

Landesbank Berlin AG | Berliner Sparkasse

2017

Offenlegungsbericht
nach CRR zum 31. Dezember 2017



Inhalt

1. Einleitung und allgemeine Hinweise	3
1.1 Häufigkeit der Offenlegung (Artikel 433)	3
2. Eigenmittel (Artikel 437 CRR)	4
2.1 Eigenkapitalüberleitungsrechnung	4
2.2 Begebene Kapitalinstrumente	5
2.3 Art und Beträge der Eigenmittelelemente	5
3. Eigenmittelanforderungen (Artikel 438 CRR)	6
3.1 Internes Kapitalmanagement	6
3.2 Übersicht über die Eigenmittelanforderungen	6
3.2.1 Eigenmittelanforderung nach Risikoarten	6
3.2.2 Eigenmittelanforderung für das Kreditrisiko	6
3.2.3 Eigenmittelanforderungen für Marktpreisrisiken	8
3.2.4 Eigenmittelanforderungen für Operationelle Risiken	8
4. Kapitalpuffer (Artikel 440 CRR)	9
5. Kreditrisikoanpassungen (Artikel 442)	11
5.1 Definition überfällig und notleidend (Artikel 442 a)	11
5.2 Ansätze und Methoden der Kreditrisikoanpassungen (Artikel 442 b)	11
5.3 Risikopositionen (Artikel 442c–i)	12
5.3.1 Betrag der Risikopositionen	12
5.3.2 Wertgeminderte und überfällige Risikopositionen (Artikel 442 g–i)	17
6. Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken (Artikel 453 CRR)	19
7. Vergütungspolitik (Artikel 450 CRR)	21
8. Verschuldung/Leverage Ratio (Artikel 451 CRR)	21
9. Anhang	25
9.1 Abkürzungsverzeichnis	25
9.2 Hauptmerkmale sowie vollständige Bedingungen der begebenen Kapitalinstrumente	26
9.3 Art und Beträge der Eigenmittelelemente	49
9.4 Tabellenverzeichnis	57

1. Einleitung und allgemeine Hinweise

Die durch den Baseler Ausschuss unter dem Begriff „Basel III“ veröffentlichten Regelungen zur angemessenen Eigenkapitalausstattung international tätiger Banken bestehen aus drei sich ergänzenden Säulen (Mindestkapitalanforderungen, internes Risikomanagement sowie Überprüfungsverfahren der Bankenaufsicht, Offenlegung). Mit der dritten Säule verfolgt die Aufsicht das Ziel, die Marktdisziplin zu erhöhen, indem Marktteilnehmern umfassende Informationen zum Risikoprofil eines Instituts zugänglich gemacht werden.

Seit dem 1. Januar 2014 gelten in der gesamten Europäischen Union die Offenlegungsanforderungen der Capital Requirements Regulation (CRR). Der im Januar 2015 vom Basel Committee of Banking Supervision veröffentlichte Standard „Revised Pillar 3 disclosure requirements“ (BCBS 309) wurde am 14. Dezember 2016 als „Guidelines on disclosure requirements under Part Eight of Regulation (EU) 575/2013“ (EBA/GL/2016/11) in EU-Recht umgesetzt. Ab dem Jahresende 2017 sind deren Anforderungen an die Berichterstattung von den in der Leitlinie benannten Gruppen und Instituten im ebenda benannten Umfang zu erfüllen.

Alle Angaben entsprechen dem Stand der aufsichtsrechtlichen Meldungen zum Stichtag 31. Dezember des Berichtsjahres. Davon abweichend erfolgen die Angaben zu Kreditrisikoanpassungen (Art. 442) auf Basis des festgestellten Jahresabschlusses. Aus rechentechnischen Gründen können in den Tabellen Rundungsdifferenzen in Höhe von +/- einer Einheit (€, % usw.) auftreten.

Die Offenlegung der Landesbank Berlin AG (LBB) erfolgt auf Einzelinstitutsebene. Sie ist eine Tochter der Landesbank Berlin Holding AG (LBBH) und ist in die aufsichtsrechtliche Gruppe der Erwerbsgesellschaft der S-Finanzgruppe mbH & Co. KG (SEG) eingebunden. Sie wird als bedeutendes Tochterunternehmen in der aufsichtsrechtlichen Gruppe angesehen. Sie veröffentlicht gemäß Artikel 13 CRR einen eigenen Offenlegungsbericht, der die dort geforderten Angaben des Teils 8, die für bedeutende Tochterunternehmen zu veröffentlichen sind, enthält. Die Angaben zur Vergütung werden in einem separaten Bericht veröffentlicht. Weitere Veröffentlichungen nach § 26a KWG sind bis auf die Kapitalrendite (vgl. Kapitel 3.3) im Jahresabschluss der LBB, weitere Angaben zu den Risiken im Lagebericht der LBB, Teil Risikobericht zu finden. Für die SEG-Gruppe erfolgt ein separater Offenlegungsbericht.

1.1 Häufigkeit der Offenlegung (Artikel 433)

Der Offenlegungsbericht wird regulär einmal jährlich parallel zum Lagebericht der LBB (Einzelabschluss nach HGB-Rechnungslegung) im Internet als eigenständiger Bericht veröffentlicht. Basis des Zahlenwerks ist – sofern nicht anders angegeben – das HGB, da dies die Grundlage für die Erstellung der CRR-Meldungen in der SEG-Gruppe ist.

Regelmäßig wird zum Halbjahr geprüft, ob es nötig ist, die erforderlichen Angaben ganz oder in Teilen häufiger als jährlich zu veröffentlichen. Die Prüfung zum 30. Juni 2017 unter Berücksichtigung des Artikels 433 der CRR und der korrespondierenden EBA-Leitlinie hat ergeben, dass eine jährliche Veröffentlichung ausreichend ist.

Die Veränderung der Bilanzsumme der LBB wurde im Zwischenbericht der LBB zum 30.06.2017 erläutert. Das Spektrum der Tätigkeit der LBB ist im Vergleich zum 31.12.2016 gleich geblieben. Es wurde im Zwischenbericht zum 30.06.2017 (Schwerpunkt der Geschäftstätigkeit) beschrieben.

Die Eigenmittel, die Eigenmittelunterlegung und die Risikolage der LBB haben sich nur unwesentlich verändert. Kennzahlen wurden im Zwischenbericht zum 30.06.2017 veröffentlicht.

Im Zwischenbericht der LBB wurden wichtige ökonomische und aufsichtsrechtliche Zahlen dargelegt.

2. Eigenmittel (Artikel 437 CRR)

2.1 Eigenkapitalüberleitungsrechnung

Die in der CRR geforderte vollständige Abstimmung der aufsichtsrechtlichen Kapitalposten mit den relevanten Bilanzposten ist in der folgenden Tabelle dargestellt:

Tabelle 1: Eigenmittelüberleitungsrechnung

in Mio. €	FINREP 31.12.2016	COREP 31.12.2017
Kapital gemäß Finrep	2.259	2.259
<i>davon gezeichnetes Kapital</i>	1.200	1.200
<i>davon Kapitalrücklage</i>	920	920
<i>davon Gewinnrücklage</i>	41	41
<i>davon Fonds für allgemeine Bankrisiken</i>	98	98
Überleitungskorrekturen		
<i>Immaterielle Vermögenswerte</i>		-23
Hartes Kernkapital		2.236
Zusätzliches Kernkapital		0
Kernkapital		2.236
Ergänzungskapital		405
<i>davon Nachrangkapital</i>	845	845
Überleitungskorrekturen		
<i>Verringerte Anrechnung des Nachrangkapitals</i>		-510
<i>Wertberichtigungsüberschuss (Excess)</i>		61
<i>Allgemeine Kreditrisikoanpassungen nach Standardansatz</i>		10
<i>Abzug für Instrumente des Ergänzungskapitals von Unternehmen der Finanzbranche</i>		-1
Eigenmittel LBB		2.641

Die Daten entstammen den Bilanzpositionen des geprüften Jahresabschlusses 2016 sowie den aufsichtsrechtlichen Meldungen zu den Eigenmitteln per 31. Dezember 2017. In der LBB werden unterjährige Abschlüsse nicht testiert. Somit dient als Grundlage der Bestimmung der Eigenmittel der testierte Jahresabschluss per 31.12.2016.

Das Ergänzungskapital der Bank bildet sich im Wesentlichen aus nachrangigen Kapitalinstrumenten. In dieser Kapitalkategorie darf sich ein Institut nur nachrangige Verbindlichkeiten mit einer Restlaufzeit von mehr als fünf Jahren vollständig im Ergänzungskapital anrechnen. Bei einer Restlaufzeit von weniger als fünf Jahren unterliegen diese Papiere einer taggenauen

Amortisation und somit einer verminderten Anrechenbarkeit bei den Eigenmitteln. Die nachrangigen Verbindlichkeiten im Bestand der LBB weisen unterschiedliche Restlaufzeiten aus. Der überwiegende Teil hat dabei eine Restlaufzeit von weniger als fünf Jahren und unterliegt somit einer anteiligen Anrechnung bei den Eigenmitteln. Die über die LBB Finance emittierten Nachranginstrumente entsprechen nicht den Anforderungen der CRR und müssen, unabhängig von den Restlaufzeiten, sofort ratierlich jährlich abgeschrieben werden. Durch die taggenaue Amortisation sowie die teilweise Behandlung von nachrangigen Verbindlichkeiten gemäß Phase-Out ergibt sich ein Unterschiedsbetrag von 510 Mio. € gegenüber dem bilanziell ausgewiesenen Nachrangkapital.

2.2 Begebene Kapitalinstrumente

Die LBB hat 22 Kapitalinstrumente begeben. Die Hauptmerkmale und Vertragsbedingungen sind je Kapitalinstrument im Anhang (ab Seite 26) angegeben. Die in Artikel 437 Abs. 1c CRR geforderte Veröffentlichung aller Bedingungen der Kapitalinstrumente

ist für die börsennotierten Emissionen unter dem Link <http://www.lbb.de/berichte> veröffentlicht. Die entsprechenden Bedingungen für alle anderen nachrangigen Emissionen können bei der LBB AG angefordert werden.

2.3 Art und Beträge der Eigenmittelelemente

Die detaillierte Aufstellung der Eigenmittelelemente gemäß CRR ist dem Anhang (ab Seite 49) zu entnehmen. Die LBB nutzt derzeit nur für Nachranginstrumenten-

te, die die Anforderungen der CRR nicht vollständig erfüllen, die Übergangsregeln gemäß der CRR.

Tabelle 2: Eigenkapitalelemente nach Feststellung des Jahresabschlusses, Kurzfassung

per 31.12.2017 in Mio. € bzw. %	LBB		
	CRR-Meldung	nach Feststellung Jahresabschluss	Delta
Hartes Kernkapital (CET1)	2.236	2.280	44
Ergänzungskapital (T2)	405	408	3
Eigenkapital insgesamt (TC = T1 + T2)	2.641	2.688	47
Risikogewichtete Aktiva	12.818	12.818	0
Harte Kernkapitalquote (CET1 capital ratio)	17,4 %	17,8%	0,4 %
Gesamtkapitalquote	20,6 %	21,0%	0,4 %

Die Veränderungen im harten Kernkapital resultieren vornehmlich aus der Erhöhung der Rücklagen nach § 340g HGB, die im Ergänzungskapital aus Kreditrisikoplanpassungen für KSA-Positionen nach Artikel 62 CRR.

Die Kapitalrendite gemäß § 26a KWG, berechnet als Quotient aus Nettogewinn (Jahresüberschuss) und Bilanzsumme, beträgt für die LBB/BSK 0 %. Dies resultiert aus dem bestehenden Ergebnisabführungsvertrag mit dem Mutterunternehmen LBBH.

3. Eigenmittelanforderungen (Artikel 438 CRR)

3.1 Internes Kapitalmanagement

Zentrale Steuerungsgrößen zur Eigenkapitalverteilung innerhalb der LBB sind die harte Kernkapitalquote und die ökonomische Risikotragfähigkeit. Die Feinsteuerung erfolgt über die Definition von Obergrenzen zum gebundenen aufsichtsrechtlichen Kernkapital und von Limiten für das ökonomische Risiko.

