte und Darlehen und Kredite an Finanzkunden besichert</i>		141,60	0,93	119,43	134,06
20	<i>Vertragsgemäß bediente Darlehen an nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, Darlehen an Privat- und kleine Geschäftskunden und Darlehen an Staaten und öffentliche Stellen, davon:</i>		202,02	113,14	361,32	506,30
21	<i>Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II</i>		5,03	0,00	35,27	74,09
22	<i>Vertragsgemäß bediente Hypothekendarlehen auf Wohnimmobilien, davon:</i>		22,66	5,65	59,64	---
23	<i>Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II</i>		17,10	4,35	58,35	---
24	<i>Sonstige Darlehen und Wertpapiere, die nicht ausgefallen sind und nicht als HQLA infrage kommen, einschließlich börsengehandelter Aktien und bilanzwirksamer Posten für die Handelsfinanzierung</i>		18,97	8,56	87,38	94,10
25	Interdependente Aktiva		267,68	1,30	13,19	---
26	Sonstige Aktiva	---	353,13	0,28	171,76	327,77
27	<i>Physisch gehandelte Waren</i>		---	---	---	---
28	<i>Als Einschuss für Derivatekontrakte geleistete Aktiva und Beiträge zu Ausfallfonds von CCPs</i>		---	---	58,12	49,40
29	<i>NSFR für Derivateaktiva</i>		103,13	---	---	103,13
30	<i>NSFR für Derivatverbindlichkeiten vor Abzug geleisteter Nachschüsse</i>		109,02	---	---	5,45
31	<i>Alle sonstigen Aktiva, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind</i>		140,97	0,28	113,64	169,78
32	Außerbilanzielle Posten		386,85	26,60	49,39	11,98
33	RSF insgesamt					2.291,85
34	Strukturelle Liquiditätsquote (%)					160,5507%

Meldebogen EU LIQ2: Strukturelle Liquiditätsquote
30.09.2022

		a	b			c	d	e
		Ungewichteter Wert nach Restlaufzeit						
in Mio. EUR		Keine Restlaufzeit	< 6 Monate	6 Monate bis < 1 Jahr	≥ 1 Jahr	Gewichteter Wert		
Posten der verfügbaren stabilen Refinanzierung (ASF)								
1	Kapitalposten und -instrumente	318,15	---	---	92,72	410,87		
2	Eigenmittel	318,15	---	---	79,57	397,72		
3	Sonstige Kapitalinstrumente		---	---	13,15	13,15		
4	Privatkundeneinlagen		853,84	7,03	4,87	792,11		
5	Stabile Einlagen		248,93	0,40	2,06	238,92		
6	Weniger stabile Einlagen		604,90	6,63	2,81	553,18		
7	Großvolumige Finanzierung:		3.013,02	428,48	1.205,72	2.662,85		
8	Operative Einlagen		868,44	219,37	637,20	992,90		
9	Sonstige großvolumige Finanzierung		2.144,58	209,11	568,52	1.669,95		
10	Interdependente Verbindlichkeiten		290,90	1,92	15,29	---		
11	Sonstige Verbindlichkeiten:	---	458,31	---	---	---		
12	NSFR für Derivatverbindlichkeiten	---						
13	Sämtliche anderen Verbindlichkeiten und Kapitalinstrumente, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind		458,31	---	---	---		
14	Verfügbare stabile Refinanzierung (ASF) insgesamt					3.865,83		
Posten der erforderlichen stabilen Refinanzierung (RSF)								
15	Hochwertige liquide Vermögenswerte insgesamt (HQLA)					232,76		
EU-15a	Mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr belastete Vermögenswerte im Deckungspool		92,99	57,50	1.041,44	1.013,14		
16	Einlagen, die zu operativen Zwecken bei anderen Finanzinstituten gehalten werden		---	---	---	---		
17	Vertragsgemäß bediente Darlehen und Wertpapiere:		413,03	145,10	723,00	813,81		
18	Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch HQLA der Stufe 1 besichert, auf die ein Haircut von 0 % angewandt werden kann		---	---	---	---		
19	Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch andere Vermögenswerte und Darlehen und Kredite an Finanzkunden besichert		204,35	5,89	125,69	149,07		
20	Vertragsgemäß bediente Darlehen an nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, Darlehen an Privat- und kleine Geschäftskunden und Darlehen an Staaten und öffentliche Stellen, davon:		168,45	133,79	414,61	560,91		
21	Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II		4,69	0,35	30,00	85,39		
22	Vertragsgemäß bediente Hypothekendarlehen auf Wohnimmobilien, davon:		13,27	5,62	99,05	---		
23	Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II		9,89	5,41	85,72	---		
24	Sonstige Darlehen und Wertpapiere, die nicht ausgefallen sind und nicht als HQLA infrage kommen, einschließlich börsengehandelter Aktien und bilanzwirksamer Posten für die Handelsfinanzierung		30,34	---	96,98	103,83		
25	Interdependente Aktiva		292,82	---	15,29	---		
26	Sonstige Aktiva	---	690,16	1,82	226,00	398,21		
27	Physisch gehandelte Waren					---		
28	Als Einschuss für Derivatekontrakte geleistete Aktiva und Beiträge zu Ausfallfonds von CCPs		---	---	88,16	74,94		
29	NSFR für Derivateaktiva		108,47			108,47		
30	NSFR für Derivatverbindlichkeiten vor Abzug geleisteter Nachschüsse		123,85			6,19		
31	Alle sonstigen Aktiva, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind		457,84	1,82	137,84	208,61		
32	Außerbilanzielle Posten		467,69	12,10	52,57	12,45		
33	RSF insgesamt					2.470,37		
34	Strukturelle Liquiditätsquote (%)					156,4881%		

