

RAIFFEISEN

Regulatorisch anrechenbare Eigenmittel - Überleitung Bilanzwerte

Bilanz	30.6.2016 in 1000 CHF	31.12.2015 in 1000 CHF	Referenz ¹
Aktiven			
Flüssige Mittel	19'514'094	18'907'231	
Forderungen gegenüber Banken	6'029'817	3'811'404	
Forderungen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	368'883	391'404	
Forderungen gegenüber Kunden	7'974'348	7'885'116	
Hypothekarforderungen	162'006'810	158'593'585	
Handelsgeschäft	3'018'893	2'115'027	
Positive Wiederbeschaffungswerte derivater Finanzinstrumente	2'197'813	1'795'296	
Finanzanlagen	7'266'671	6'877'419	
Aktive Rechnungsabgrenzungen	332'733	225'196	
Nicht konsolidierte Beteiligungen	768'850	731'891	
Sachanlagen	2'512'600	2'475'780	
Immaterielle Werte	489'604	512'757	
<i>davon Goodwill</i>	489'604	512'757	(I)
Sonstige Aktiven	1'058'209	1'426'065	
Total Aktiven	213'539'325	205'748'171	
Passiven			
Verpflichtungen gegenüber Banken	10'872'819	7'803'302	
Verpflichtungen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	2'312'830	4'084'475	
Verpflichtungen aus Kundeneinlagen	154'244'271	150'272'350	
<i>davon nachrangige Termingeldanlagen, anrechenbar als Ergänzungskapital (T2)</i>	77'371	77'430	(II)
Verpflichtungen aus Handelsgeschäften	122'749	105'139	
Negative Wiederbeschaffungswerte derivater Finanzinstrumente	3'054'957	2'397'684	
Verpflichtungen aus übrigen Finanzinstrumenten mit Fair-Value-Bewertung	1'624'313	870'029	
Kassenobligationen	1'385'836	1'647'436	
Anleihen und Pfandbriefdarlehen	24'288'926	23'470'245	
<i>davon nachrangige Anleihe, anrechenbar als zusätzliches Kernkapital (AT1)²</i>	1'149'340	1'150'000	(III)
<i>davon nachrangige Anleihe, anrechenbar als Ergänzungskapital (T2) - phase out</i>	319'686	369'933	(IV)
Passive Rechnungsabgrenzungen	835'555	711'202	
Sonstige Passiven	97'727	183'016	
Rückstellungen	894'804	877'574	
<i>davon latente Steuern für unversteuerte Reserven</i>	851'992	830'813	
Genossenschaftskapital	1'394'629	1'248'277	
<i>davon als hartes Kernkapital anrechenbar (CET1)</i>	1'394'629	1'248'277	(V)
Gewinnreserven	12'036'214	11'262'202	(VI)
Währungsumrechnungsreserve	30	11	
Gruppengewinn	366'623	807'662	(VII)
Minderheitsanteile am Eigenkapital	7'042	7'567	
<i>davon als hartes Kernkapital anrechenbar (CET1)</i>			- (VIII)
Total Eigenkapital (mit Minderheitsanteilen)	13'804'538	13'325'719	
Total Passiven	213'539'325	205'748'171	

¹ Die Referenzen beziehen sich auf die Tabelle 'Mindesteigenmittelanforderung und regulatorisch anrechenbare Eigenmittel'

² Berichtsjahr: davon Wandlungskapital mit tiefem Auslösungssatz in der Höhe von 549 Millionen Franken