Die Risikotragfähigkeitsanalyse ist ein wesentlicher Bestandteil der Gesamtbanksteuerung und des Internal Capital Adequacy Assessment Process (ICAAP) der LBB. Zielsetzung ist die fortlaufende Sicherstellung einer für das Risikoprofil der LBB angemessenen Kapitalausstattung zur Sicherstellung der dauerhaften Überlebensfähigkeit. Die Überwachung der Risikotragfähigkeit erfolgt auf Basis eines sogenannten Liquidationsansatzes („gone-concern“), dessen grundlegendes Sicherungsziel der Schutz der erstrangigen Fremdkapitalgeber ist.

Das interne Risikotragfähigkeitskonzept stellt die interne ökonomische Risikodeckungsmasse den eingegangenen Risiken gegenüber. Die interne Risiko-

deckungsmasse der LBB basierte im Berichtsjahr auf den aufsichtsrechtlichen Eigenmitteln, somit einem Bilanz- und GuV-orientierten Ansatz. Korrekturposten entsprechend der Vorgaben des International Capital Adequacy Assessment Process (ICAAP) wie zum Beispiel für stille Lasten wurden berücksichtigt. Die Risiken der S-Kreditpartner GmbH (SKP) als einziger wesentlicher Tochter der LBB fließen in die Berechnung der Risikotragfähigkeit angemessen mit ein. Im Jahr 2017 wurden Anpassungen des Risikotragfähigkeitskonzeptes vorgenommen. Im Wesentlichen handelt es sich dabei um die Berücksichtigung der HGB 340f-Reserven und Sonderposten nach HGB 340g.

Zur Sicherstellung der Risikotragfähigkeit bestehen ein Limitsystem und davon abgeleitete Eskalationsprozesse. Sollte es zu einer Annäherung an eines der Limite kommen, das heißt in der Regel zu einer Risikoauslastung von mehr als 90 %, entscheidet der Vorstand über Maßnahmen, um Limitüberschreitungen zu verhindern.

3.2 Übersicht über die Eigenmittelanforderungen

Die im Folgenden dargestellten Werte zu den Eigenmittelanforderungen beziehen sich auf den Meldestichtag.

3.2.1 Eigenmittelanforderung nach Risikoarten

Tabelle 3: Eigenmittelanforderung nach Risikoarten

per 31.12.2017	
in Mio. €	LBB
Adressenausfallrisiken	930
Abwicklungsrisiken	0
Marktrisikopositionen	0
Operationelle Risiken	83
CVA Risk Charge	13
Sonstige Forderungsbeiträge	0
LBB	1.025

3.2.2 Eigenmittelanforderung für das Kreditrisiko

Die LBB hat für die Berechnung der Eigenmittelanforderung die Zulassung zur Nutzung des auf internen Ratings basierenden Ansatzes (IRBA) erhalten. Für den wesentlichen Teil des Gesamtportfolios findet der IRBA Anwendung. Beim IRBA erfolgt die Berechnung der Eigenmittelanforderung in aufsichtsrechtlich genehmigten Verfahren gemäß einer internen Bonitätseinschätzung. Für das Mengengeschäft wird der IRB Retail Ansatz verwendet.

Einige Portfolios, die noch keine IRB-Zulassung haben beziehungsweise die dauerhaft aus der Anwendung des IRBA ausgenommen werden können, berücksichtigt die LBB nach dem Kreditrisiko-Standardansatz (KSA).

Teilweise resultiert daraus eine differenzierte Darstellung der Adressenausfallrisiken in den folgenden und in Abschnitt 4 und 5 dargestellten Tabellen nach den verschiedenen Ansätzen.

Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)

Die LBB nutzt das Grandfathering für geeignete Beteiligungen und weist diese in der KSA-Forderungsklasse Beteiligungen aus.

Tabelle 4: Eigenmittelanforderungen KSA nach Forderungsklassen

per 31.12.2017	
in Mio. €	LBB
Zentralstaaten oder Zentralbanken	0
Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	0
Öffentliche Stellen	0
Multilaterale Entwicklungsbanken	0
Internationale Organisationen	0
Institute	2
Unternehmen	9
Mengengeschäft	81
Durch Immobilien besicherte Risikopositionen	0
Ausgefallene Risikopositionen	3
Mit besonders hohen Risiken verbundene Risikopositionen	0
Gedeckte Schuldverschreibungen	0
Verbriefungen	0
<i>davon Wiederverbriefungen</i>	0
Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	0
Anteile an Organismen für Gemeinsame Anlagen (OGA)	15
Beteiligungen	5
Sonstige Positionen	0
Kreditrisiko-Standardansatz (KSA)	116

Auf internen Ratings basierender Ansatz (IRBA)

Tabelle 5: Eigenmittelanforderungen IRBA nach Forderungsklassen

per 31.12.2017	
in Mio. €	LBB
Zentralstaaten und Zentralbanken	13
Institute	75
Unternehmen	
KMU	109
Spezialfinanzierungen	0
Sonstige	420
Mengengeschäft	
KMU (durch Immobilien besichert)	10
grundpfandrechtl. besichert	21
qualifizierte revolving Positionen	50
sonstige Positionen KMU	20
sonstige Positionen	36
Beteiligungen	29
<i>davon einfacher Risikogewichtsansatz</i>	2
<i>davon PD/LGD-Ansatz</i>	24
<i>davon internes Modell</i>	0
<i>davon risikogewichtete Beteiligungspositionen</i>	3
Verbriefungen	13
<i>davon Wiederverbriefungen</i>	0
Sonstige Aktiva (keine Kreditverpflichtung)	18
IRBA	814

Aus Materialitätsgründen (Art. 432 CRR und EBA Guideline 2014/14) verzichtet die LBB auf weitere Detaildarstellungen bezüglich der Beteiligungspositionen.

3.2.3 Eigenmittelanforderungen für Marktpreisrisiken

Durch das Agieren als Bankbuchinstitut erfolgt die Ermittlung der Kapitalunterlegung der aufsichtsrechtlichen Marktrisikoposition lediglich für die Fremdwährungsposition des Anlagebuchs im Standardansatz. Da die Fremdwährungsposition den Wert von 2 % des Gesamtbetrags der Eigenmittel nicht überschritt, ergab sich nach Artikel 351 CRR keine Eigenmittelanforderung für das Fremdwährungsrisiko.

3.2.4 Eigenmittelanforderungen für Operationelle Risiken

Für die aufsichtsrechtliche Eigenmittelanforderung verwendet die Gruppe ein fortgeschrittenes Messmodell gemäß Artikel 321 ff CRR.

Tabelle 6: Eigenmittelanforderung Operationelle Risiken

per 31.12.2017	
in Mio. €	LBB
Basisindikatoransatz	0
Standardansatz	0
Fortgeschrittener Messansatz (AMA)	83
Operationelle Risiken	83

4. Kapitalpuffer (Artikel 440 CRR)

Seit dem 1. Januar 2016 gelten die Vorgaben zum anti-zyklischen Kapitalpuffer (Countercyclical Capital Buffer, CCB). Er errechnet sich aus der Quote des institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffers und dem Gesamtrisikobetrag nach Artikel 92 Absatz 3 der CRR. Er ist in Form von hartem Kernkapital vorzuhalten.

Die zur Berechnung der institutsspezifischen Quote zu verwendenden länderspezifischen Quoten werden je Land von der nationalen Aufsicht festgelegt. Sie liegen zwischen 0 % und 2,5 %, in Ausnahmefällen auch darüber.

Tabelle 7 zeigt die Kreditrisikopositionen, die Eigenmittelanforderungen nach Teil 3, Titel II und III der CRR, den jeweiligen landesbezogenen Anteil an der Gesamtsumme der Eigenmittelanforderungen sowie die je Land festgesetzte Quote des antizyklischen Kapitalpuffers. Der Geschäftsschwerpunkt der LBB in Deutschland ist deutlich zu erkennen. Da die LBB keine Positionen im Handelsbuch mehr besitzt, werden die Spalten für diese Risikopositionen (030, 040 und 080) ausgeblendet.

Tabelle 7: Geografische Verteilung der wesentlichen Kreditrisikopositionen

Zeile		Kreditrisiko in Mio. €		Verbriefungs- risiko- positionen in Mio. €		Sons- tiges in Mio. €	Eigenmittelanforderung in Mio. €				Gewichte der Eigenmittel- anforderungen pro Land	Länderbezogene CCB-Rate in %
		Risikopositionswert (SA)	Risikopositionswert (IRB)	Risikopositionswert (SA)	Risikopositionswert (IRB)		Sonstige Aktiva, ohne Kreditverpflichtungen	davon: Kreditrisiko	davon: Verbriefungspositionen	davon: Sonstige Aktiva, ohne Kreditverpflichtungen		
		010	020	050	060	065	070	090	095	100	110	120
010	Aufschlüsselung nach Ländern											
	(DE) Federal Republic of Germany	2.860,52	21.433,09	0,00	326,15	630,90	732,57	1,97	18,12	752,66	0,90	0,00
	(GB) Great Britain and Northern Ireland	0,04	150,07	0,00	297,00	0,00	4,26	2,01	0,00	6,27	0,01	0,50
	(HK) Hong Kong	0,00	3,31	0,00	0,00	0,00	0,10	0,00	0,00	0,10	0,00	1,30
	(LU) Grand Duchy of Luxembourg	0,06	582,85	0,00	0,00	0,00	24,67	0,00	0,00	24,67	0,03	0,00
	(NL) Kingdom of Netherlands	1,12	472,83	0,00	199,32	0,00	12,50	1,18	0,00	13,68	0,02	0,00
	(NO) Kingdom of Norway	0,02	4,55	0,00	0,00	0,00	0,11	0,00	0,00	0,11	0,00	2,00
	(SE) Kingdom of Sweden	0,03	0,77	0,00	0,00	0,00	0,53	0,00	0,00	0,53	0,00	2,00
	(US) United States of America	0,14	463,63	0,00	128,20	0,00	12,25	6,55	0,00	18,80	0,02	0,00
	Sonstige	6,55	1.141,31	0,00	252,34	0,00	20,94	1,56	0,00	22,50	0,03	0,00
020	Total	2.868,48	24.252,41	0,00	1.203,01	630,90	807,93	13,27	18,12	839,32	1,00	

Tabelle 8 stellt die Gesamtrisikoposition der LBB, die aus den gewichteten länderspezifischen Quoten errechnete institutsspezifische Quote und den mit hartem Kernkapital zu unterlegenden Kapitalpuffer

dar. Die institutsbezogene CCB-Rate ist gemäß Verordnung 2015/1555 mit nur zwei Dezimalstellen anzugeben, zur Verständlichkeit werden drei angegeben.

Tabelle 8: Institutsspezifischer Kapitalpuffer

Zeile		Spalte
		010
010	Gesamtrisikobetrag in Mio. €	12.818,09
020	Institutsbezog. CCB-Rate (Institutsspezifische Quote des antizyklischen Kapitalpuffers) in %	0,005
030	Eigenmittelanforderungen zur insitutsbezogenen CCB-Rate (Anforderung an den institutsspezifischen antizyklischen Kapitalpuffer) in Mio. €	0,69

5. Kreditrisikoanpassungen (Artikel 442)

5.1 Definition überfällig und notleidend (Artikel 442 a)

In der LBB gilt ein Engagement ab dem ersten Tag der Limitüberziehung als „überzogen“ und unterliegt einem strengen Monitoring in Kombination mit der Einleitung des Mahnverfahrens und gegebenenfalls der Kündigung.

Für die Zwecke der Rechnungslegung beziehen sich die Begriffsbestimmungen auf leistungsgestörte Kredite. Überfällige Forderungen sind wesentliche Verbindlichkeiten eines Schuldners, die bis 90 Tage in Verzug sind, die maximal der Ratingklasse 15c

angehören und bei denen keine Kreditrisikoanpassungen vorgenommen wurden. Dieser Verzug wird nach Artikel 178 CRR für alle Risikopositionsklassen kreditnehmerbezogen ermittelt.

