Julius Bär

OFFENLEGUNGSBERICHT

DER

BANK JULIUS BÄR DEUTSCHLAND AG

ZUM 31. DEZEMBER 2021

nach Teil 8 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 26. Juni 2013 über Aufsichtsanforderungen an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen und zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 6486/2012, geändert durch Verordnung (EU) 2019/876 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 20. Mai 2019 zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 in Bezug auf die Verschuldungsquote, die strukturelle Liquiditätsquote, Anforderungen an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten, das Gegenparteiausfallrisiko, das Marktrisiko, Risikopositionen gegenüber zentralen Gegenparteien, Risikopositionen gegenüber Organismen für gemeinsame Anlagen, Großkredite, Melde- und Offenlegungspflichten und der Verordnung (EU) Nr. 648/2012 i. V. m. § 26a KWG

Inhaltsverzeichnis

1. Einführung und Anwendungsbereich....3
2. Schlüsselparameter nach Art. 447 CCR II i. V. m. Art. 1 Abs. 1 Durchführungsverordnung (EU) 2021/637....4
3. Bescheinigung des Vorstandes gemäß Art. 431 Abs. 3 CRR II....6

1. EINFÜHRUNG UND ANWENDUNGSBEREICH

1 Die Bank Julius Bär Deutschland AG, Frankfurt am Main, (im Folgenden nur noch Bank Julius Bär) ist gemäß Art. 6 Abs. 1 der zum 1. Januar 2014 in Kraft getretenen Verordnung (EU) Nr. 575/2013 („CRR"), geändert durch Verordnung (EU) 2019/876 („CRR II"), in Verbindung mit § 26a KWG verpflichtet, Informationen gem. Teil 8 Titel II der CRR II zu veröffentlichen. Die Anforderungen werden teilweise in EBA-Standards und EU-Verordnungen konkretisiert.

2 Der vorliegende Bericht dient zur Erfüllung der Offenlegungsanforderungen für die Bank Julius Bär zum 31. Dezember 2021. Die Offenlegung erfolgt gemäß dem in der Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 vorgesehenen Format.

3 Dabei ist die Bank Julius Bär mit einer Bilanzsumme von weniger als 5 Mrd. EUR gem. Art. 4 Abs. 1 Nr. 145 CRR ein „kleines und nicht komplexes Institut". Ferner ist die Bank gemäß Art. 4 Abs. 1 Nr. 148 CRR als „nicht börsennotiertes Institut" zu qualifizieren. Entsprechend der Regelungen des Art. 433 i. V. m. 433b Abs. 2 CRR hat die Bank Julius Bär daher ausschließlich jährlich die Schlüsselparameter nach Art. 447 CRR offenzulegen.

4 Die Bank Julius Bär hat Regelungen und Verfahren, die die Erfüllung der Offenlegungspflichten sicherstellen sollen, implementiert und diese in der Offenlegungsrichtilie dokumentiert. Die Offenlegungsrichtilinie umfasst insbesondere Festlegungen zu den Grundsätzen und dem Anwendungsbereich der Offenlegung, zur Offenlegungsfrequenz, -form und -medium, zu den wesentlichen Inhalten des Offenlegungsberichtes sowie den Aufgaben und Zuständigkeiten im Rahmen des Offenlegungsprozesses. Die Richtlinie ist regelmäßig (mindestens jährlich) zu überprüfen und bei Bedarf zu überarbeiten.

5 Die Angabe der quantitativen Informationen erfolgt auf Grundlage des festgestellten und vom Abschlussprüfer der Bank Julius Bär mit einem uneingeschränkten Bestätigungsvermerk versehenen Jahresabschlusses, der nach deutschem Handelsrecht (HGB) aufgestellt worden ist.

6 Vor seiner Veröffentlichung ist der Offenlegungsbericht dem verantwortlichem Vorstand vorzulegen und durch diesen zu genehmigen. Die Bescheinigung des Vorstandes gemäß Artikel 431 Abs. 3 CRR II befindet sich am Ende des Offenlegungsberichtes.

7 Der vorliegende Offenlegungsbericht ist ein zusätzliches Dokument neben dem Geschäftsbericht, welcher Bilanz, Gewinn- und Verlustrechnung, Anhang sowie den Lagebericht der Gesellschaft beinhaltet. Er fasst die notwendigen quantitativen und qualitativen Informationen auf Einzelbasis zusammen, da das Institut nach § 290 Abs. 5 HGB von der Aufstellung eines handelsrechtlichen Konzernabschlusses befreit ist und keine Anteile an konsolidierungspflichtigen Tochterunternehmen im Sinne des Artikels 18 CRR hält. Unterschiede zwischen der Konsolidierungsbasis für Rechnungslegungs- und Aufsichtszwecke ergeben sich daher nicht.

8 Die Veröffentlichung des Offenlegungsberichtes der Bank Julius Bär erfolgt auf der Homepage der Julius Bär Gruppe im Rahmen der CRR-Vorgaben mindestens jährlich.