Meldebogen EU LIQ2: Strukturelle Liquiditätsquote
30.06.2022

in Mio. EUR		a	b			c	d	e
		Keine Restlaufzeit	Ungewichteter Wert nach Restlaufzeit			≥ 1 Jahr	Gewichteter Wert	
			< 6 Monate	6 Monate bis < 1 Jahr				
Posten der verfügbaren stabilen Refinanzierung (ASF)								
1	Kapitalposten und -instrumente	319,86	---	---	92,16	412,02		
2	Eigenmittel	319,86	---	---	81,99	401,85		
3	Sonstige Kapitalinstrumente		---	---	10,17	10,17		
4	Privatkundeneinlagen		847,26	7,89	6,41	788,83		
5	Stabile Einlagen		255,03	0,55	2,10	244,91		
6	Weniger stabile Einlagen		592,23	7,34	4,30	543,91		
7	Großvolumige Finanzierung:		3.183,46	308,76	1.225,44	2.764,04		
8	Operative Einlagen		1.127,96	167,89	671,80	1.118,56		
9	Sonstige großvolumige Finanzierung		2.055,50	140,87	553,64	1.645,48		
10	Interdependente Verbindlichkeiten		336,34	3,08	15,30	---		
11	Sonstige Verbindlichkeiten:	---	346,63	---	---	---		
12	NSFR für Derivatverbindlichkeiten	---						
13	Sämtliche anderen Verbindlichkeiten und Kapitalinstrumente, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind		346,63	---	---	---		
14	Verfügbare stabile Refinanzierung (ASF) insgesamt					3.964,88		
Posten der erforderlichen stabilen Refinanzierung (RSF)								
15	Hochwertige liquide Vermögenswerte insgesamt (HQLA)					141,17		
EU-15a	Mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr belastete Vermögenswerte im Deckungspool		---	45,05	1.115,08	986,11		
16	Einlagen, die zu operativen Zwecken bei anderen Finanzinstituten gehalten werden		---	---	---	---		
17	Vertragsgemäß bediente Darlehen und Wertpapiere:		539,42	82,84	781,30	883,53		
18	Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch HQLA der Stufe 1 besichert, auf die ein Haircut von 0 % angewandt werden kann		---	---	---	---		
19	Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch andere Vermögenswerte und Darlehen und Kredite an Finanzkunden besichert		239,46	15,75	138,88	170,70		
20	Vertragsgemäß bediente Darlehen an nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, Darlehen an Privat- und kleine Geschäftskunden und Darlehen an Staaten und öffentliche Stellen, davon:		249,18	59,39	460,98	606,61		
21	Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II		48,15	5,04	30,00	112,60		
22	Vertragsgemäß bediente Hypothekendarlehen auf Wohnimmobilien, davon:		25,47	8,81	101,60	---		
23	Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II		15,16	7,71	84,71	---		
24	Sonstige Darlehen und Wertpapiere, die nicht ausgefallen sind und nicht als HQLA infrage kommen, einschließlich börsengehandelter Aktien und bilanzwirksamer Posten für die Handelsfinanzierung		35,62	---	96,72	106,22		
25	Interdependente Aktiva		338,24	1,15	15,01	---		
26	Sonstige Aktiva	---	508,76	0,01	211,26	324,09		
27	Physisch gehandelte Waren				---	---		
28	Als Einschuss für Derivatekontrakte geleistete Aktiva und Beiträge zu Ausfallfonds von CCPs		---	---	72,83	61,91		
29	NSFR für Derivateaktiva		67,34			67,34		
30	NSFR für Derivatverbindlichkeiten vor Abzug geleisteter Nachschüsse		91,57			4,58		
31	Alle sonstigen Aktiva, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind		349,85	0,01	138,43	190,26		
32	Außerbilanzielle Posten		468,85	28,97	36,10	6,45		
33	RSF insgesamt					2.341,34		
34	Strukturelle Liquiditätsquote (%)					169,3421%		