„Notleidende Kredite“ (Ratingklasse 16, 17, 18, bestehende EWB oder Überziehung größer 90 Tage) sind Forderungen, für die Maßnahmen der Risikovorsorge wie Wertberichtigungen oder Teilabschreibungen getroffen wurden beziehungsweise die sich in Abwicklung befinden.

5.2 Ansätze und Methoden der Kreditrisikoanpassungen (Artikel 442 b)

Die Unterteilung der Risikovorsorgebestandteile orientiert sich an den aufsichtsrechtlichen Definitionen für allgemeine und spezifische Kreditrisikoanpassungen gemäß der delegierten Verordnung (EU) Nr. 183/2014 der Europäischen Kommission vom 20. Dezember 2013.

Zu den spezifischen Kreditrisikoanpassungen zählen Einzelwertberichtigungen (EWB), pauschalierte Einzelwertberichtigungen (pEWB), Rückstellungen im Kreditgeschäft (RIK), Pauschalwertberichtigungen (PWB) und Länderwertberichtigungen (LWB).

Darüber hinaus bestehen allgemeine Kreditrisikoanpassungen in Form von Vorsorgereserven nach § 340f HGB.

Gefährdete Engagements fallen prinzipiell in die Bearbeitungszuständigkeit und Verantwortung der Risikobetreuungsbereiche, in welchen diese Kredite saniert oder abgewickelt werden.

Die Kompetenz der Risikobetreuungsbereiche umfasst unter anderem die Bildung von Einzelwertberichtigungen. Oberhalb definierter Betragsgrenzen entscheiden einzelne Vorstandsmitglieder oder entscheidet der Gesamtvorstand der LBB AG über die Höhe der Einzelwertberichtigung.

Über die unterjährig gebildete Risikovorsorge wird monatlich an den Vorstand berichtet. Die Höhe der Einzelwertberichtigungsvorschläge beruht auf fest definierten Kriterien, die unter anderem von der Art der Sicherheit beziehungsweise vom Status des Engagements (Sanierung oder Abwicklung) abhängen. Auch für Engagements, die keine Einzelwertberichtigung erhalten, wird im Sinne einer Portfoliobetrachtung der Kreditrisikovorsorgebedarf ermittelt. Für diese latenten Ausfallrisiken bildet die LBB nach dem Konzept eines Expected Losses eine Pauschalwertberichtigung. In diese Berechnung fließen die Risikoparameter Ausfallwahrscheinlichkeit, Risikoposition und Verlustquote ein.

Des Weiteren erfolgt die Bildung von Länderrisikovorsorge.

Bei der Bildung der Kreditrisikovorsorge werden grundsätzlich alle Adressenausfallpositionen berücksichtigt.

5.3 Risikopositionen (Artikel 442c–i)

5.3.1 Betrag der Risikopositionen

Die Ermittlung des Gesamtbetrags der Forderungen erfolgt nach aufsichtsrechtlichen Vorgaben. Die bilanziellen und außerbilanziellen Geschäfte werden jeweils mit ihren Buchwerten nach Rechnungslegungsaufrechnung, vor Kreditrisikominderung und nach Anwendung des Credit Conversion Factors (CCF), die derivativen Instrumente mit ihren Kreditäquivalenzbeträgen nach Marktbewertungsmethode ausgewiesen.

Bei der LBB/BSK ist im lebenden und notleidenden Kreditgeschäft eine verstärkte kontinuierliche Reduzierung bei der Kreditrisikovorsorge zu verzeichnen. In den durchschnittlichen Risikopositionen wurde wie im Vorjahr die Kreditrisikovorsorge des Meldestichtages berücksichtigt.

Der Gesamtbetrag der Risikopositionen zum Meldestichtag beträgt 60.708 Mio. € und wird nach Rechnungslegungsaufrechnung, vor Kreditrisikominderung und nach Anwendung des Credit Conversion Factors (CCF) ausgewiesen, wobei es Kreditrisikoanpassungen in Höhe von 5 Mio. € (davon 2 Mio. € für Altkredite) gibt, die nicht direkt zuordenbar sind und daher nicht berücksichtigt wurden. Der Gesamtbetrag der Risikopositionen setzt sich aus den bilanziellen Risikopositionsklassen gemäß Artikel 112 bzw. 147 CRR mit Ausnahme der Beteiligungs- und Verbriefungsrisikopositionen, derivativen Positionen sowie außerbilanziellen Positionen zusammen.

Die nachfolgende Übersicht stellt den Durchschnittsbetrag der Risikopositionen während des Berichtszeitraumes nach Risikopositionsklassen aufgegliedert, nach Rechnungslegungsaufrechnung, ohne Berücksichtigung der Kreditrisikominderung und nach Anwendung des CCF dar.

Tabelle 9: Durchschnittliche Risikopositionen

per 31.12.2017	
in Mio. €	LBB
Standardansatz (SA)	
Zentralstaaten oder Zentralbanken	3.231
Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	2.859
Öffentliche Stellen	1.510
Multilaterale Entwicklungsbanken	190
Internationale Organisationen	605
Institute	23.701
Unternehmen	912
Mengengeschäft	1.230
Durch Immobilien besichert	9
Ausgefallene Positionen	0
Mit besonders hohem Risiko verbundene Positionen	0
Gedckte Schuldverschreibungen	2
Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	0
Investmentfonds (OGAW-Fonds)	94
Sonstige Positionen	0
Auf internen Beurteilungen basierender Ansatz (IRB)	
Zentralstaaten und Zentralbanken	818
Institute	5.719
Unternehmen	16.618
<i>davon KMU</i>	2.750
<i>davon Spezialfinanzierungen</i>	13
<i>davon Sonstige</i>	13.855
Mengengeschäft	6.443
<i>davon KMU Immobilien besichert</i>	224
<i>davon nicht KMU Immobilien besichert</i>	1.519
<i>davon qualifiziert revolving</i>	3.490
<i>davon KMU</i>	396
<i>davon Sonstige</i>	813
Sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind	502
Gesamt LBB	64.442

Die Höhe der Risikopositionen in der Forderungskategorie Institute im Standardansatz wird durch das von der LBB/BSK gegenüber der Berlin Hyp gewährte Altpatronat in Höhe von 12,1 Mrd. € geprägt (Es gibt derzeit kein aktives Patronat mehr.). Das Patronat wurde zum 1. Januar 2015 gekündigt und wird im weiteren Verlauf abgeschmolzen. Der Restbetrag repräsentiert im Wesentlichen die Risikopositionen, die mit Instituten des Haftungsverbundes der S-Finanzgruppe und anderen Banken des Konzerns bestehen.

Der überwiegende Teil der Risikopositionen mit Unternehmen entfiel auf die gewerbliche Immobilienfinanzierung. Das restliche Forderungsvolumen mit Instituten und Gebietskörperschaften entfällt wie in den vergangenen Jahren zum Großteil auf das Treasurygeschäft.

Die Zuordnung der Forderungen zu den geografischen Gebieten erfolgt anhand des Landes, das für die wirtschaftlichen Risiken eines Kreditnehmers relevant ist. Dies kann ein für die Erwirtschaftung des Kapitaldienstes vom Sitzland abweichendes Land sein.

Die nachfolgende Tabelle stellt die Risikopositionen der Bank nach Rechnungslegungsaufrechnung, ohne Berücksichtigung der Kreditrisikominderung und nach

Anwendung des CCF nach bedeutenden Regionen, unterteilt in Risikopositionsklassen dar:

Tabelle 10: Risikopositionen nach Region

per 31.12.2017 in Mio. €	Inland	Ausland		Internationale Organisationen
		davon EU	restliches Ausland	
Standardansatz (SA)				
Zentralstaaten oder Zentralbanken	1.991	0	0	0
Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	2.401	0	0	0
Öffentliche Stellen	1.317	138	0	0
Multilaterale Entwicklungsbanken	0	0	0	0
Internationale Organisationen	0	0	0	588
Institute	20.113	491	0	0
Unternehmen	1.133	3	0	0
Mengengeschäft	1.333	2	1	0
Durch Immobilien besicherte Positionen	3	0	0	0
Ausgefallene Positionen	35	0	0	0
Mit besonders hohen Risiken verbundene Positionen	0	0	0	0
Positionen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	0	0	0	0
Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	0	0	0	0
Investmentfonds (OGAW-Fonds)	267	0	0	0
Sonstige Posten	0	0	0	0
Auf internen Beurteilungen basierender Ansatz (IRB)				
Zentralstaaten und Zentralbanken	0	561	6	374
Institute	1.061	3.281	1.320	0
Unternehmen	14.248	1.497	1.244	0
<i>davon KMU</i>	2.998	101	8	0
<i>davon Spezialfinanzierungen</i>	0	0	0	0
<i>davon Sonstige</i>	11.250	1.396	1.236	0
Mengengeschäft	6.619	20	31	0
<i>davon KMU Immobilien besichert</i>	225	0	0	0
<i>davon nicht KMU Immobilien besichert</i>	1.596	9	13	0
<i>davon qualifiziert revolving</i>	3.533	5	4	0
<i>davon KMU</i>	443	0	0	0
<i>davon Sonstige</i>	822	5	15	0
Sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind	631	0	0	0
Gesamt LBB	51.152	5.993	2.602	962

Die geografische Verteilung des Portfolios spiegelt die mit der regionalen Ausrichtung der LBB/BSK einhergehende Konzentration auf den Heimatmarkt wider. Vornehmlich werden Kreditrisiken in der Bundesrepublik Deutschland sowie zu einem geringeren Teil auch im europäischen Ausland eingegangen. Das Treasurygeschäft führt zu Positionen sowohl im In- als auch im Ausland.

Die LBB ordnet jedem Kunden eine Branche nach der Systematik der Wirtschaftszweige zu. Diese Branchen werden gruppiert und zu Hauptbranchen zusammengefasst offengelegt.

Die nachfolgende Tabelle stellt die Risikopositionen der Bank nach Rechnungslegungsaufrechnung, ohne Berücksichtigung der Kreditrisikominderung und nach

Anwendung des CCF nach Branchen, unterteilt in Risikopositionsklassen dar:

Tabelle 11: Risikopositionen nach Branchen

per 31.12.2017	Beteiligungsgesellschaften	Chemische Industrie	Dienstleistungen	Gebietskörperschaften	Gesundheit & Soziales	Handel & Gewerbe	Immobilienfinanzierungen	Kreditgewerbe	Privatpersonen	Versicherungen	Sonstiges
in Mio. €											
Standardansatz (SA)											
Zentralstaaten oder Zentralbanken	0	0	0	40	0	0	0	1.951	0	0	0
Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	0	0	0	2.398	0	0	0	0	0	0	3
Öffentliche Stellen	0	0	0	298	0	74	0	1.083	0	0	0
Multilaterale Entwicklungsbanken	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Internationale Organisationen	0	0	0	74	0	0	0	515	0	0	0
Institute	0	0	0	0	0	0	0	20.603	0	0	0
Unternehmen	467	0	28	0	1	1	144	495	0	0	0
Mengengeschäft	0	0	39	0	7	21	2	4	1.262	0	1
Durch Immobilien besicherte Positionen	0	0	1	0	0	1	0	0	1	0	0
Ausgefallene Positionen	0	0	0	0	0	0	34	0	0	0	0
Mit besonders hohen Risiken verbundene Positionen	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Positionen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Investmentfonds (OGAW-Fonds)	0	0	0	0	0	0	0	267	0	0	0
Sonstige Posten	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Auf internen Beurteilungen basierender Ansatz (IRB)											
Zentralstaaten und Zentralbanken	0	0	0	566	0	0	0	374	0	0	0
Institute	0	0	0	82	0	0	0	5.581	0	0	0
Unternehmen	1.232	132	2.588	0	268	983	9.609	1.528	316	12	320
<i>davon KMU</i>	113	1	383	0	28	332	2.062	101	0	5	82
<i>davon Spezialfinanzierungen</i>	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
<i>davon Sonstige</i>	1.119	130	2.205	0	240	651	7.547	1.427	316	8	238
Mengengeschäft	11	6	638	0	95	602	76	27	5.171	14	28
<i>davon KMU Immobilien besichert</i>	2	6	85	0	16	94	13	4	0	1	5
<i>davon nicht KMU Immobilien besichert</i>	1	0	181	0	30	96	44	7	1.247	6	6
<i>davon qualifiziert revolving</i>	0	0	62	0	10	35	3	1	3.422	1	8
<i>davon KMU</i>	4	0	160	0	16	241	7	11	0	1	2
<i>davon Sonstige</i>	3	0	151	0	24	137	9	4	502	5	6
Sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind	11	0	0	0	0	0	0	619	0	0	0
Gesamt LBB	1.721	138	3.293	3.457	372	1.681	9.866	33.048	6.752	27	352

Neben den Risiken aus Treasurygeschäften insbesondere mit Kreditinstituten und Gebietskörperschaften zeigt die Branchenaufteilung eine Konzentration des Portfolios auf das Privatkundengeschäft und auf Immobilienfinanzierungen.