RAIFFEISEN

Mindesteigenmittelanforderung und regulatorisch anrechenbare Eigenmittel

	30.6.2016		31.12.2015		31.12.2014	
	Basel III		Basel III		Basel III	
	Risikogew. Positionen in 1000 CHF	Eigenmittel- anforderung in 1000 CHF	Risikogew. Positionen in 1000 CHF	Eigenmittel- anforderung in 1000 CHF	Risikogew. Positionen ¹ in 1000 CHF	Eigenmittel- anforderung in 1000 CHF
Mindesteigenmittelanforderung						
Kreditrisiken (Standardansatz BIZ)						
Forderungen gegenüber Banken	463'081	37'046	364'180	29'134	976'731	78'138
Forderungen gegenüber Kunden	5'245'685	419'655	5'024'441	401'955	4'958'101	396'648
Hypothekarforderungen	68'232'694	5'458'616	66'658'223	5'332'658	63'543'490	5'083'479
Positive Wiederbeschaffungswerte derivativer Finanzinstrumente	49'605	3'968	57'537	4'603	44'155	3'532
Aktive Rechnungsabgrenzungen	189'758	15'181	107'612	8'609	74'451	5'956
Sonstige Aktiven	146'778	11'742	141'568	11'325	141'822	11'346
Netto Zinspositionen ausserhalb des Handelsbuchs	1'053'683	84'295	1'223'393	97'871	880'541	70'442
Netto Aktienpositionen ausserhalb des Handelsbuchs ²	2'038'825	163'106	1'969'847	157'588	1'743'186	139'455
Eventualverpflichtungen	300'359	24'029	157'413	12'593	121'625	9'730
Unwiderrufliche Zusagen	1'368'747	109'500	1'311'506	104'920	996'163	79'693
Einzahlungs- und Nachschussverpflichtungen	118'542	9'483	105'959	8'477	96'676	7'734
Add-ons-Terminkontrakte und gekaufte Optionen	175'098	14'008	191'698	15'336	193'572	15'486
Nicht abgewickelte Transaktionen		4		2		3
Garantieverpflichtungen gegenüber zentralen Gegenparteien (CCPs)		335		355		11
CVA (Standardansatz)		9'469		12'018		11'121
Erforderliche Eigenmittel für Kreditrisiken und sonstige Kreditrisikopositionen		6'360'436		6'197'445		5'912'775
Nicht gegenparteibezogene Risiken						
Liegenschaften (inkl. Liegenschaften in den Finanzanlagen)	2'310'488	184'839	2'251'938	180'155	2'166'113	173'289
Übrige Sachanlagen/andere bilanzierte abschreibungspflichtige Aktivierungen	237'463	18'997	251'888	20'151	268'875	21'510
Erforderliche Eigenmittel für nicht gegenparteibezogene Risiken		203'836		200'306		194'799
Marktrisiko (Standardansatz)						
Zinsinstrumente - Allgemeines Marktrisiko		112'941		100'324		78'931
Zinsinstrumente - Spezifisches Risiko		36'650		25'495		30'941
Aktieninstrumente		24'702		17'143		19'443
Devisen und Gold		5'383		8'909		14'824
Übrige Edelmetalle		12'585		11'764		12'563
Optionen		21		185		281
Erforderliche Eigenmittel für Marktrisiken		192'282		163'820		156'983
Erforderliche Eigenmittel für operationelle Risiken (Basisindikatoransatz)		438'779		435'109		417'073
Total erforderliche Eigenmittel		7'195'333		6'996'680		6'681'630