Meldebogen EU LIQ2: Strukturelle Liquiditätsquote
31.03.2022

in Mio. EUR		a	b		c	d	e
		Keine Restlaufzeit	Ungewichteter Wert nach Restlaufzeit		6 Monate bis < 1 Jahr	≥ 1 Jahr	Gewichteter Wert
			< 6 Monate				
Posten der verfügbaren stabilen Refinanzierung (ASF)							
1	Kapitalposten und -instrumente	309,11	---	---	---	92,85	401,95
2	Eigenmittel	309,11	---	---	---	83,83	392,94
3	Sonstige Kapitalinstrumente		---	---	---	9,02	9,02
4	Privatkundeneinlagen		721,89	14,20	---	9,56	682,85
5	Stabile Einlagen		215,65	0,65	---	2,69	208,18
6	Weniger stabile Einlagen		506,24	13,55	---	6,86	474,67
7	Großvolumige Finanzierung:		3.233,56	420,00	---	1.356,99	2.674,43
8	Operative Einlagen		936,06	201,58	---	727,53	1.057,27
9	Sonstige großvolumige Finanzierung		2.297,51	218,42	---	629,46	1.617,16
10	Interdependente Verbindlichkeiten		330,44	1,75	---	18,57	---
11	Sonstige Verbindlichkeiten:	---	396,10	---	---	---	---
12	NSFR für Derivatverbindlichkeiten	---					
13	Sämtliche anderen Verbindlichkeiten und Kapitalinstrumente, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind		396,10	---	---	---	---
14	Verfügbare stabile Refinanzierung (ASF) insgesamt						3.759,23
Posten der erforderlichen stabilen Refinanzierung (RSF)							
15	Hochwertige liquide Vermögenswerte insgesamt (HQLA)						133,56
EU-15a	Mit einer Restlaufzeit von mindestens einem Jahr belastete Vermögenswerte im Deckungspool		20,51	42,74		1.073,11	965,91
16	Einlagen, die zu operativen Zwecken bei anderen Finanzinstituten gehalten werden		---	---		---	---
17	Vertragsgemäß bediente Darlehen und Wertpapiere:		623,13	89,44		890,66	1.020,84
18	Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch HQLA der Stufe 1 besichert, auf die ein Haircut von 0 % angewandt werden kann		---	---		---	---
19	Vertragsgemäß bediente Wertpapierfinanzierungs-geschäfte mit Finanzkunden, durch andere Vermögenswerte und Darlehen und Kredite an Finanzkunden besichert		278,57	9,74		144,45	177,17
20	Vertragsgemäß bediente Darlehen an nichtfinanzielle Kapitalgesellschaften, Darlehen an Privat- und kleine Geschäftskunden und Darlehen an Staaten und öffentliche Stellen, davon:		311,15	55,23		554,22	733,82
21	Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II		0,35	4,70		30,00	107,57
22	Vertragsgemäß bediente Hypothekendarlehen auf Wohnimmobilien, davon:		18,01	18,44		119,37	---
23	Mit einem Risikogewicht von höchstens 35 % nach dem Standardansatz für Kreditrisiko laut Basel II		10,70	14,37		96,16	---
24	Sonstige Darlehen und Wertpapiere, die nicht ausgefallen sind und nicht als HQLA infrage kommen, einschließlich börsengehandelter Aktien und bilanzwirksamer Posten für die Handelsfinanzierung		22,71	10,11		95,84	109,85
25	Interdependente Aktiva		332,36	1,75		16,66	---
26	Sonstige Aktiva	---	490,77	1,14		208,85	310,70
27	Physisch gehandelte Waren					---	---
28	Als Einschuss für Derivatekontrakte geleistete Aktiva und Beiträge zu Ausfallfonds von CCPs		---	---		67,41	57,30
29	NSFR für Derivateaktiva		56,70				56,70
30	NSFR für Derivatverbindlichkeiten vor Abzug geleisteter Nachschüsse		61,53				3,08
31	Alle sonstigen Aktiva, die nicht in den vorstehenden Kategorien enthalten sind		372,54	1,14		141,44	193,62
32	Außerbilanzielle Posten		466,31	13,25		50,05	9,42
33	RSF insgesamt						2.440,42
34	Strukturelle Liquiditätsquote (%)						154,0401%

