

OFFENLEGUNGSBERICHT

zum 30.06.2021

gemäß Teil 8 der CRR

1	Vorwort	3
2	Schlüsselparameter der Warburg FH Gruppe	3

1 VORWORT

Die M.M.Warburg & CO Gruppe GmbH ist eine Finanzholding-Gesellschaft im Sinne des Artikel 4 Abs. 1 Nr. 20 CRR. Die Offenlegung wird gemäß Artikel 11 Abs. 1 CRR in Verbindung mit § 10a Abs. 1 KWG durch die M.M.Warburg & CO (AG & Co.) KGaA (LEI: MZI1VDH2BQLFZGLQDO60) als dem aufsichtsrechtlich übergeordneten Unternehmen der Warburg FH Gruppe, vorgenommen. Sie erfolgt grundsätzlich in konsolidierter Form auf Ebene der Warburg FH Gruppe.

Die M.M.Warburg & CO Finanzholding-Gruppe (nachfolgend: „Warburg FH Gruppe“) wird unter Berücksichtigung des Art. 4 Abs. 1 Nr. 145 („kleines und nicht komplexes Institut“) und Nr. 146 („großes Institut“) in die Kategorie „andere Institute“ eingestuft.

Im aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis Warburg FH Gruppe befindet sich ein kapitalmarktorientiertes Tochterinstitut, folglich gilt die Warburg FH Gruppe aufsichtsrechtlich als kapitalmarktorientiert und ist zur Offenlegung der Anforderungen aus Art. 433c Abs. 1 CRR verpflichtet.

Der Umfang der halbjährlichen Offenlegung beschränkt sich auf den Art. 447 CRR und beinhaltet die Offenlegung der Schlüsselparmeter auf konsolidierter Ebene der Warburg FH Gruppe gemäß Anhang I und II der Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 der Kommission vom 15. März 2021.

Die Angaben zum risikogewichteten Positionsbetrag in dem vorliegenden, verkürzten Offenlegungsbericht wurde auf Basis der folgenden Methoden ermittelt:

Risikoart	Angewendeter Ansatz
Adressenausfallsrisiko	Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)
Gegenparteiausfallrisiko	Standardansatz für das Gegenparteiausfallrisiko (SA-CCR)
Marktpreisrisiken	Marktbewertungsmethode
Operationelle Risiken	Basisindikatoransatz (BIA)

Die strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) wird von allen Instituten nach dem Standardansatz gem. den Vorgaben aus Teil 6, Titel IV Kapitel 1 bis 5 ermittelt. Die Warburg FH Gruppe bilanziert nach den Vorschriften des Handelsgesetzbuches (HGB).

Die im Offenlegungsbericht veröffentlichten Zahlenangaben sind in der Berichtswährung EUR und gerundet auf Mio. angegeben.

2 SCHLÜSSELPARAMETER DER WARBURG FH GRUPPE

Die nachfolgende Tabelle stellt eine Übersicht über die wesentlichen Kennzahlen der Warburg FH Gruppe auf konsolidierter Ebene per Stichtag 30. Juni 2021 dar.

Die Beträge sind in der Berichtswährung EUR in der Einheit Millionen angegeben.

Die hier vorliegende Offenlegung per 30. Juni 2021 ist erstmalig unter den durch die CRR II geänderten Anforderungen, sodass keine Daten für die Vorperioden offengelegt werden müssen.

EU KM 1 - Schlüsselparameter

		T
		30.06.2021
Verfügbare Eigenmittel (Beträge)		
1	Hartes Kernkapital (CET1)	258,20
2	Kernkapital (T1)	302,29
3	Gesamtkapital	389,99
Risikogewichtete Positionsbeträge		
4	Gesamtrisikobetrag	2.785,43
Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)		
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	9,2696%
6	Kernkapitalquote (%)	10,8526%
7	Gesamtkapitalquote (%)	14,0011%
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 (%)	4,4200%
EU 7b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	2,4863%
EU 7c	Davon: in Form von T1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	3,3150%
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	12,4200%
Kombinierte Kapitalpuffer- und Gesamtkapitalanforderung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)		
8	Kapitalerhaltungspuffer (%)	2,5000%
EU 8a	Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats (%)	0,0000%
9	Institutsspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	0,0364%
EU 9a	Systemrisikopuffer (%)	0,0000%
10	Puffer für global systemrelevante Institute (%)	0,0000%
EU 10a	Puffer für sonstige systemrelevante Institute (%)	0,0000%
11	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (%)	0,0000%
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	0,0000%
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1 (%)	24,6328%
Verschuldungsquote		
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	7.004,78
14	Verschuldungsquote (%)	4,3155%
Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)		
EU 14a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	0,0000%
EU 14b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	0,0000%
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	0,0000%
Anforderung für den Puffer bei der Verschuldungsquote und die Gesamtverschuldungsquote (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)		
EU 14d	Puffer bei der Verschuldungsquote (%)	0,0000%
EU 14e	Gesamtverschuldungsquote (%)	0,0000%
Liquiditätsdeckungsquote		
15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	2.024,14
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	1.159,66
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	88,15
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	1.071,51
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	189,0100%
Strukturelle Liquiditätsquote		
18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	4.263,46
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	3.126,60
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	136,3609%