Die nachfolgende Tabelle stellt die Risikopositionen der Bank nach Rechnungslegungsaufrechnung, ohne Berücksichtigung der Kreditrisikominderung und nach Anwendung des CCF nach Restlaufzeiten, unterteilt in Risikopositionsklassen dar. Bei den Restlaufzeiten handelt es sich um vertragliche Restlaufzeiten.

Tabelle 12: Risikopositionen nach Restlaufzeiten

per 31.12.2017 in Mio. €	Bis ein Jahr	Ein Jahr bis fünf Jahre	Über fünf Jahre
Standardansatz (SA)			
Zentralstaaten oder Zentralbanken	1.951	0	40
Regionale oder lokale Gebietskörperschaften	1.323	1.002	76
Öffentliche Stellen	866	555	34
Multilaterale Entwicklungsbanken	0	0	0
Internationale Organisationen	156	272	161
Institute	4.460	3.351	12.793
Unternehmen	55	90	991
Mengengeschäft	1.049	229	58
Durch Immobilien besicherte Positionen	0	0	2
Ausgefallene Positionen	35	0	0
Mit besonders hohen Risiken verbundene Positionen	0	0	0
Positionen in Form von gedeckten Schuldverschreibungen	0	0	0
Institute und Unternehmen mit kurzfristiger Bonitätsbeurteilung	0	0	0
Investmentfonds (OGAW-Fonds)	0	0	267
Sonstige Posten	0	0	0
Auf internen Beurteilungen basierender Ansatz (IRB)			
Zentralstaaten und Zentralbanken	308	473	159
Institute	1.164	2.676	1.822
Unternehmen	1.963	2.844	12.181
<i>davon KMU</i>	159	227	2.721
<i>davon Spezialfinanzierungen</i>	0	0	0
<i>davon Sonstige</i>	1.805	2.617	9.460
Mengengeschäft	4.081	263	2.326
<i>davon KMU Immobilien besichert</i>	41	17	167
<i>davon nicht KMU Immobilien besichert</i>	31	65	1.523
<i>davon qualifiziert revolving</i>	3.542	0	0
<i>davon KMU</i>	244	105	93
<i>davon Sonstige</i>	223	76	543
Sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind	631	0	0
Gesamt LBB	18.043	11.755	30.910

Etwa die Hälfte der Risikopositionen wird langfristig fällig, wobei ein großer Teil auf das der Berlin Hyp gewährte Altpatronat entfällt.

5.3.2 Wertgeminderte und überfällige Risikopositionen (Artikel 442 g–i)

Tabelle 13: Notleidende und überfällige Positionen ¹

per 31.12.2017 in Mio. €	Risikopositionen		Kreditrisikoanpassungen	
	notleidend	überfällig	spezifische	Aufwendungen während des Berichtszeitraums
Branchen				
Beteiligungsgesellschaften	30	0	4	-1
Chemische Industrie	0	0	0	0
Dienstleistungen	207	2	69	7
Gebietskörperschaften	0	0	1	0
Gesundheit & Soziales	3	0	9	7
Handel & Gewerbe	36	4	47	3
Immobilienfinanzierungen	61	0	27	-9
Kreditgewerbe	6	8	17	-29
Privatpersonen	6	14	166	27
Versicherungen	0	0	3	0
Sonstiges	24	0	0	0
Regionen				
Inland	116	19	311	36
EU	1	3	5	-1
Restliches Ausland	256	6	27	-30
Internationale Organisationen	0	0	0	0

¹⁾ Die Tabelle enthält keine § 340 f HGB Reserve. Desweiteren existieren auch Kreditrisikoanpassungen in Höhe von 5 Mio. €, die nicht direkt zuordenbar sind (davon 2 Mio. € für Altkredite). Direktabschreibungen und Eingänge auf abgeschriebene Forderungen in Höhe der Nettozuführung von 10 Mio. € sind ebenfalls nicht enthalten.

Unter Berücksichtigung der in der LBB/BSK angewendeten Verfahren bei der Bildung der Kreditrisikovorsorge ergeben sich für unser Portfolio folgende Werte für Wertberichtigungen und Rückstellungen ohne die Berücksichtigung von Einzelwertberichtigungen auf

Altkredite in Höhe von rund 2 Mio. €. Angaben für spezifische Kreditrisikooanpassungen, die direkt in die Gewinn- und Verlustrechnung übernommen werden, sind der letzten Spalte zu entnehmen.

Tabelle 14: Veränderung der Wertberichtigungen und Rückstellungen gemäß Jahresabschluss der LBB ²

in Mio. €	EWB	PWB	Rückstellungen Kreditgeschäft	Direktabschreibungen und Eingänge auf abgeschriebene Forderungen	Länderrisiko	GuV-wirksam
Risikovorsorge LBB, Stand 01.01.2017	441	88	9		10	
Zuführungen	133	5	4	0	0	142
Abgänge						
Inanspruchnahmen	40	0	0	0	0	0
Auflösungen	30	26	1	0	3	60
Direktabschreibungen	0	0	0	12	0	12
Eingänge auf abgeschriebene Forderungen	0	0	0	2	0	2
Umbuchungen	0	0	0	0	0	0
Wechselkursänderungen	0	0	0	0	0	0
Risikovorsorge LBB, Stand 31.12.2017	504	67	12	10	7	92

²⁾ Diese Tabelle beinhaltet die § 340 f HGB Reserve unter dem Posten EWB.

6. Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken (Artikel 453 CRR)

Die in der LBB/BSK verwendeten Techniken zur Kreditrisikominderung, die im Folgenden beschrieben werden, gelten je nach Ansetzbarkeit für das kommerzielle Kreditgeschäft und das Treasury-Geschäft inklusive Derivaten.

Entsprechend der unterschiedlichen Arten des Adressenausfallrisikos (Emittenten-, Kontrahenten-, Kreditnehmerrisiko) werden verschiedene Risikominderungstechniken angewendet. Insbesondere kommen finanzielle Sicherheiten und Personensicherheiten, Grundpfandrechte und Garantien zum Tragen. Im Rahmen ihrer jeweiligen Risikostrategie formulieren die Geschäftsfelder ihre Sicherheitenstrategie.

Bei den Kreditrisiken bildeten Sach- und Personensicherheiten im Gesamtwert von circa 14,9 Mrd. € per 31. Dezember 2017 die wesentliche Position. Diese werden als Sicherungsinstrumente für aufsichtsrechtliche Zwecke nicht in vollem Umfang risikomindernd in Anrechnung gebracht. Der Umfang der Sicherheiten orientiert sich an Exposurehöhe und Ausfallwahrscheinlichkeit und wird anhand fest vorgegebener Kriterien bewertet. Eine weitere Risikominderung entsteht durch Kompensationsvereinbarungen. Insgesamt werden 11,3 Mrd. € aufsichtsrechtlich angerechnet (Tabelle 15).

Die Verantwortung für das Sicherheitenmanagement bei Kreditrisiken liegt in der Marktfolge. Diese ist für den Ansatz, die Prüfung und die regelmäßige Bewertung der Sicherheiten sowie für die Verwaltung der Techniken zur Kreditrisikominderung zuständig. Dazu erfasst und verwaltet die Marktfolge die Sicherheiten in einem zentralen IT-gestützten Sicherheitensystem.

Bei der Überwachung und Überprüfung von Immobilienbewertungen differenziert die LBB zwischen der Überwachung auf Basis von Marktschwankungen sowie der turnus- und anlassbezogenen Überprüfung.

Die Überwachung des als Sicherheit dienenden Immobilienportfolios der LBB/BSK erfolgt jährlich auf Basis eines statistischen Verfahrens (Marktschwankungskonzept, MSK). Die Marktschwankungsanalyse erfolgt jährlich durch die Wertermittler. Bei festgestellter Überschreitung festgelegter Schwankungsbreiten besteht ein Überprüfungsbedarf für das Gutachten. Soweit sich

aus dieser oder einer anderen Überwachung (zum Beispiel Objekt-Ratingaktualisierung) Wertminderungen ergeben, wird die Überprüfung der Markt- und Beleihungswerte durch den zuständigen Kreditsachbearbeiter veranlasst.

Bei den Objektarten, die nicht mittels des Marktschwankungskonzeptes überwacht werden können, ist gemäß der Objektartenliste eine entsprechende Einzelüberprüfung durch die Wertermittler erforderlich. Auch hier ist die Überprüfung durch den Kreditsachbearbeiter zu veranlassen.

Neben der jährlichen Überwachung der Immobiliensicherheiten im Rahmen des MSK ist die Bewertung der Immobilie mindestens alle drei Jahre von den Wertermittlern zu überprüfen.

Die LBB/BSK hat in ihrem Regelwerk Kriterien zur turnus- und anlassbezogenen Überwachung und Überprüfung von Immobilienbewertungen definiert.

Bei Emittentenrisiken erfolgt eine Risikominderung durch Aufrechnung von Long- und Short-Positionen. Zusätzlich werden Garantiebeziehungen berücksichtigt. Darüber hinaus wird eine Besicherung durch Kreditderivate vorgenommen, die in Höhe von rund 20 Mio. € besteht.

Bei Kontrahentenrisiken resultiert eine Risikominderung aus der Verrechnung von gegenläufigen Risikopositionen durch Netting-Vereinbarungen. In der LBB/BSK kommt dabei täglich das sogenannte Close-Out-Netting zur Anwendung, welches üblicherweise bei Kreditverschlechterung eines Kontrahenten bis hin zur Insolvenz vorgenommen wird. Dabei werden Forderungen und Verbindlichkeiten gegeneinander aufgerechnet. Dies hat zur Folge, dass die sich ergebenden Ansprüche durch einen Ausgleichsanspruch in Höhe des Netto-Marktwertes dieser Geschäfte oder des sich daraus ergebenden unrealisierten Gewinns oder Verlusts für beide Parteien festgestellt und die Beträge saldiert werden. Zusätzlich können bei OTC-Derivaten, Wertpapierleihen und Repogeschäften über die bereits abgeschlossenen Nettingverträge hinaus individuelle Collateral-Vereinbarungen (Besicherungsvereinbarungen) geschlossen werden. Im Berichtsjahr wurden Kontrahentenrisiken durch Netting-Vereinbarungen

in Höhe von rund 3.100 Mio. € und hereingenommene Collaterals um rund 800 Mio. € reduziert.

Bei der Ermittlung der Eigenkapitalmindestgröße für Adressenausfallrisiken werden ausschließlich Garantien von institutionellen Bürgen/Garanten wie Kreditinstituten, Kreditversicherungen und der öffentlichen Hand, die eine bestimmte Mindestbonität haben, risikomindernd berücksichtigt. Analog zur Kreditnehmerbewertung unterliegt auch der Gewährleistungsgeber den gleichen Prüfungsverfahren der Überwachung und Risikoklassifizierung.

Die LBB/BSK hat in den vergangenen Geschäftsjahren weitere Teile des Portfolios auf Zentrale Kontrahenten übertragen, woraus sich zusätzliche Risikominderungseffekte ergaben. Bei diesem Clearing geht das Insolvenzrisiko des jeweiligen Kontrahenten auf den Zentralen Kontrahenten über und schützt somit die beiden eigentlichen Vertragspartner. Der Zentrale Kontrahent ist mit einem Ausfallfonds (Sicherungsfonds)

ausgestattet, wodurch die Ausfallrisiken seiner Kontrahenten getragen werden. Da jeder Handelsteilnehmer nur den Zentralen Kontrahenten als Vertragspartner für diese Geschäfte hat, wird das Kontrahentenrisiko reduziert. Zur Minderung des Ausfallrisikos verlangt der Zentrale Kontrahent zusätzlich von allen Handelsteilnehmern eine Sicherheiten hinterlegung, die im Falle des Ausfalls einer Partei die Wiederbeschaffung ermöglichen soll.