Regulatorisch anrechenbare Eigenmittel	30.06.2016 Referenz ³	31.12.2015 Referenz ³	31.12.2014 Referenz ³
Genossenschaftskapital	1'394'629 (V)	1'248'277 (V)	747'742 (V)
Gewinnreserven	12'036'214 (VI)	11'262'202 (VI)	10'532'510 (VI)
Gruppengewinn ⁴	348'623 (VII)	773'362 (VII)	727'458 (VII)
Minderheitsanteile	- (VIII)	- (VIII)	- (VIII)
Total hartes Kernkapital (CET1) vor Anpassungen	13'779'466	13'283'841	12'007'710
Goodwil	-489'604 (I)	-512'757 (I)	-288'634 (I)
Beteiligungen über den Schwellenwerten	-	-	-
Total CET1-Anpassungen	-489'604	-512'757	-288'634
Total anrechenbares hartes Kernkapital (net CET1)	13'289'862	12'771'084	11'719'076
Zusätzliches Kernkapital (AT1) ⁵	1'149'340 (III)	1'150'000 (III)	550'000 (III)
Abzüge vom AT1-Kapital	-	-	-
Total anrechenbares Kernkapital (net Tier 1)	14'439'202	13'921'084	12'269'076
Ergänzungskapital (Tier 2)	397'057	447'363	490'618
davon vollständig anrechenbar	77'371 (II)	77'430 (II)	62'618 (II)
davon transitorisch anerkannt (phase out)	319'686 (IV)	369'933 (IV)	428'000 (IV)
Abzüge vom Ergänzungskapital (Tier 2)	-	-	-
Total anrechenbare Eigenmittel (regulatorisches Kapital)	14'836'259	14'368'447	12'759'694
Total risikogewichtete Aktiven	89'941'657	87'458'514	83'520'381
Kapitalquoten			
CET1-Quote	14.8%	14.6%	14.0%
Tier 1-Quote	16.1%	15.9%	14.7%
Gesamtkapitalquote	16.5%	16.4%	15.3%
CET1-Mindestanforderung gemäss ERV-Übergangsbestimmungen	6.3%	5.7%	5.2%
davon Eigenmittelpuffer gemäss ERV	0.6%	0.0%	0.0%
davon antizyklischer Puffer (AZP)	1.2%	1.2%	1.2%
Verfügbares CET1 (nach CET1-Abzügen zur Deckung der Mindestanforderungen an die AT1- resp. T2-Quoten)	13.0%	12.9%	11.3%
CET1 Eigenmittelziel gemäss FINMA-RS 2011/2 (inkl. AZP)	10.4%	10.4%	10.4%
Verfügbares CET1 (nach CET1-Abzügen zur Deckung der AT1- resp. T2-Zielquoten)	11.3%	11.2%	10.1%
Tier 1 Eigenmittelziel gemäss FINMA-RS 2011/2 (inkl. AZP)	12.6%	12.6%	12.6%
Verfügbares Tier 1 (nach CET1-Abzügen zur Deckung der T2-Zielquoten)	13.5%	13.4%	12.3%
Eigenmittelziel für das regulatorische Kapital gemäss FINMA-RS 2011/2 (inkl. AZP)	15.6%	15.6%	15.6%
Verfügbares regulatorisches Kapital	16.5%	16.4%	15.3%

Beträge unter den Schwellenwerten für Abzüge (vor Risikogewichtung)⁶

Beteiligungstitel im Finanzbereich bis 10%	327'243	341'442	289'054
Beteiligungstitel im Finanzbereich über 10%	465'076	427'456	393'801

¹ Aufteilung auf Bilanzpositionen gemäss alter Rechnungslegung (FINMA-RS 2008/2)

² Inklusive Beteiligungspapiere, die mit 250% risikogewichtet werden

³ Die Referenzen beziehen sich auf die Tabelle «Regulatorisch anrechenbare Eigenmittel – Überleitung Bilanzwerte».

⁴ Exkl. Verzinsung des Genossenschaftskapitals

⁵ Berichtsjahr: davon Wandlungskapital mit tiefem Auslösungsatz in der Höhe von 549 Millionen Franken

⁶ Die wesentlichen Beteiligungen gemäss Geschäftsbericht der Raiffeisen Gruppe, Anhang 7.2 «Nach Equity-Methode bewertete Beteiligungen» und Anhang 7.3 «Übrige nicht konsolidierte Beteiligungen» werden für die Eigenmittelabrechnungen risikogewichtet.*

