

Annex 6

Übersicht – Erfüllung der CRR-Anforderungen

Die Erfüllung der CRR-Anforderungen im Commerzbank-Konzern zum 31. Dezember 2021 wird im Detail in der nachfolgenden Übersicht dargestellt.

Übersicht – Erfüllung der CRR-Anforderungen

Artikel CRR	Thema	Referenz zur Offenlegung (Kapitel Offenlegungsbericht oder Referenz auf separates Dokument)	Tabellen
431 - 434	Anwendungsbereich der Offenlegungspflichten Nicht wesentliche Informationen, Geschäftsgeheimnisse oder vertrauliche Informationen Häufigkeit und Mittel der Offenlegung	Einführung > Ziel des Offenlegungsberichtes Einführung > Anwendungsbereich Einführung > Waiver-Regelung gemäß Artikel 7 CRR	–
435(1) a) - d)	Risikomanagementziele und -politik	Risikoorientierte Gesamtbanksteuerung > Organisation des Risikomanagements > Risikostrategie und Risikosteuerung > Risikotragfähigkeit und Stresstesting	–
		Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Risikomanagement > B. Gegenparteiausfallrisiken > Risikomanagement > D. Marktrisiken > Risikomanagement > E. Liquiditätsrisiken > F. Operationelle Risiken > Risikomanagement	–
435(1) e), f)	Risikomanagementziele und -politik	Risikoorientierte Gesamtbanksteuerung > Risikoerklärung Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Verbindung zwischen bilanziellen und regulatorischen Positionen	–
435(2) a) - d)	Unternehmensführungs-Regelungen	Risikoorientierte Gesamtbanksteuerung > Organisation des Risikomanagements > Informationen zur Unternehmensführung gemäß Artikel 435 (2) CRR	Annex 3
		Geschäftsbericht 2021: > Erklärung zur Unternehmensführung Homepage: https://www.commerzbank.de/de/hauptnavigation/aktionaere/governance/corporate_governance_1.html	
435(2) e)	Unternehmensführungs-Regelungen	Risikoorientierte Gesamtbanksteuerung > Organisation des Risikomanagements > Risikostrategie und Risikosteuerung	–
436 a)	Anwendungsbereich	Einführung > Anwendungsbereich	–
436 b) - d)	Anwendungsbereich	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Verbindung zwischen bilanziellen und regulatorischen Positionen	EU LI1 EU LI2
		Annex 1	EU LI3
436 e)	Anwendungsbereich	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA -> Verbindung zwischen bilanziellen und regulatorischen Positionen	EU PV1
436 f), g)	Anwendungsbereich	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Verbindung zwischen bilanziellen und regulatorischen Positionen	–
436 h)	Anwendungsbereich	Einführung > Waiver-Regelung gemäß Artikel 7 CRR	–
437 a), d) - f)	Eigenmittel	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Eigenmittelstruktur > Verbindung zwischen bilanziellen und regulatorischen Positionen	EU CC1 EU CC2
437 b), c)	Eigenmittel	Annex 5: Hauptmerkmale begebener Kapitalinstrumente per 31. Dezember 2021	Annex 5
		zusätzlich auf der Homepage: https://www.commerzbank.de/de/hauptnavigation/aktionaere/informationen_f_r_fremdkapitalgeber/kapitalinstrumente/CapitalInstruments.html	
438 a) - c)	Eigenmittelanforderungen und risikogewichteten Positionsbeträge	Risikoorientierte Gesamtbanksteuerung > Risikotragfähigkeit und Stresstesting	RBC1
		Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Schlüsselparameter	EU KM1
438 d)	Eigenmittelanforderungen und risikogewichteten Positionsbeträge	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Eigenmittelanforderungen und RWA	EU OV1
438 e)	Eigenmittelanforderungen und risikogewichteten Positionsbeträge	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im IRBA	EU CR10.2