Für alle Forderungsklassen im KSA und IRBA werden in der nachfolgenden Tabelle die Risikopositionswerte für die angewendeten Kreditrisikominderungsinstrumente, unterteilt nach Sicherheitenarten, dargestellt. In der Spalte Gewährleistungen sind Garantien und Bürgschaften enthalten. Für Beteiligungen nutzt die LBB/BSK keine Kreditminderungstechniken. Eigene Schätzungen der LGD oder des Umrechnungsfaktors nimmt die LBB/BSK nur im Mengengeschäft des IRBA vor.

Besicherte Risikopositionswerte

Tabelle 15: Kreditrisikominderung

per 31.12.2017 in Mio. €	besichert durch		
	finanzielle Sicherheiten	sonstige Sicherheiten	Gewährleistungen
KSA-Forderungsklassen			
Regionalregierungen und örtliche Gebietskörperschaften	0	0	0
Durch Immobilien besicherte Positionen	0	3	0
Ausgefallene Positionen	0	0	35
Öffentliche Stellen	2	0	0
Institute	247	0	0
Unternehmen	11	0	544
Mengengeschäft	1	0	0
KSA	261	3	579
IRBA-Forderungsklassen			
Zentralregierungen	0	0	0
Institute	523	14	247
Mengengeschäft	16	1.280	59
Unternehmen	263	6.697	1.308
IRBA	802	7.991	1.614
Gesamt LBB	1.063	7.994	2.193

7. Vergütungspolitik (Artikel 450 CRR)

Die Vorschriften für die Vergütungspolitik sind in der CRD IV geregelt und durch die Instituts-Vergütungsverordnung (IVV) in deutsches Recht umgesetzt worden. Die Offenlegung zur Vergütung für CRR-Institute hat gemäß § 16 IVV nach CRR Art. 450 zu erfolgen.

Die Angaben zur Vergütung werden in einem separaten Bericht veröffentlicht. Dieser ist auf der Internetseite der LBB (Finanzberichte) zu finden: <http://www.lbb.de/berichte>

8. Verschuldung/Leverage Ratio (Artikel 451 CRR)

Die Offenlegung der Verschuldungsquote erfolgt unter Berücksichtigung von Übergangsregeln (Phase-in). Der Ermittlung der Quote liegen die Vorgaben der delegierten Verordnung (EU) 2015/62 der Kommission vom 10. Oktober 2014 zur Änderung der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 des Europäischen Parlaments und des Rates im Hinblick auf die Verschuldungsquote zu Grunde.

Zum 31.12.2017 haben wir die Verschuldungsquote auf Basis des Eigenkapitals vor Gewinnfeststellung ermittelt, sodass die gegenüber den Aufsichtsbehörden kommunizierten Werte verwendet werden. Zur besseren Vergleichbarkeit haben wir die in den Tabellen 16–18 gezeigten Vorjahreswerte, die im Offenlegungsbericht per 31.12.2016 unter Verwendung des Eigenkapitals nach Gewinnfeststellung erstellt wurden, an die aktuell verwendete Methode angepasst.

Im Vergleich zum 31.12.2016 hat sich die Verschuldungsquote der LBB von 4,42% auf 4,73% verbessert. Der Anstieg ist im Wesentlichen auf eine Erhöhung des Kernkapitals und einen Rückgang des Wertpapierfinanzierungsgeschäftes zurückzuführen.

Dem Risiko einer übermäßigen Verschuldung wird durch Berücksichtigung der Verschuldungsquote im Planungs- und Steuerungsprozess der LBB Rechnung getragen. Ausgehend von der Geschäfts- und Risikostrategie und deren Umsetzung in der Mittelfristplanung wird eine interne Zielvorgabe für die Verschuldungsquote abgeleitet. In monatlichen Abständen wird dem Vorstand im umfassenden internen Management-Reporting der LBB über die aktuelle Entwicklung der Verschuldungsquote und wesentliche Einflussfaktoren berichtet.

Die LBB hält ein Patronat gegenüber der Berlin Hyp welches zum 01.01.2015 gekündigt wurde und nicht in der Bemessungsgrundlage der Leverage Ratio berücksichtigt wird. Am 12.01.2017 wurde bei der EZB ein Antrag auf Ausschluss von Intragruppenforderungen aus der Berechnung der Verschuldungsquote gemäß Art. 429 (7) CRR gestellt. Die LBB beabsichtigt, das Nichteinbeziehen des Altpatronates in die Bestimmung der Verschuldungsquote vorbehaltlich einer explizit anderslautenden Vorgabe der Aufsicht aufrechtzuerhalten.

Unter Berücksichtigung der Verpflichtung aus dem Altpatronat ergäbe sich eine Verschuldungsquote in Höhe von 3,77 %.

Summarischer Vergleich zwischen Bilanzaktiva und der Gesamtrisikopositionsmessgröße

Tabelle 16: Verschuldung, summarischer Vergleich

in Mio. €		Anzusetzender Wert 31.12.2017	Anzusetzender Wert 31.12.2016
1	Summe der im Jahresabschluss ausgewiesenen Vermögenswerte	44.833	45.874
2	Anpassung für Beteiligungen, die zu Bilanzzwecken konsolidiert werden, die jedoch nicht zum aufsichtlichen Konsolidierungskreis gehören	0	0
3	Anpassung für Treuhandvermögen, das gemäß den geltenden Rechnungslegungsvorschriften in der Bilanz ausgewiesen wird, aber von der Gesamtrisikopositionsmessgröße gemäß Artikel 429 Absatz 13 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgenommen ist	0	0
4	Anpassungen für derivative Finanzinstrumente	1.084	1.414
5	Anpassungen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT)	6	113
6	Anpassung für außerbilanzielle Geschäfte (d. h. Umwandlung der außerbilanziellen Geschäfte in Kreditäquivalenzbeträge)	2.793	2.861
EU-6a	Anpassung für Risikopositionen aus Intragruppenforderungen, die von der Gesamtrisikopositionsmessgröße gemäß Artikel 429 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgenommen sind	0	0
EU-6b	Anpassungen für Risikopositionen, die gemäß Artikel 429 Absatz 14 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 von der Gesamtrisikopositionsmessgröße ausgenommen sind	0	0
7	Sonstige Anpassungen	-1.451	-1.824
8	Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote	47.265	48.439

Einheitliches Offenlegungsschema für die Verschuldungsquote

Tabelle 17: Verschuldungsquote

in Mio. €		Risikopositionswerte der CRR-Verschuldungsquote 31.12.2017	Risikopositionswerte der CRR-Verschuldungsquote 31.12.2016
Bilanzielle Risikopositionen (ausgenommen Derivate und Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT))			
1	Bilanzwirksame Positionen (ohne Derivate, Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) und Treuhandvermögen, jedoch einschließlich Sicherheiten)	42.926	42.664
2	Aktiva, die zur Ermittlung des Kernkapitals abgezogen werden	-23	-27
3	Summe der bilanziellen Risikopositionen (ohne Derivate, Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) und Treuhandvermögen)	42.903	42.637
Derivative Risikopositionen			
4	Wiederbeschaffungskosten für alle Derivatgeschäfte (d. h. bereinigt um anrechenbare, in bar erhaltene Nachschüsse)	1.094	1.395
5	Aufschläge für den potenziellen künftigen Wiederbeschaffungswert in Bezug auf alle Derivatgeschäfte (Marktbewertungsmethode)	402	427
EU-5a	Risikopositionswert gemäß Ursprungsrisikomethode	0	0
6	Hinzugerechneter Betrag von gestellten Sicherheiten für Derivatgeschäfte, wenn diese gemäß den geltenden Rechnungslegungsvorschriften von den Bilanzaktiva abgezogen werden	0	0
7	Abzug bei in bar erhaltenen Nachschüssen in Derivatgeschäften	-498	-434
8	Ausgenommene Risikopositionen aus für Kunden über eine qualifizierte zentrale Gegenpartei (QCCP) abgerechnete Geschäfte	0	0
9	Bereinigter effektiver Nominalwert von geschriebenen Kreditderivaten	154	113
10	Bereinigte Aufrechnungen des effektiven Nominalwerts und Zuschlagsabzüge für ausgestellte Kreditderivate	-68	-87
11	Derivative Risikopositionen insgesamt (Summe der Zeilen 4 bis 10)	1.084	1.414

in Mio. €		Risikopositionswerte der CRR-Verschuldungsquote 31.12.2017	Risikopositionswerte der CRR-Verschuldungsquote 31.12.2016
Risikopositionen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)			
12	Brutto-Aktiva aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT; ohne Anerkennung von Netting), nach Bereinigung um als Verkauf verbuchte Geschäfte	1.827	3.119
13	Aufgerechnete Beträge von Barverbindlichkeiten und -forderungen aus Brutto-Aktiva aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)	-1.348	-1.717
14	Aufschlag auf das Gegenparteiausfallrisiko aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften (SFT)	6	113
EU-14a	Ausnahme für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT): Aufschlag auf das Gegenparteiausfallrisiko gemäß Artikel 429b Absatz 4 und Artikel 222 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0	0
15	Risikopositionen aus als Agent getätigten Geschäften	0	0
EU-15a	Ausgenommene Risikopositionen aus für Kunden über eine qualifizierte zentrale Gegenpartei (QCCP) abgerechnete Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT)	0	0
16	Risikopositionen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften insgesamt	485	1.516
Andere außerbilanzielle Risikopositionen			
17	Außerbilanzielle Risikopositionen zum Bruttonominalwert	12.096	11.758
18	Anpassungen für die Umrechnung in Kreditäquivalenzbeträge	-9.303	-8.897
19	Andere außerbilanzielle Risikopositionen (Summe der Zeilen 17 und 18)	2.793	2.861
Gemäß Artikel 429 Absätze 7 und 14 CRR ausgenommene Risikopositionen (bilanziell und außerbilanziell)			
EU-19a	Gemäß Artikel 429 Absatz 7 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgenommene gruppeninterne Risikopositionen (Einzelbasis) (bilanziell und außerbilanziell)	0	0
EU-19b	Gemäß Artikel 429 Absatz 14 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 ausgenommene Risikopositionen (bilanziell und außerbilanziell)	0	0
Eigenkapital und Gesamtrisikopositionen			
20	Kernkapital	2.236	2.242
21	Gesamtrisikopositionsmessgröße der Verschuldungsquote	47.265	48.429
Verschuldungsquote			
22	Verschuldungsquote	4,73	4,42
Anwendung von Übergangsbestimmungen und Wert ausgebuchter Treuhandpositionen			
EU-23	Anwendung von Übergangsbestimmungen für die Definition der Kapitalmessgröße	Ja, Übergangsbestimmungen	Ja, Übergangsbestimmungen
EU-24	Wert ausgebuchter Treuhandpositionen gemäß Artikel 429 Absatz 13 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0	0

Aufschlüsselung von bilanziellen Risikopositionen (ohne Derivate, Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT) und ausgenommene Risikopositionen)

Tabelle 18: Verschuldung, bilanzielle Risikopositionen

in Mio. €		Risikopositions- werte der CRR- Verschuldungs- quote 31.12.2017	Risikopositions- werte der CRR- Verschuldungs- quote 31.12.2016
EU-1	Bilanzielle Risikopositionen insgesamt (ohne Derivate, Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT), und ausgenommene Risikopositionen), davon:	42.926	42.664
EU-2	Risikopositionen des Handelsbuchs	0	0
EU-3	Risikopositionen des Anlagebuchs, davon:	42.926	42.664
EU-4	Gedekte Schuldverschreibungen	2.865	2.661
EU-5	Risikopositionen, die wie Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten behandelt werden	7.307	6.660
EU-6	Risikopositionen gegenüber regionalen Gebietskörperschaften, multilateralen Entwicklungsbanken, internationalen Organisationen und öffentlichen Stellen, die NICHT wie Risikopositionen gegenüber Zentralstaaten behandelt werden	0	1
EU-7	Institute	9.340	11.948
EU-8	Durch Grundpfandrechte auf Immobilien besichert	7.697	6.661
EU-9	Risikopositionen aus dem Mengengeschäft	3.484	3.162
EU-10	Unternehmen	9.258	8.651
EU-11	Ausgefallene Positionen	416	496
EU-12	Andere Forderungsklassen (z. B. Beteiligungspositionen, Verbriefungs-Risikopositionen und sonstige Aktiva, die keine Kreditverpflichtungen sind)	2.559	2.423