2. SCHLÜSSELPARAMETER NACH ART. 447 CCR II I. V. M. ART. 1 ABS. 1 DURCHFÜHRUNGSVERORDNUNG (EU) 2021/637

9 Entsprechend der Regelungen des Art. 433 i. V. m. 433b Abs. 2 CRR werden im Folgenden die Schlüsselparameter nach Art. 447 CRR offengelegt:

Meldebogen EU KM1 – Schlüsselparameter (Beträge in TEUR)

		Stichtag der Offenlegung	
		31.12.2021	31.12.2020
	Verfügbare Eigenmittel (Beträge)		
1	Hartes Kernkapital (CET1)	111.240	104.033
2	Kernkapital (T1)	111.240	104.033
3	Gesamtkapital	111.240	104.033
	Risikogewichtete Positionsbeträge		
4	Gesamtrisikobetrag	426.359	382.137
	Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)		
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	26,09	27,22
6	Kernkapitalquote (%)	26,09	27,22
7	Gesamtkapitalquote (%)	26,09	27,22
	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 (%)	4,00	4,00
EU 7b	Davon: in Form von CET1vorzuhalten (Prozentpunkte)	2,25	2,25
EU 7c	Davon: in Form von T1vorzuhalten (Prozentpunkte)	3,00	3,00
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	12,00	12,00
	Kombinierte Kapitalpuffer- und Gesamtkapitalanforderung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)		
8	Kapitalerhaltungspuffer (%)	2,50	2,5
EU 8a	Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats (%)	-	-
9	Institutsspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	-	-
EU 9a	Systemrisikopuffer (%)	-	-
10	Puffer für global systemrelevante Institute (%)	-	-
EU 10a	Puffer für sonstige systemrelevante Institute (%)	-	-
11	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (%)	2,50	2,50
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	14,50	14,50
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1(%)	49.418	48.623

Meldebogen EU KM1 – Schlüsselparameter (Beträge in TEUR) - Fortsetzung

		Stichtag der Offenlegung	
		31.12.2021	31.12.2020
	Verschuldungsquote		
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	2.044.326	1685.363
14	Verschuldungsquote (%)	5,44	6,17
	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)		
EU 14a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	-	-
EU 14b	Davon: in Form von CET1vorzuhalten (Prozentpunkte)	-	-
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	3,00	-
	Anforderung für den Puffer bei der Verschuldungsquote und die Gesamtverschuldungsquote (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)		
EU 14d	Puffer bei der Verschuldungsquote (%)	-	-
EU 14e	Gesamtverschuldungsquote (%)	3,00	-
	Liquiditätsdeckungsquote [1)]		
15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	684.926	-
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	437.029	-
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	246.650	-
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	190.376	-
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	359,78	-
	Strukturelle Liquiditätsquote [2)]		
18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	1278.158	-
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	512.100	-
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	249,59	-

[1)] Mit Einführung der CRR II ist die Liquiditätsdeckungsquote (kurz: LCR) erstmalig zum 31.12.2021 offenzulegen. Gemäß den Erläuterungen der Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 zum Meldebogen EU KM1 brauchen bei der erstmaligen Offenlegung von Daten keine Daten für Vorperioden offengelegt zu werden. Daher ist kein Vorjahreswert für 2020 angegeben.

[2)] Mit Einführung der CRR II ist die strukturelle Liquiditätsquote (kurz: NSFR) erstmalig zum 31.12.2021 offenzulegen. Ferner wurde mit der CRR II die NSFR grundlegend überarbeitet und erstmalig als konkrete Mindestquote etabliert. Gemäß den Erläuterungen der Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 zum Meldebogen EU KM1 brauchen bei der erstmaligen Offenlegung von Daten keine Daten für Vorperioden offengelegt zu werden. Daher ist kein Vorjahreswert für 2020 angegeben.

3. BESCHEINIGUNG GEMÄß ART. 431 ABS. 3 CRR II

10 Die Bank Julius Bär Deutschland AG bescheinigt, dass der vorliegende Offenlegungsbericht im Einklang mit den in der Bank Julius Bär implementierten förmlichen Verfahren und internen Abläufen, Systemen und Kontrollen zur Erfüllung der Offenlegungspflichten gemäß Teil 8 der CRR II erstellt wurde.

Frankfurt , den 18.10.2022

Thomas Falk

Mitglied des Vorstands

Axel Krellmann

Head Finance & Controlling

Impressum

Bank Julius Bär Deutschland AG
An der Welle 1
60322 Frankfurt am Main

Aufsichtsratsvorsitzender: Christian E. Dubler, Zürich;
Vorstand: Heiko Schlag (Vorsitzender), Thomas Falk

Handelsregister: Frankfurt am Main, NR. HR B 31022, Steuernummer: 04722012150, USt0IdNr.: DE 114103792

Sitz der Gesellschaft: 60322 Frankfurt am Main, Deutschland