RAIFFEISEN

Kreditrisiko nach Gegenpartei per 30. Juni 2016

Kreditengagements (in 1000 CHF)	Zentral- regierungen / - banken	Banken und Effekten- händler	Andere Institutionen	Unternehmen	Retail	Beteiligungs- titel	Übrige Positionen	Total
Bilanzpositionen								
Forderungen gegenüber Banken	10'249	6'019'568	-	-	-	-	-	6'029'817
Forderungen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	-	368'882	-	-	-	-	-	368'882
Forderungen gegenüber Kunden	2'588	132'247	2'907'333	1'689'844	3'242'336	-	-	7'974'348
Hypothekarforderungen	27'366	51'230	238'656	1'702'144	159'987'414	-	-	162'006'810
Wertschriften ausserhalb des Handelsbuchs ¹	573'260	516'879	1'100'583	2'951'889	-	605'384	-	5'747'995
Wiederbeschaffungswerte von Derivaten ²	-	143'174	-	24'141	105'235	-	-	272'550
Übrige Aktiven	236'207	219'057	6'158	181'214	153'486	-	-	796'122
Total Berichtsjahr	849'670	7'451'037	4'252'730	6'549'232	163'488'471	605'384	-	183'196'524
Total Vorjahr	1'525'120	5'010'511	4'294'594	6'813'198	160'366'284	621'498	-	178'631'205
Ausserbilanz³								
Eventualverpflichtungen	253	41'246	2'599	187'490	188'127	-	-	419'715
Unwiderrufliche Zusagen	128	142'564	590'140	224'089	1'552'003	-	-	2'508'924
Einzahlungs- und Nachschussverpflichtungen	4	-	-	118'538	-	-	-	118'542
Add-ons-Terminkontrakte und gekaufte Optionen ²	196	450'531	4'838	24'421	77'474	-	-	557'460
Total Berichtsjahr	581	634'341	597'577	554'538	1'817'604	-	-	3'604'641
Total Vorjahr	7'958	665'691	597'139	499'521	1'548'858	-	-	3'319'167

¹ Forderungen und Verpflichtungen gegenüber der Pfandbriefbank werden miteinander verrechnet.

² Das Gegenparteirisiko der Derivate ist nach der Marktwertmethode gerechnet. Nettingvereinbarungen mit Gegenparteien werden bei der Eigenmittelberechnung berücksichtigt.

³ Die nicht derivativen Ausserbilanzengagements sind nach Umrechnung in Kreditäquivalente ausgewiesen.

RAIFFEISEN

Kreditrisiko / Kreditrisikominderung per 30. Juni 2016

Kreditengagements (in 1000 CHF)	Gedeckt durch anerkannte finanzielle Sicherheiten ⁴	Gedeckt durch Garantien und Kreditderivate	Hypothekarische Deckung ⁵	Andere Kreditengagements	Total
Bilanzpositionen					
Forderungen gegenüber Banken	907'330	143'564	-	4'978'923	6'029'817
Forderungen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	368'882	-	-	-	368'882
Forderungen gegenüber Kunden	818'658	135'419	2'283'105	4'737'166	7'974'348
Hypothekarforderungen	255'420	70'111	161'554'368	126'911	162'006'810
Wertschriften ausserhalb des Handelsbuchs ¹	-	-	-	5'747'995	5'747'995
Wiederbeschaffungswerte von Derivaten ²	229'454	-	-	43'096	272'550
Übrige Aktiven	-	-	-	796'122	796'122
Total Berichtsperiode	2'579'744	349'094	163'837'473	16'430'213	183'196'524
Total Vorjahr	1'639'202	404'019	160'500'226	16'087'758	178'631'205
Ausserbilanz³					
Eventualverpflichtungen	74'465	6'074	35'246	303'930	419'715
Unwiderrufliche Zusagen	45'244	15'605	1'038'862	1'409'213	2'508'924
Einzahlungs- und Nachschussverpflichtungen	-	-	-	118'542	118'542
Add-ons-Terminkontrakte und gekaufte Optionen ²	179'698	4'783	-	372'979	557'460
Total Berichtsperiode	299'407	26'462	1'074'108	2'204'664	3'604'641
Total Vorjahr	188'331	39'843	1'041'319	2'049'674	3'319'167

¹ Forderungen und Verpflichtungen gegenüber der Pfandbriefbank werden miteinander verrechnet.