9. Anhang

9.1 Abkürzungsverzeichnis

AMA	Advanced Measurement Approach
AT1	Zusätzliches Kernkapital
Berlin Hyp	Berlin Hyp AG
BSK	Berliner Sparkasse
CCB	Countercyclical Capital Buffer (antizyklischer Kapitalpuffer)
CCF	Credit Conversion Factor
CET1	Hartes Kernkapital
COREP	Common Solvency Ratio Reporting
CRD IV	Capital Requirements Directive IV
CRR	Capital Requirements Regulation
CVA	Credit Valuation Adjustment
EBA	Europäische Bankenaufsichtsbehörde
EWB	Einzelwertberichtigung
GuV	Gewinn- und Verlustrechnung
HGB	Handelsgesetzbuch
ICAAP	Internal Capital Adequacy Assessment Process
IRBA	Auf internen Ratings basierender Ansatz
IVV	Institutsvergütungsverordnung
KMU	Kleine und Mittelständische Unternehmen
KSA	Kreditrisiko-Standardansatz
KWG	Kreditwesengesetz
LBB	Landesbank Berlin AG
LBBH	Landesbank Berlin Holding AG
LGD	Loss Given Default
LWB	Länderwertberichtigung
OGA(W)	Organismen für gemeinsame Anlagen (in Wertpapieren)
OTC	Over The Counter
PD	Probability of Default
pEWB	pauschalierte Einzelwertberichtigungen
PWB	Pauschalwertberichtigungen
SA	Standardansatz
SEG	Gruppe der Erwerbsgesellschaft der S-Finanzgruppe mbH & Co. KG
SFT	Securities Financing Transaction (Wertpapierfinanzierungsgeschäft)
T1	Tier1 (Kernkapital)
T2	Tier2 (Ergänzungskapital)
TC	Eigenmittel

9.2 Hauptmerkmale sowie vollständige Bedingungen der begebenen Kapitalinstrumente

Hartes Kernkapital in Mio. €

Tabelle 19: Kapitalinstrument 1

	Merkm	
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierungen)	HRB 99726 B
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Hartes Kernkapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Hartes Kernkapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Soloebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Aktien
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1.200,0
9	Nennwert des Instruments	1.200,0
9a	Ausgabepreis	k.A.
9b	Tilgungspreis	k.A.
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	01.01.2006 durch Umwandlung AöR in AG
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	unbefristet
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	k.A.
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	k.A.
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	k.A.
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	k.A.
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	k.A.
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	vollständig diskretionär
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	vollständig diskretionär
21	Bestehen einer Kostenansteigsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	k.A.
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	ja
31	Bei Herabschreibung: Auslöser für die Herabschreibung	vollständige Verlustteilnahme
32	Bei Herabschreibung: ganz oder teilweise	immer ganz
33	Bei Herabschreibung: dauerhaft oder vorübergehend	dauerhaft
34	Bei vorübergehender Herabschreibung: Mechanismus der Wiederschreibung	k.A.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	k.A.
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Ergänzungskapital in Mio. €

Tabelle 20: Kapitalinstrument 2

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFBB00013019
3	Für das Instrument geltendes Recht	englisches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Nachrangdarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	106,3
9	Nennwert des Instruments	111,1
9a	Ausgabepreis	100,00 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	30.04.97
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	30.04.27
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit mit 7 Tage-Frist) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag an sich Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,15 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 21: Kapitalinstrument 3

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	DE00LBB2ZG1
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Inhaberschuldverschreibung
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,1
9	Nennwert des Instruments	1,0
9a	Ausgabepreis	100,71 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	30.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	23.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	k.A.
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,70 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	sämtliche Verbindlichkeiten ohne Nachrangvereinbarung
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 22: Kapitalinstrument 4

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	DE00LBB2ZG1
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Inhaberschuldverschreibung
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1,1
9	Nennwert des Instruments	10,0
9a	Ausgabepreis	100,00 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	23.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	23.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	k.A.
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,70 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	sämtliche Verbindlichkeiten ohne Nachrangvereinbarung
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 23: Kapitalinstrument 5

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP540Z7848
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	2,2
9	Nennwert des Instruments	20,0
9a	Ausgabepreis	100,00 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	17.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	17.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,63 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenansteigsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 24: Kapitalinstrument 6

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP540Z7921
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,6
9	Nennwert des Instruments	5,0
9a	Ausgabepreis	100,00 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	23.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	23.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,61 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 25: Kapitalinstrument 7

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPPF400JW40
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	2,2
9	Nennwert des Instruments	20,0
9a	Ausgabepreis	99,82 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	18.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	18.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,60 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 26: Kapitalinstrument 8

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPPF400JX23
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,1
9	Nennwert des Instruments	1,0
9a	Ausgabepreis	99,82 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	18.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	18.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,60 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 27: Kapitalinstrument 9

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPPF400JY06
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,1
9	Nennwert des Instruments	1,0
9a	Ausgabepreis	99,82 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	18.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	18.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,60 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 28: Kapitalinstrument 10

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPPF400K025
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,5
9	Nennwert des Instruments	5,0
9a	Ausgabepreis	99,96 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	18.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	18.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,64 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 29: Kapitalinstrument 11

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPPF400K108
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,5
9	Nennwert des Instruments	5,0
9a	Ausgabepreis	99,89 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	21.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	20.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	n/a
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	k.A.
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,63 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 30: Kapitalinstrument 12

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP540Z8598
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,6
9	Nennwert des Instruments	5,0
9a	Ausgabepreis	99,86 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	21.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	23.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,66 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 31: Kapitalinstrument 13

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP540Z883
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1,1
9	Nennwert des Instruments	10,0
9a	Ausgabepreis	99,98 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	23.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	23.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,68 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 32: Kapitalinstrument 14

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP540Z9D11
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1,1
9	Nennwert des Instruments	10,0
9a	Ausgabepreis	100,00 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	24.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	24.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,82 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 33: Kapitalinstrument 15

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP540Z9E93
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1,1
9	Nennwert des Instruments	10,0
9a	Ausgabepreis	100,00 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	24.07.08
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	24.07.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	6,82 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 34: Kapitalinstrument 16

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP4J024701
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,2
9	Nennwert des Instruments	0,5
9a	Ausgabepreis	99,33 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	07.08.09
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	07.08.19
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,67 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 35: Kapitalinstrument 17

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP4J024883
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1,7
9	Nennwert des Instruments	5,5
9a	Ausgabepreis	99,33 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	07.08.09
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	07.08.19
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,67 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegsklausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 36: Kapitalinstrument 18

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP4S0UWF99
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	0,2
9	Nennwert des Instruments	0,7
9a	Ausgabepreis	99,47 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	21.08.09
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	21.08.19
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,60 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 37: Kapitalinstrument 19

Merkmal		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFPP69094G56
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Schuldscheindarlehen
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	5,3
9	Nennwert des Instruments	10,0
9a	Ausgabepreis	99,48 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	09.09.09
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	09.09.20
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,85 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 38: Kapitalinstrument 20

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFBB00041788
3	Für das Instrument geltendes Recht	englisches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Inhaberschuldverschreibung
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	17,8
9	Nennwert des Instruments	75,0
9a	Ausgabepreis	100,50 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	31.01.99
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	31.03.19
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit mit 7 Tage-Frist) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	variabel
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	10Y CMS
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 39: Kapitalinstrument 21

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFBB00041424
3	Für das Instrument geltendes Recht	englisches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Inhaberschuldverschreibung
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	1,0
9	Nennwert des Instruments	7,2
9a	Ausgabepreis	101,50 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	24.09.98
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	25.09.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit mit 7 Tage-Frist) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	variabel
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	USD/JPY FX
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 40: Kapitalinstrument 22

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XFBB00041416
3	Für das Instrument geltendes Recht	englisches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Inhaberschuldverschreibung
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	2,1
9	Nennwert des Instruments	14,4
9a	Ausgabepreis	100,50 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	24.09.98
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	25.09.18
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit mit 7 Tage-Frist) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung („tax call“); Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	variabel
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	USD/JPY FX
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	Forderungen gem. § 39 I Nr. 5 InsO
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	nein
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

Tabelle 41: Kapitalinstrument 23

Merkmale		
1	Emittent	Landesbank Berlin AG
2	Einheitliche Kennung (z. B. CUSIP, ISIN oder Bloomberg-Kennung für Privatplatzierung)	XS0468940068
3	Für das Instrument geltendes Recht	deutsches Recht
Aufsichtsrechtliche Behandlung		
4	CRR-Übergangsregelungen	Ergänzungskapital
5	CRR-Regelungen nach der Übergangszeit	Ergänzungskapital
6	Anrechenbar auf Solo-/Konzern-/Solo- und Konzernebene	Solo- und Konzernebene
7	Instrumenttyp (Typen von jedem Land zu spezifizieren)	Inhaberschuldverschreibung
8	Auf aufsichtsrechtliche Eigenmittel anrechenbarer Betrag (Währung in Millionen, Stand letzter Meldestichtag)	188,6
9	Nennwert des Instruments	500,0
9a	Ausgabepreis	99,82 %
9b	Tilgungspreis	100,00 %
10	Rechnungslegungsklassifikation	Passivum-fortgeführter Einstandswert
11	Ursprüngliches Ausgabedatum	25.11.09
12	Unbefristet oder mit Verfalltermin	mit Verfalltermin
13	Ursprünglicher Fälligkeitstermin	25.11.19
14	Durch Emittenten kündbar mit vorheriger Zustimmung der Aufsicht	nein
15	Wählbarer Kündigungstermin, bedingte Kündigungstermine und Tilgungsbetrag	Kündigungsmöglichkeit (jederzeit mit 30-Tage-Frist) im Falle eines steuerlichen Ereignisses gemäß § 10 Abs. (5a) Satz 3 KWG alte Fassung. Tilgungsbetrag: Nominalbetrag
16	Spätere Kündigungstermine, wenn anwendbar	k.A.
Coupons/Dividenden		
17	Feste oder variable Dividenden-/Couponzahlungen	fest
18	Nominalcoupon und etwaiger Referenzindex	5,88 %
19	Bestehen eines „Dividenden-Stopps“	k.A.
20a	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (zeitlich)	zwingend
20b	Vollständig diskretionär, teilweise diskretionär oder zwingend (in Bezug auf den Betrag)	zwingend
21	Bestehen einer Kostenanstiegs Klausel oder eines anderen Tilgungsanreizes	nein
22	Nicht kumulativ oder kumulativ	k.A.
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.
35	Position in der Rangfolge im Liquidationsfall (das jeweils ranghöhere Instrument nennen)	sämtliche Verbindlichkeiten ohne Nachrangvereinbarung
36	Unvorschriftsmäßige Merkmale der gewandelten Instrumente	ja
37	Ggf. unvorschriftsmäßige Merkmale nennen	k.A.

9.3 Art und Beträge der Eigenmittelelemente

Die LBB AG nutzt im Kernkapital keine Anrechnungserleichterungen aus den Übergangsregeln gemäß der Verordnung 575/2013. Für Nachranginstrumente, die

die Anforderungen der CRR an das Ergänzungskapital nicht vollständig erfüllen, finden die Übergangsregeln gemäß der CRR Anwendung.