Meldebogen EU CR3 - Übersicht über Kreditrisikominderungstechniken: Offenlegung der Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken
31.12.2022

	Unbesicherte Risikopositionen – Buchwert	Besicherte Risikopositionen – Buchwert				
		a	b	Davon durch Sicherheiten besichert c	Davon durch Finanzgarantien besichert	
					d	Davon durch Kreditderivate besichert e
in Mio. EUR						
1	Darlehen und Kredite	1.423,87	1.967,82	1.929,39	38,43	---
2	Schuldverschreibungen	1.886,12	75,79	---	75,79	---
3	Summe	3.309,99	2.043,61	1.929,39	114,22	---
4	<i>Davon notleidende Risikopositionen</i>	7,50	17,55	17,55	---	---
EU-5	<i>Davon ausgefallen</i>	---	---	---	---	---

Meldebogen EU REM1 - Für das Geschäftsjahr gewährte Vergütung

31.12.2022

		a	b	c	d
		Leitungsorgan - Aufsichtsfunktion	Leitungsorgan - Leitungsfunktion	Sonstige Mitglieder der Geschäftsleitung	Sonstige identifizierte Mitarbeiter
in Mio. EUR					
1		Anzahl der identifizierten Mitarbeiter	11	---	47
2		Feste Vergütung insgesamt	0,37	---	7,82
3		Davon: monetäre Vergütung	0,37	---	7,82
4		(Gilt nicht in der EU)			
EU-4a		Davon: Anteile oder gleichwertige Beteiligungen	---	---	---
	Feste Vergütung	Davon: an Anteile geknüpfte Instrumente oder gleichwertige nicht liquiditätswirksame Instrumente	---	---	---
5		Davon: andere Instrumente	---	---	---
EU-5x		(Gilt nicht in der EU)			
6		Davon: sonstige Positionen	---	---	---
7		(Gilt nicht in der EU)			
8			1,40	---	---
9		Anzahl der identifizierten Mitarbeiter	---	4	26
10		Variable Vergütung insgesamt	---	0,71	1,05
11		Davon: monetäre Vergütung	---	0,71	1,05
12		Davon: zurückbehalten	---	---	---
EU-13a		Davon: Anteile oder gleichwertige Beteiligungen	---	---	---
EU-14a		Davon: zurückbehalten	---	---	---
	Variable Vergütung	Davon: an Anteile geknüpfte Instrumente oder gleichwertige nicht liquiditätswirksame Instrumente	---	---	---
EU-13b		Davon: zurückbehalten	---	---	---
EU-14b		Davon: andere Instrumente	---	---	---
EU-14x		Davon: zurückbehalten	---	---	---
EU-14y		Davon: sonstige Positionen	---	---	---
15		Davon: zurückbehalten	---	---	---
16			---	---	---
17		Vergütung insgesamt (2 + 10)	0,37	5,32	8,87

Meldebogen EU REM2 - Sonderzahlungen an Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Instituts haben (identifizierte Mitarbeiter)
31.12.2022