² Das Gegenparteirisiko der Derivate ist nach der Marktwertmethode gerechnet. Nettingvereinbarungen mit Gegenparteien werden bei der Eigenmittelberechnung berücksichtigt.

³ Die nicht derivativen Ausserbilanzengagements sind nach Umrechnung in Kreditäquivalente ausgewiesen.

⁴ Sicherheiten werden nach dem einfachen Ansatz angerechnet.

⁵ Die Zuordnung der Deckungen erfolgte aus der Optik der Eigenmittelloptimierung. Die Werte entsprechen deshalb nicht genau den Werten in der Spalte 'Hypothekarische Deckung' in der Tabelle '2. Deckungen von Forderungen und Ausserbilanzgeschäften'.

RAIFFEISEN

Segmentierung der Kreditrisiken per 30. Juni 2016

Kreditengagements (in 1000 CHF)	Aufsichtsrechtliche Risikogewichte									Total
	0%	2%	20%	35%	50%	75%	100%	125%	150%	
Bilanzpositionen										
Forderungen gegenüber Banken	3'983	168	1'639	-	228	-	13	-	-	6'030
Forderungen aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	369	-	0	-	-	-	-	-	-	369
Forderungen gegenüber Kunden	250	-	204	1'412	2'478	767	2'825	-	39	7'975
Hypothekarforderungen	230	-	38	137'535	81	16'685	7'301	-	136	162'007
Wertschriften ausserhalb des Handelsbuchs ¹	700	-	4'054	-	278	-	175	-	542	5'748
Wiederbeschaffungswerte von Derivaten ²	136	-	101	-	12	-	23	-	-	272
Übrige Aktiven	339	-	141	-	9	12	295	-	-	796
Total Berichtsperiode	6'007	168	6'177	138'947	3'086	17'464	10'632	-	717	183'197
Total Vorjahr	5'009	28	6'121	136'160	3'246	17'261	10'098	-	708	178'631
Ausserbilanz³										
Eventualverpflichtungen	61	-	12	24	40	51	231	-	-	419
Unwiderrufliche Zusagen	39	-	551	808	168	203	740	-	-	2'509
Einzahlungs- und Nachschussverpflichtungen	-	-	-	-	-	-	119	-	-	119
Add-ons-Terminkontrakte und gekaufte Optionen ²	113	23	155	-	245	0	21	-	-	557
Total Berichtsperiode	213	23	718	832	453	254	1'111	-	-	3'604
Total Vorjahr	136	19	707	788	521	231	917	-	-	3'319

¹ Forderungen und Verpflichtungen gegenüber der Pfandbriefbank werden miteinander verrechnet.

² Das Gegenparteirisiko der Derivate ist nach der Marktwertmethode gerechnet. Nettingvereinbarungen mit Gegenparteien werden bei der Eigenmittelberechnung berücksichtigt.

³ Die nicht derivativen Ausserbilanzengagements sind nach Umrechnung in Kreditäquivalente ausgewiesen.

RAIFFEISEN

Zinsrisiken im Bankenbuch (Mehrjahresvergleich)

in Mio. CHF	30.6.2016	31.12.2015	31.12.2014	31.12.2013	31.12.2012
Sensitivität (+100bp-Shift)	1'610	1'673	1'351	1'538	1'070
Value at Risk (99,9%)	1'479	1'703	1'376	1'541	1'075

RAIFFEISEN

Auf Basis externer Ratings bestimmte risikogewichtete Positionen per 30. Juni 2016