Tabelle 42: Eigenmittelelemente

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
1	Kapitalinstrumente und das mit ihnen verbundene Agio	1.200,00	26 (1), 27, 28, 29, Verzeichnis der EBA gemäß Artikel 26 Absatz 3	
	davon: Grundkapital	1.200,00	Verzeichnis der EBA gemäß Artikel 26 Absatz 3	
	davon: Art des Finanzinstruments 2	0,00	Verzeichnis der EBA gemäß Artikel 26 Absatz 3	
	davon: Art des Finanzinstruments 3	0,00	Verzeichnis der EBA gemäß Artikel 26 Absatz 3	
2	einbehaltene Gewinne	41,21	26 (1) (c)	
3	Kumuliertes sonstiges Ergebnis (und sonstige Rücklagen, zur Berücksichtigung nicht realisierter Gewinne und Verluste nach den anwendbaren Rechnungslegungsstandards)	920,04	26 (1)	
3a	Fonds für allgemeine Bankrisiken	97,56	26 (1) (f)	
4	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 484 Absatz 3 zuzüglich des mit ihnen verbundenen Agio, dessen Anrechnung auf das CET1 ausläuft	0,00	486 (2)	
	Staatliche Kapitalzuführungen mit Bestandsschutz bis 1. Januar 2018	0,00	483 (2)	
5	Minderheitsbeteiligungen (zulässiger Betrag in konsolidiertem CET1)	0,00	84, 479, 480	
5a	Von unabhängiger Stelle geprüfte Zwischengewinne, abzüglich aller vorhersehbarer Abgaben oder Dividenden	0,00	26 (2)	
6	Hartes Kernkapital (CET1) vor regulatorischen Anpassungen	2.258,80		
Hartes Kernkapital (CET1): regulatorische Anpassungen				
7	Zusätzliche Bewertungsanpassungen (negativer Betrag)	0,00	34, 105	
8	Immaterielle Vermögenswerte (verringert um entsprechende Steuerschulden) (negativer Betrag)	-22,52	36 (1) (b), 37, 472 (4)	
9	In der EU: leeres Feld			
10	Von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche, ausgenommen derjenigen, die aus temporären Differenzen resultieren (verringert um entsprechende Steuerschulden, wenn die Bedingungen von Artikel 38 Absatz 3 erfüllt sind) (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (c), 38, 472 (5)	
11	Rücklagen aus Gewinnen oder Verlusten aus zeitwertbilanzierten Geschäften zur Absicherung von Zahlungsströmen	0,00	33 (a)	
12	Negative Beträge aus der Berechnung der erwarteten Verlustbeträge	-0,36	36 (1) (d), 40, 159, 472 (6)	

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
13	Anstieg des Eigenkapitals, der sich aus verbrieften Aktiva ergibt (negativer Betrag)	0,00	32 (1)	
14	Durch Veränderungen der eigenen Bonität bedingte Gewinne oder Verluste aus zum beizulegenden Zeitwert bewerteten eigenen Verbindlichkeiten	0,00	33 (b)	
15	Vermögenswerte aus Pensionsfonds mit Leistungszusage (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (e), 41, 472 (7)	
16	Direkte und indirekte Positionen eines Instituts in eigenen Instrumenten des harten Kernkapitals (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (f), 42, 472 (8)	
17	Positionen 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)	0,00	36 (1) (g), 44, 472 (9)	
18	Direkte und indirekte Positionen eines Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufsoptionen) (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (h), 43, 45, 46, 49 (2) (3), 79, 472 (10)	
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)	0,00	36 (1) (i), 43, 45, 47, 48 (i) (b), 49 (1) bis (3), 79, 470, 472 (11)	
20	In der EU: leeres Feld			
20a	Forderungsbetrag aus folgenden Posten, denen ein Risikogewicht von 1250 % zuzuordnen ist, wenn das Institut als Alternative denen Forderungsbetrag vom Betrag der Posten des harten Kernkapitals abzieht	0,00	36 (1) (k)	
20b	davon: qualifizierte Beteiligungen außerhalb des Finanzsektors (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (k) (i), 89 bis 91	
20c	davon: Verbriefungspositionen (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (k) (ii), 243 (1) (b), 244 (1) (b), 258	
20d	davon: Vorleistungen	0,00	36 (1) (k) (iii), 379 (3)	
21	Von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche, die aus temporären Differenzen resultieren (über dem Schwellenwert von 10 %, verringert um entsprechende Steuerschulden, wenn die Bedingungen von Artikel 38 Absatz 3 erfüllt sind) (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (c), 38, 48 (1) (a), 470, 472 (5)	
22	Betrag, der über dem Schwellenwert von 15 % liegt (negativer Betrag)	0,00	48 (1)	
23	davon: direkte und indirekte Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält	0,00	36 (1) (i), 48 (1) (b), 470, 472 (11)	
24	In der EU: leeres Feld			
25	davon: von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche, die aus temporären Differenzen resultieren	0,00	36 (1) (c), 38, 48 (1) (a), 470, 472 (5)	
25a	Verluste des laufenden Geschäftsjahres (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (a), 472 (3)	
25b	Vorhersehbare steuerliche Belastung auf Posten des harten Kernkapitals (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (l)	

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
26	Regulatorische Anpassungen des harten Kernkapitals in Bezug auf Beträge, die der Vor-CRR-Behandlung unterliegen	0,00		
26a	Regulatorische Anpassungen im Zusammenhang mit nicht realisierten Gewinnen und Verlusten gemäß Artikel 467 und 468	0,00		
	davon: ... Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Verluste 1	0,00	467	
	davon: ... Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Verluste 2	0,00	467	
	davon: ... Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Gewinne 1	0,00	468	
	davon: ... Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Gewinne 2	0,00	468	
26b	Vom harten Kernkapital in Abzug zu bringender oder hinzuzurechnender Betrag in Bezug auf zusätzliche Abzugs- oder Korrekturposten und gemäß der Vor-CRR-Behandlung erforderliche Abzüge	0,00	481	
	davon: ...	0,00	481	
27	Betrag der von Posten des zusätzlichen Kernkapitals in Abzug zu bringenden Posten, der das zusätzliche Kernkapital des Instituts überschreitet (negativer Betrag)	0,00	36 (1) (j)	
28	Regulatorische Anpassungen des harten Kernkapitals (CET1) insgesamt	-22,88		
29	Hartes Kernkapital (CET1)	2.235,92		
Zusätzliches Kernkapital (AT1): Instrumente				
30	Kapitalinstrumente und das mit ihnen verbundene Agio	0,00	51, 52	
31	davon: gemäß anwendbaren Rechnungslegungsstandards als Eigenkapital eingestuft	0,00		
32	davon: gemäß anwendbaren Rechnungslegungsstandards als Passiva eingestuft	0,00		
33	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 484 Absatz 4 zuzüglich des mit ihnen verbundenen Agio, dessen Anrechnung auf das AT1 ausläuft	0,00	486 (3)	
	Staatliche Kapitalzuführungen mit Bestandsschutz bis 1. Januar 2018	0,00	483 (3)	
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	0,00	85, 86, 480	
35	davon: von Tochterunternehmen begebene Instrumente, deren Anrechnung ausläuft	0,00	486 (3)	
36	Zusätzliches Kernkapital (AT1) vor regulatorischen Anpassungen	0,00		

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
Zusätzliches Kernkapital (AT1): regulatorische Anpassungen				
37	Direkte und indirekte Positionen eines Instituts in eigenen Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals (negativer Betrag)	0,00	52 (1) (b), 56 (a), 57, 475 (2)	
38	Positionen in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, die eine Überkreuzbeteiligung mit den Instrument eingegangen sind, die dem Ziel dienen, dessen Eigenmittel künstlich zu erhöhen (negativer Betrag)	0,00	56 (b), 58, 475 (3)	
39	Direkte und indirekte 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 Verkaufsoptionen) (negativer Betrag)	0,00	56 (c), 59, 60, 79, 475 (4)	
40	Direkte und indirekte Positionen des Instituts in Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10% und abzüglich anrechenbarer Verkaufsoptionen) (negativer Betrag)	0,00	56 (d), 59, 79, 475 (4)	
41	Regulatorische Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals in Bezug auf Beträge, die der Vor-CRR-Behandlung während der Übergangszeit unterliegen, für die Auslaufregelungen gemäß der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gelten (d. h. CRR-Restbeträge)	0,00		
41a	Vom zusätzlichen Kernkapital in Abzug zu bringende Restbeträge in Bezug auf vom harten Kernkapital in Abzug zu bringende Posten während der Übergangszeit gemäß Artikel 472 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0,00	472, 472(3)(a), 472 (4), 472 (6), 472 (8) (a), 472 (9), 472 (10) (a), 472 (11) (a)	
	davon Zeile für Zeile aufzuführende Posten, z. B. materielle Zwischenverluste (netto), immaterielle Vermögenswerte, Ausfälle von Rückstellungen für zu erwartende Verluste usw.	0,00		
41b	Vom zusätzlichen Kernkapital in Abzug zu bringende Restbeträge in Bezug auf vom Ergänzungskapital in Abzug zu bringende Posten während der Übergangszeit gemäß Artikel 472 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0,00	477, 477 (3), 477 (4) (a)	
	davon Zeile für Zeile aufzuführende Posten, z. B. Überkreuzbeteiligungen an Instrumenten des Ergänzungskapitals, direkte Positionen nicht wesentlicher Beteiligungen am Kapital anderer Unternehmen der Finanzbranche usw.	0,00		
41c	Vom zusätzlichen Kernkapital in Abzug zu bringender oder hinzuzurechnender Betrag in Bezug auf zusätzliche Abzugs- oder Korrekturposten und gemäß der Vor-CRR-Behandlung erforderliche Abzüge	0,00	467, 468, 481	
	davon: ... mögliche Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Verluste	0,00	467	
	davon: ... mögliche Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Gewinne	0,00	468	
	davon: ...	0,00	481	
42	Betrag der von den Posten des Ergänzungskapitals in Abzug zu bringenden Posten, der das Ergänzungskapital des Instituts überschreitet (negativer Betrag)	0,00	56 (e)	
43	Regulatorische Anpassungen des zusätzlichen Kernkapitals (AT1)	0,00		
44	Zusätzliches Kernkapital (AT1)	0,00		
45	Kernkapital (T1 = CET1 + AT1)	2.235,92		

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
Ergänzungskapital (T2): Instrumente und Rücklagen				
46	Kapitalinstrumente und das mit ihnen verbundene Agio	207,43	62, 63	
47	Betrag der Posten im Sinne von Artikel 484 Absatz 5 zuzüglich des mit ihnen verbundenen Agios, dessen Anrechnung auf das T2 ausläuft	127,28	486 (4)	
	Staatliche Kapitalzuführungen mit Bestandsschutz bis 1. Januar 2018	0,00	483 (4)	
48	Zum konsolidierten Ergänzungskapital zählende Instru- mente des qualifizierten Kernkapitals (einschließlich nicht in den Zeilen 5 bzw. 34 enthaltener Minderheitsbeteiligun- gen und AT1-Instrumente), die von Tochterunternehmen begeben worden sind und von Drittparteien gehalten werden	0,00	87, 88, 480	
49	davon: von Tochterunternehmen begebene Instrumente, deren Anrechnung ausläuft	0,00	486 (4)	
50	Kreditrisikoanpassungen	71,16	62 (c) und (d)	
51	Ergänzungskapital (T2) vor regulatorischen Anpassungen	405,87		
Ergänzungskapital (T2): regulatorische Anpassungen				
52	Direkte und indirekte Positionen eines Instituts in eigenen Instrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangigen Darlehen (negativer Betrag)	0,00	63 (b) (i), 66 (a), 67, 477 (2)	
53	Positionen in Instrumenten des Ergänzungskapitals und nachrangige Darlehen von Unternehmen der Finanz- branche, die eine Überkreuzbeteiligung mit dem Institut eingegangen sind, die dem Ziel dient, dessen Eigenmittel künstlich zu erhöhen	0,00	66 (b), 68, 477 (3)	
54	Direkte und indirekte Positionen des Instituts in Instru- menten des Ergänzungskapitals und nachrangige Darlehen von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (mehr als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	0,00	66 (c), 69, 70, 79, 477 (4)	
54a	davon: neue Positionen, die keinen Übergangsbestim- mungen unterliegen	0,00		
54b	davon: Positionen, die vor dem 1. Januar 2013 bestanden und Übergangsbestimmungen unterliegen	0,00		
55	Direkte und indirekte Positionen des Instituts in Instru- menten des Ergänzungskapitals und nachrangigen Darlehen von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen) (negativer Betrag)	-1,00	66 (d), 69, 79, 477 (4)	
56	Regulatorische Anpassungen des Ergänzungskapitals in Bezug auf Beträge, die der Vor-CRR-Behandlung und Behandlungen während der Übergangszeit unterliegen, für die Auslaufregelungen gemäß der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gelten (d. h. CRR-Restbestände)	0,00		
56a	Vom Ergänzungskapital in Abzug zu bringende Restbeträge in Bezug auf vom harten Kernkapital in Abzug zu bringende Posten während der Übergangszeit gemäß Artikel 472 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0,00	472, 472 (3)(a), 472 (4), 472(6), 472 (8) (a), 472 (9), 472 (10) (a), 472 (11) (a)	
	davon Zeile für Zeile aufzuführende Posten, z. B. materielle Zwischenverluste (netto), immaterielle Vermögenswerte, Ausfälle von Rückstellungen für zu erwartende Verluste usw.	0,00		

