

Offenlegungsbericht der Fondsdepot Bank 2021

Nach Teil 8 der Verordnung über Aufsichtsanforderungen
an Kreditinstitute und Wertpapierfirmen Capital Requirements Regulation (CRR)

zum 31. März 2021



Inhaltsverzeichnis

- 1 Einführung
- 2 Schlüsselparameter

Abkürzungsverzeichnis

- CRR** Capital Requirements Regulation
- KWG** Gesetz über das Kreditwesen (Kreditwesengesetz)
- SREP** Supervisory Review and Evaluation Process
- Tsd.** Tausend

1 Einführung

Die Fondsdepot Bank GmbH (im Folgenden „Bank“) unterliegt der Verpflichtung zur Offenlegung nach §26a KWG i.V.m. Artikel 433 ff. der Verordnung (EU) Nr. 2019/876 vom 20. Mai 2019 (Capital Requirements Regulation, CRR II).

Der Sitz der Bank ist in Hof (Saale), Windmühlenweg 12. Die Bank betreibt Betriebsstätten in Aschheim, Karl-Hammerschmidt-Str. 34, sowie in Eschborn, Alfred-Herrhausen-Allee 3-5. Alleiniger Anteilseigner der Bank ist die Xchanging Hold-Co No. 3, Aldershot (Großbritannien). Hierbei handelt es sich um eine reine Beteiligungsgesellschaft der DXC Technology Company (DXC), Tysons, Virginia, USA.

Dieser Offenlegungsbericht wurde nach den Vorgaben aus Teil 8 Artikel 431 ff. CRR II auf Einzelbasis erstellt. Die Pflicht-

angaben zur Offenlegung ergeben sich für nicht börsennotierte kleine und nicht komplexe Institute gem. Artikel 433b II CRR II und beschränken sich auf die Schlüsselparameter gem. Artikel 447 CRR II.

Seit dem Geschäftsjahr 2014 erfolgt die Offenlegung auf der Webseite der Bank (<https://www.fondsdepotbank.de/service/downloads/>). Die Bekanntgabe der Offenlegung erfolgt im elektronischen Bundesanzeiger.

Die Offenlegung durch die Bank erfolgt jährlich und spätestens vier Wochen nach Veröffentlichung des Jahresabschlusses. Die im Bericht enthaltenen quantitativen Angaben beziehen sich auf den Stichtag 31. März 2021.

2 Schlüsselparameter

Die nachfolgende Tabelle enthält Angaben zu Schlüsselparametern gem. Artikel 447 CRR II. Die vorliegende Offenlegung wurde erstmalig unter den durch die CRR II geänderten Anforderungen, sowie den Anforderungen der Durchführungsver-

ordnung (EU) 2021/637 vom 15. März 2021 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Offenlegung der in Teil 8 Titel II und III der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 genannten Informationen, erstellt.

EU KM1: Schlüsselparameter

in Tsd. EUR		31.03.2021	31.03.2020
Verfügbare Eigenmittel (Beträge)			
1	Hartes Kernkapital (CET1)	32.286	34.920
2	Kernkapital (T1)	32.286	34.920
3	Gesamtkapital	32.286	34.920
Risikogewichtete Positionsbeträge			
4	Gesamtrisikobetrag	146.827	132.635
Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)			
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	21,99	26,33
6	Kernkapitalquote (%)	21,99	26,33
7	Gesamtkapitalquote (%)	21,99	26,33
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 (%)	2,00	2,00
EU 7b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	1,13	1,13
EU 7c	Davon: in Form von T1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	1,50	1,50
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	10,00	10,00
Kombinierte Kapitalpuffer- und Gesamtkapitalanforderung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)			
8	Kapitalerhaltungspuffer (%)	2,50	2,50
EU 8a	Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats (%)	0,00	0,00
9	Institutsspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	0,69	0,40
EU 9a	Systemrisikopuffer (%)	0,00	0,00
10	Puffer für global systemrelevante Institute (%)	0,00	0,00
EU 10a	Puffer für sonstige systemrelevante Institute (%)	0,00	0,00
11	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (%)	3,19	2,90
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	13,19	12,90
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1 (%)	11,99	16,33
Verschuldungsquote			
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	453.907	346.048
14	Verschuldungsquote (%)	7,11	10,09
Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)			
EU 14a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	0,00	0,00
EU 14b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	0,00	0,00
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	3,00	3,00
Anforderung für den Puffer bei der Verschuldungsquote und die Gesamtverschuldungsquote (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)			
EU 14d	Puffer bei der Verschuldungsquote (%)	0,00	0,00
EU 14e	Gesamtverschuldungsquote (%)	3,00	3,00
Liquiditätsdeckungsquote			
15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	264.541	161.166
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	28.469	18.321
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	65.076	51.421
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	7.117	4.580
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	3.716,89	3.518,79
Strukturelle Liquiditätsquote			
18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	421.013	312.788
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	60.634	57.660
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	694,35	542,47

Weitere Informationen finden Sie unter:
www.fondsdepotbank.de

Für Fragen rund um Ihr Depot wenden Sie sich an:



09281 7258-3000



info@fondsdepotbank.de



**Fondsdepot Bank GmbH
95025 Hof**