Kreditengagements (in 1000 CHF) ¹	Rating	Risikogewichtete Positionen				
		0%	20%	50%	100%	150%
<hr/>						
Gegenpartei						
Zentralregierungen und Zentralbanken	Mit Rating	819'694	22	-	4	-
	Ohne Rating	-	-	-	-	-
Öffentlichrechtliche Körperschaften ²						
	Mit Rating	127'192	877'436	34'373	-	-
	Ohne Rating	-	613'497	2'443'492	368'712	13'587
Banken und Effektenhändler						
	Mit Rating	2'970'938	2'033'082	488'464	922	-
	Ohne Rating	661'039	1'023'501	438'027	12'316	-
Unternehmen						
	Mit Rating	36'000	4'621'726	82'687	78'328	161
	Ohne Rating	30'934	-	-	3'466'974	14'640
Total						
	Mit Rating	3'953'824	7'532'266	605'524	79'254	161
	Ohne Rating	691'973	1'636'998	2'881'519	3'848'002	28'227
Gesamttotal						
		4'645'797	9'169'264	3'487'043	3'927'256	28'388

¹ Vor risikomindernden Massnahmen und vor Abzug von Einzelwertberichtigungen.

² Inklusive Kreditengagements gegenüber Gemeinschaftseinrichtungen, BIZ, IWF und multilateralen Entwicklungsbanken.

Gegenstand	30.06.2016 in 1000 CHF	31.12.2015 in 1000 CHF
a) Vergleich zwischen den bilanzierten Aktiven und dem Gesamtengagement für die Leverage Ratio		
1 Summe der Aktiven gemäss der veröffentlichten Rechnungslegung	213'539'324	205'748'171
2 Anpassungen in Bezug auf Investitionen in Bank-, Finanz-, Versicherungs- und Kommerzesellschaften, die rechnungslegungsmässig aber nicht regulatorisch konsolidiert sind, sowie Anpassungen in Bezug auf Vermögenswerte, die vom Kernkapital abgezogen werden ¹	-489'604	-512'881
3 Anpassungen in Bezug auf Treuhandaktiven, die rechnungslegungsmässig bilanziert werden, aber für die Leverage Ratio nicht berücksichtigt werden müssen	-	-
4 Anpassungen in Bezug auf Derivate ²	-2'006'983	-1'568'627
5 Anpassungen in Bezug auf Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT, securities financing transactions) ³	-251'586	-281'992
6 Anpassungen in Bezug auf Ausserbilanzgeschäfte (Umrechnung der Ausserbilanzgeschäfte in Kreditäquivalente)	3'834'125	3'552'377
7 Andere Anpassungen ⁴	-	-
8 Gesamtengagement für die Leverage Ratio	214'625'276	206'937'048
b) Detaillierte Darstellung der Leverage Ratio		
Bilanzpositionen		
1 Bilanzpositionen (ohne Derivate und SFT aber inkl. Sicherheiten) ⁵	210'972'629	203'561'259
2 Aktiven, die in Abzug des anrechenbaren Kernkapitals gebracht werden müssen ¹	-489'604	-512'881
3 = Summe der Bilanzpositionen im Rahmen der Leverage Ratio ohne Derivate und SFT	210'483'025	203'048'378
Derivate		
4 Positive Wiederbeschaffungswerte in Bezug auf alle Derivattransaktionen inklusive solche gegenüber CCPs unter Berücksichtigung der erhaltenen Margenzahlungen und der Netting-Vereinbarungen	292'533	212'906
5 Sicherheitszuschläge (Add-ons) für alle Derivate	557'461	521'937
6 Wiedereingliederung der im Zusammenhang mit Derivaten gestellten Sicherheiten, sofern ihre buchhalterische Behandlung zu einer Reduktion der Aktiven führt	-	-
7 Abzug von durch gestellte Margenzahlungen entstandenen Forderungen	-845'367	-591'700
8 Abzug in Bezug auf das Engagement gegenüber qualifizierten zentralen Gegenparteien (QCCP), wenn keine Verantwortung gegenüber der Kunden im Falle des Ausfalles des QCCP vorliegt	-	-
9 Effektive Nominalwerte der ausgestellten Kreditderivate, nach Abzug der negativen Wiederbeschaffungswerte	321'433	199'348
10 Verrechnung mit effektiven Nominalwerten von gegenläufigen Kreditderivaten und Abzug der Add-ons bei ausgestellten Kreditderivaten	-135'230	-115'823
11 = Total Engagements aus Derivaten ²	190'830	226'668
Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (SFT)		
12 Bruttoaktiven im Zusammenhang mit Wertpapierfinanzierungsgeschäften ohne Verrechnung (ausser bei Novation mit einer QCCP) einschliesslich jener, die als Verkauf verbucht wurden, abzüglich der in FINMA-RS 15/3 Rz 58 genannten Positionen	368'882	391'404
13 Verrechnung von Barverbindlichkeiten und -forderungen in Bezug auf SFT Gegenparteien	-251'586	-281'779
14 Engagements gegenüber SFT Gegenparteien ³	-	-
15 Engagements für SFT mit der Bank als Kommissionär	-	-
16 = Total Engagements aus Wertpapierfinanzierungsgeschäften	117'296	109'625
Übrige Ausserbilanzpositionen		
17 Ausserbilanzgeschäfte als Bruttonominalwerte vor der Anwendung von Kreditumrechnungsfaktoren	16'673'810	16'353'186
18 Anpassungen in Bezug auf die Umrechnung in Kreditäquivalente	-12'839'685	-12'800'810
19 = Total der Ausserbilanzpositionen	3'834'125	3'552'376
Anrechenbare Eigenmittel und Gesamtengagement		
20 Kernkapital (Tier 1)	14'439'202	13'921'084
21 Gesamtengagement	214'625'276	206'937'047
Leverage Ratio		
22 Leverage Ratio (gemäss Definition FINMA-Rundschreiben 2015/3 «Leverage Ratio» ⁶)	6.73%	6.73%