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
56b	Vom Ergänzungskapital in Abzug zu bringende Restbeträge in Bezug auf vom zusätzlichen Kernkapital in Abzug zu bringende Posten während der Übergangszeit gemäß Artikel 475 der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	0,00	475, 475 (2) (a), 475 (3), 475 (4) (a)	
	davon Zeile für Zeile aufzuführende Posten, z. B. Überkreuzbeteiligungen an Instrumenten des zusätzlichen Kernkapitals, direkte Positionen nicht wesentlicher Beteiligungen am Kapital anderer Unternehmen der Finanzbranche	0,00		
56c	Vom Ergänzungskapital in Abzug zu bringender oder hinzuzurechnender Betrag in Bezug auf zusätzliche Abzugs- und Korrekturposten und gemäß der Vor-CRR-Behandlung erforderliche Abzüge	0,00	467, 468, 481	
	davon: ... mögliche Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Verluste	0,00	467	
	davon: ... mögliche Abzugs- und Korrekturposten für nicht realisierte Gewinne	0,00	468	
	davon: ...	0,00	481	
57	Regulatorische Anpassungen des Ergänzungskapitals (T2) insgesamt	-1,00		
58	Ergänzungskapital (T2)	404,87		
59	Eigenkapital insgesamt (TC = T1 + T2)	2.640,79		
59a	Risikogewichtete Aktiva in Bezug auf Beträge, die der Vor-CRR-Behandlung und Behandlung während der Übergangszeit unterliegen, für die Auslaufregelungen gemäß der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 gelten (d. h. CRR-Restbeträge)	0,00		
	davon: ... nicht vom harten Kernkapital in Abzug zu bringende Posten (Verordnung (EU) Nr. 575/2013, Restbeträge)	0,00	472, 472 (5), 472 (8) (b), 472(10) (b), 472 (11) (b)	
	(Zeile für Zeile aufzuführende Posten, z. B. von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche, verringert um entsprechende Steuerschulden, indirekte Positionen in eigenen Instrumenten des harten Kernkapitals usw.)	0,00	475, 475 (2) (b), 475 (2) (c), 475(4) (b)	
	davon: ... nicht von Posten des Ergänzungskapitals in Abzug zu bringende Posten (Verordnung (EU) Nr. 575/2013, Restbeträge) (Zeile für Zeile aufzuführende Posten, z. B. indirekte Positionen in Instrumenten des eigenen Ergänzungskapitals, indirekte Positionen nicht wesentlicher Beteiligungen am Kapital anderer Unternehmen der Finanzbranche, indirekte Positionen wesentlicher Beteiligungen am Kapital anderer Unternehmen der Finanzbranche usw.)	0,00	477, 477 (2) (b), 477 (2) (c), 477(4) (b)	
60	Risikogewichtete Aktiva insgesamt	12.818,09		
Eigenkapitalquoten und -puffer				
61	Harte Kernkapitalquote (ausgedrückt als Prozentsatz des Gesamtforderungsbetrags)	17,44 %	92 (2) (a), 465	
62	Kernkapitalquote (ausgedrückt als Prozentsatz des Gesamtforderungsbetrags)	17,44 %	92 (2) (b), 465	
63	Gesamtkapitalquote (ausgedrückt als Prozentsatz des Gesamtforderungsbetrags)	20,60 %	92 (2) (c)	

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
64	Institutsspezifische Anforderung an Kapitalpuffer (Mindestanforderung an die harte Kernkapitalquote nach Artikel 92 Absatz 1 Buchstabe a, zuzüglich der Anforderungen an Kapitalerhaltungspuffer und antizyklische Kapitalpuffer, Systemrisikopuffer und Puffer für systemrelevante Institute (G-SRI oder A-SRI), ausgedrückt als Prozentsatz des Gesamtforderungsbetrags)	5,76 %	CRD 128, 129, 130	
65	davon: Kapitalerhaltungspuffer	1,25 %		
66	davon: antizyklischer Kapitalpuffer	0,01 %		
67	davon: Systemrisikopuffer	0,00 %		
67a	davon: Puffer für global systemrelevante Institute (G-SRI) oder andere systemrelevante Institute (A-SRI)	0,00 %	CRD 131	
68	Verfügbares hartes Kernkapital für die Puffer (ausgedrückt als Prozentsatz des Gesamtforderungsbetrags)	12,94 %	CRD 128	
69	[in EU-Verordnung nicht relevant]			
70	[in EU-Verordnung nicht relevant]			
71	[in EU-Verordnung nicht relevant]			
Beträge unter den Schwellenwerten für Abzüge (vor Risikogewichtung)				
72	Direkte und indirekte Positionen des Instituts in Kapitalinstrumenten von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut keine wesentliche Beteiligung hält (weniger als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen)	74,61	36 (1) (h), 45, 46, 471 (10), 56 (c), 59, 60, 475 (4), 66 (c), 69, 70, 477 (4)	
73	Direkte und indirekte Positionen des Instituts in Instrumenten des harten Kernkapitals von Unternehmen der Finanzbranche, an denen das Institut eine wesentliche Beteiligung hält (weniger als 10 % und abzüglich anrechenbarer Verkaufspositionen)	16,04	36 (1) (i), 45, 48, 470, 472 (11)	
74	In der EU: leeres Feld			
75	Von der künftigen Rentabilität abhängige latente Steueransprüche, die aus temporären Differenzen resultieren (unter dem Schwellenwert von 10 %, verringert um entsprechende Steuerschulden, wenn die Bedingungen von Artikel 38 Absatz 3 erfüllt sind)	0,00	36 (1) (c), 38, 48, 470, 472 (5)	
Anwendbare Obergrenzen für die Einbeziehung von Wertberichtigungen in das Ergänzungskapital				
76	Auf das Ergänzungskapital anrechenbare Kreditrisikopassungen in Bezug auf Forderungen, für die der Standardansatz gilt (vor Anwendung der Obergrenze)	10,10	62	
77	Obergrenze für die Anrechnung von Kreditrisikopassungen auf das Ergänzungskapital im Rahmen des Standardansatzes	18,05	62	
78	Auf das Ergänzungskapital anrechenbare Kreditrisikopassungen in Bezug auf Forderungen, für die der auf internen Beurteilungen basierende Ansatz gilt (vor Anwendung der Obergrenze)	299,90	62	
79	Obergrenze für die Anrechnung von Kreditrisikopassungen auf das Ergänzungskapital im Rahmen des auf internen Beurteilungen basierenden Ansatzes	61,05	62	

Hartes Kernkapital: Instrumente und Rücklagen		(A) Betrag am Tag der Offenlegung	(B) Verweis auf Artikel in der Verordnung (EU) Nr. 575/2013	(C) Beträge, die der Behandlung vor der Verordnung (EU) Nr. 575/2013 unterliegen oder vorgeschriebener Restbetrag gemäß Verordnung (EU) Nr. 575/2013
in Mio. €				
Eigenkapitalinstrumente, für die die Auslaufregelungen gelten (anwendbar nur vom 1. Januar 2013 bis 1. Januar 2022)				
80	Derzeitige Obergrenze für CET1-Instrumente, für die die Auslaufregelungen gelten	0,00	484 (3), 486 (2) und (5)	
81	Wegen Obergrenze aus CET1 ausgeschlossener Betrag (Betrag über Obergrenze nach Tilgungen und Fälligkeiten)	0,00	484 (3), 486 (2) und (5)	
82	Derzeitige Obergrenze für AT1-Instrumente, für die die Auslaufregelungen gelten	0,00	484 (4), 486 (3) und (5)	
83	Wegen Obergrenze aus AT1 ausgeschlossener Betrag (Betrag über Obergrenze nach Tilgungen und Fälligkeiten)	0,00	484 (4), 486 (3) und (5)	
84	Derzeitige Obergrenze für T2-Instrumente, für die die Auslaufregelungen gelten	127,28	484 (5), 486 (4) und (5)	
85	Wegen Obergrenze aus T2 ausgeschlossener Betrag (Betrag über Obergrenze nach Tilgungen und Fälligkeiten)	5,72	484 (5), 486 (4) und (5)	

9.4 Tabellenverzeichnis

Tabelle 1:	Eigenmittelüberleitungsrechnung	4
Tabelle 2:	Eigenkapitalelemente nach Feststellung, Kurzfassung	5
Tabelle 3:	Eigenmittelanforderung nach Risikoarten	6
Tabelle 4:	Eigenmittelanforderung KSA nach Forderungsklassen	7
Tabelle 5:	Eigenmittelanforderung IRBA nach Forderungsklassen	7
Tabelle 6:	Eigenmittelanforderung Operationelle Risiken	8
Tabelle 7:	Geografische Verteilung der wesentlichen Kreditrisikopositionen	9
Tabelle 8:	Institutsspezifischer Kapitalpuffer	10
Tabelle 9:	Durchschnittliche Risikopositionen	13
Tabelle 10:	Risikopositionen nach Region	14
Tabelle 11:	Risikoposition nach Branchen	15
Tabelle 12:	Risikoposition nach Restlaufzeiten	16
Tabelle 13:	Notleidende und überfällige Positionen	17
Tabelle 14:	Veränderung der Wertberichtigungen und Rückstellungen gemäß Jahresabschluss der LBB	18
Tabelle 15:	Kreditrisikominderung	20
Tabelle 16:	Verschuldung, summarischer Vergleich	22
Tabelle 17:	Verschuldungsquote	22
Tabelle 18:	Verschuldung, bilanzielle Risikopositionen	24
Tabelle 19:	Kapitalinstrument 1	26
Tabelle 20:	Kapitalinstrument 2	27
Tabelle 21:	Kapitalinstrument 3	28
Tabelle 22:	Kapitalinstrument 4	29
Tabelle 23:	Kapitalinstrument 5	30
Tabelle 24:	Kapitalinstrument 6	31
Tabelle 25:	Kapitalinstrument 7	32
Tabelle 26:	Kapitalinstrument 8	33
Tabelle 27:	Kapitalinstrument 9	34
Tabelle 28:	Kapitalinstrument 10	35
Tabelle 29:	Kapitalinstrument 11	36
Tabelle 30:	Kapitalinstrument 12	37
Tabelle 31:	Kapitalinstrument 13	38
Tabelle 32:	Kapitalinstrument 14	39
Tabelle 33:	Kapitalinstrument 15	40
Tabelle 34:	Kapitalinstrument 16	41
Tabelle 35:	Kapitalinstrument 17	42
Tabelle 36:	Kapitalinstrument 18	43
Tabelle 37:	Kapitalinstrument 19	44
Tabelle 38:	Kapitalinstrument 20	45
Tabelle 39:	Kapitalinstrument 21	46
Tabelle 40:	Kapitalinstrument 22	47
Tabelle 41:	Kapitalinstrument 23	48
Tabelle 42:	Eigenmittelelemente	49

Landesbank Berlin AG
Berliner Sparkasse
Alexanderplatz 2
10178 Berlin
Telefon: 030/869 801
info@berliner-sparkasse.de
www.berliner-sparkasse.de