in Mio. EUR		a	b	c	d
		Leitungsorgan - Aufsichtsfunktion	Leitungsorgan - Leitungsfunktion	Sonstige Mitglieder der Geschäftsleitung	Sonstige identifizierte Mitarbeiter
Garantierte variable Vergütung – Gesamtbetrag					
1	Gewährte garantierte variable Vergütung - Zahl der identifizierten Mitarbeiter	---	1	---	---
2	Gewährte garantierte variable Vergütung - Gesamtbetrag	---	0,06	---	---
3	Davon: während des Geschäftsjahres ausgezahlte garantierte variable Vergütung, die nicht auf die Obergrenze für Bonuszahlungen angerechnet wird	---	---	---	---
Die in früheren Zeiträumen gewährten Abfindungen, die während des Geschäftsjahres ausgezahlt wurden					
4	In früheren Perioden gewährte, während des Geschäftsjahres gezahlte Abfindungen – Anzahl der identifizierten Mitarbeiter	---	---	---	---
5	In früheren Perioden gewährte, während des Geschäftsjahres gezahlte Abfindungen – Gesamtbetrag	---	---	---	---
Während des Geschäftsjahres gewährte Abfindungen					
6	Während des Geschäftsjahres gewährte Abfindungen - Anzahl der identifizierten Mitarbeiter	---	---	---	---
7	Während des Geschäftsjahres gewährte Abfindungen - Gesamtbetrag	---	---	---	---
8	Davon: während des Geschäftsjahres gezahlt	---	---	---	---
9	Davon: zurückbehalten	---	---	---	---
10	Davon: während des Geschäftsjahres gezahlte Abfindungen, die nicht auf die Obergrenze für Bonuszahlungen angerechnet werden	---	---	---	---
11	Davon: höchste Abfindung, die einer einzigen Person gewährt wurde	---	---	---	---

Meldebogen EU REM4 - Vergütungen von 1 Mio. EUR oder mehr pro Jahr
31.12.2022

	EUR	a Identifizierte Mitarbeiter, die ein hohes Einkommen im Sinne von Artikel 450 Absatz 1 Buchstabe i CRR beziehen
1	1 000 000 bis unter 1 500 000	---
2	1 500 000 bis unter 2 000 000	1
3	2 000 000 bis unter 2 500 000	---
4	2 500 000 bis unter 3 000 000	---
5	3 000 000 bis unter 3 500 000	---
6	3 500 000 bis unter 4 000 000	---
7	4 000 000 bis unter 4 500 000	---
8	4 500 000 bis unter 5 000 000	---
9	5 000 000 bis unter 6 000 000	---
10	6 000 000 bis unter 7 000 000	---
11	7 000 000 bis unter 8 000 000	---

Meldebogen EU REM5 - Angaben zur Vergütung der Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeiten einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil des Instituts haben (identifizierte Mitarbeiter)

31.12.2022

		a	b	c	d	e	f	g	h	i	j
		Vergütung Leitungsorgan			Geschäftsfelder						
		Leitungsorgan - Aufsichtsfunktion	Leitungsorgan - Leitungsfunktion	Gesamtsumme Leitungsorgan	Investment Banking	Retail Banking	Vermögens- verwaltung	Unternehmens- funktionen	Unabhängige interne Kontroll- funktionen	Alle Sonstigen	Gesamt- summe
1	Gesamtanzahl der identifizierten Mitarbeiter										68
2	Davon: Mitglieder des Leitungsorgans	11	10	21							
3	Davon: sonstige Mitglieder der Geschäftsleitung				---	---	---	---	---	---	
4	Davon: sonstige identifizierte Mitarbeiter				7	---	15	14	6	5	
5	Gesamtvergütung der identifizierten Mitarbeiter	0,37	5,32	5,69	1,60	---	3,14	2,50	0,76	0,87	
6	Davon: variable Vergütung	---	0,71	0,71	0,09	---	0,80	0,15	0,01	0,00	
7	Davon: feste Vergütung	0,37	4,62	4,99	1,51	---	2,35	2,34	0,75	0,87	

Gesamtvergütung für alle Mitarbeiter gem. § 16 Abs. 2 InstitutsVergV

31.12.2022

	in Mio. EUR	^a Summe
1	Gesamtbetrag aller Vergütungen	74,34
2	Davon: Gesamte feste Vergütung ¹	71,82
3	Davon: Gesamte variable Vergütung ²	2,51
4	Anzahl Begünstigte variable Vergütung	96,00

¹ Die feste Vergütung inkludiert fixe Vergütungen an Leitungsorgane, mit denen 2022 Aufhebungsvereinbarungen über die Beendigung der Tätigkeit abgeschlossen wurden, für die relevante Vertragslaufzeit.

² In diesem Betrag sind Abfindungszahlungen an nicht als Risikoträger identifizierte Mitarbeiter inkludiert. Diese Zahlungen gelten zwar gem. § 5 Abs. 6 Satz 1 InstitutsVergV als variable Vergütung, fallen jedoch nicht in den Anwendungsbereich des § 7 InstitutsVergV.