¹ In dieser Position sind die Immateriellen Werte (Goodwill) berücksichtigt, welche vom Kernkapital in Abzug gebracht werden

² In dieser Position ist das Gegenpartei-Netting von OTC-Derivaten aufgrund der bestehenden Nettingverträge mit berücksichtigt

³ In dieser Position ist das Netting aus Reverse Repo Geschäften berücksichtigt, welche über die SIX SIS AG abgewickelt werden

⁴ In dieser Position sind die Einzelwertberichtigungen für Ausfallrisiken berücksichtigt, welche mit den Aktivpositionen zu verrechnen sind

⁵ 30.06.2016: Der Unterschied des ausgewiesenen Wertes zur Bilanzsumme gemäss veröffentlichter Rechnungslegung beträgt 2'567 Millionen Franken und betrifft die Brutto-Wiederbeschaffungswerte aus Derivaten (2'198 Millionen Franken), Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (369 Millionen Franken).

⁶ Die Leverage Ratio auf Basis der Berechnungen gemäss FINMA-Rundschreiben 2015/3 «Leverage Ratio» kann, infolge möglicher Unterschiede bei der Anrechenbarkeit des Kernkapitals (Tier 1), von derjenigen unter dem Regime der Systemrelevanz abweichen

Erläuterungen zur Leverage Ratio per 30.06.2016

Das starke Bilanzwachstum (+7.7 Mrd. Franken oder +3.7%) führte zu einem markanten Anstieg des Gesamtengagements (Zeile 21). Die Leverage Ratio blieb unverändert auf einem Stand von 6.73%. Das anrechenbare Kernkapital (Zeile 20) stieg in der Berichtsperiode relativ gesehen gleich stark wie das Gesamtengagement. Das Kernkapital erhöhte sich aufgrund der Zeichnung zusätzlicher Anteilscheine durch die Mitglieder sowie die Anrechnung des Gruppengewinns um 0.5 Mrd. Franken oder 3.7%.