Artikel CRR	Thema	Referenz zur Offenlegung (Kapitel Offenlegungsbericht oder Referenz auf separates Dokument)	Tabellen
438 h)	Eigenmittelanforderungen und risikogewichteten Positionsbeträge	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im IRBA	EU CR8
		Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteausfallrisiken > Informationen nach aufsichtsrechtlichem Risikogewichtungsansatz	EU CCR7
		Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Quantitative Angaben zu Marktrisiken	EU MR2-B
439 a) - d)	Gegenparteausfallrisiko	Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteausfallrisiken > Risikomanagement	–
439 f), g), h), k), m)	Gegenparteausfallrisiko	Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteausfallrisiken > Informationen zu regulatorischen Methoden	EU CCR1 EU CCR2 EU CCR3
		Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteausfallrisiken > Informationen zum aufsichtsrechtlichen Risikogewichtungsansatz	EU CCR4 EU CCR5 EU CCR6 EU CCR7
		Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteausfallrisiken > Weitere Informationen zum Gegenparteausfallrisiko	EU CCR8 addCCR1
440	antizyklische Kapitalpuffer	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Eigenmittelanforderungen und RWA	EU CCyB1 EU CCyB2
441	Indikatoren der globalen Systemrelevanz	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Eigenmittelanforderungen und RWA	Annex 2
442 a) - b)	Kredit- und Verwässerungsrisiko	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Risikovorvorsorge für Adressenausfallrisiken	–
442 c), e), f)	Kredit- und Verwässerungsrisiko	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Risikovorvorsorge für Adressenausfallrisiken	EU CR1 EU CR2 EU CQ1 EU CQ4 EU CQ5 EU CQ7
		Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Risikovorvorsorge für Adressenausfallrisiken	EU CQ3
		Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Risikovorvorsorge für Adressenausfallrisiken	EU CR1-A
		Spezifisches Risikomanagement > E. Liquiditätsrisiken > Angaben zur Belastung von Vermögenswerten	EU AE1 EU AE2 EU AE3
		Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im KSA	EU CR4 EU CR5
443	Unbelastete Vermögenswerte	Spezifisches Risikomanagement > E. Liquiditätsrisiken > Angaben zur Belastung von Vermögenswerten	EU AE1 EU AE2 EU AE3
444 a) - e)	Verwendung des Standardansatzes	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im KSA	EU CR4 EU CR5
444 e)	Verwendung des Standardansatzes	Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteausfallrisiken > Informationen zu regulatorischen Methoden	EU CCR3
445	Marktrisiko	Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Quantitative Angaben zu Marktrisiken	EU MR1
446 a) - c)	Operationelles Risiko	Spezifisches Risikomanagement > F. Operationelle Risiken	EU OR1
447 a) - g)	Schlüsselparameter	Eigenmittel, Eigenmittelanforderungen und RWA > Schlüsselparameter	EU KM1
448	Zinsrisiko aus nicht im Handelsbuch enthaltenen Positionen	Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Zinsänderungsrisiko im Anlagebuch	EU IRBB1
449	Risiko aus Verbriefungspositionen	Spezifisches Risikomanagement > C. Verbriefungen	SEC1 SEC2 SEC3 SEC4 SEC5
		Spezifisches Risikomanagement > G. Sonstige Risiken > Environmental-Social-Governance-(ESG-)Risiken	–
		Spezifisches Risikomanagement > G. Sonstige Risiken > Environmental-Social-Governance-(ESG-)Risiken	–
		Spezifisches Risikomanagement > G. Sonstige Risiken > Environmental-Social-Governance-(ESG-)Risiken	–
		Spezifisches Risikomanagement > G. Sonstige Risiken > Environmental-Social-Governance-(ESG-)Risiken	–

Artikel CRR	Thema	Referenz zur Offenlegung (Kapitel Offenlegungsbericht oder Referenz auf separates Dokument)	Tabellen
450	Vergütungspolitik	Risikoorientierte Gesamtbanksteuerung > Informationen zur Vergütung gemäß Artikel 450 CRR Homepage: https://www.commerzbank.de/de/hauptnavigation/aktionaere/publikationen_und_veranstaltungen/unternehmensberichterstattung_1/index.html	Annex 4
451	Verschuldungsquote	Leverage Ratio	EU LR1 EU LR2 EU LR3
451a (2) a) - c)	Liquiditätsanforderungen	Spezifisches Risikomanagement > E. Liquiditätsrisiken > Liquidity Coverage Ratio	EU LIQ1 addLIQ3
451a (3)	Liquiditätsanforderungen	Spezifisches Risikomanagement > E. Liquiditätsrisiken > Liquidity Coverage Ratio	EU LIQ2
451a (4)	Liquiditätsanforderungen	Spezifisches Risikomanagement > E. Liquiditätsrisiken > Risikomanagement > Liquiditätsrisikomodell	addLIQ1 addLIQ2
452 a) - e)	Anwendung des IRB-Ansatzes auf Kreditrisiken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Risikomanagement > Kreditrisikomodell	EU CR6-A
452 f)	Anwendung des IRB-Ansatzes auf Kreditrisiken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisikomodell	EU CR6-A VAL-A VAL-B VAL1 VAL2
452 g)	Anwendung des IRB-Ansatzes auf Kreditrisiken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im IRBA	EU CR6
		Spezifisches Risikomanagement > B. Gegenparteiausfallrisiken > Informationen nach aufsichtsrechtlichem Risikogewichtungsansatz	EU CCR4
452 h)	Anwendung des IRB-Ansatzes auf Kreditrisiken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisikomodell	EU CR9 EU CR9.1
453 a) - e)	Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisikominderung > B. Gegenparteiausfallrisiken > Risikomanagement	-
453 f)	Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisikominderung	EU CR3
453 g) - j)	Verwendung von Kreditrisikominderungstechniken	Spezifisches Risikomanagement > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im KSA > A. Kreditrisiken > Kreditrisiko und Kreditrisikominderung im IRBA	EU CR4 EU CR7 EU CR7-A
454	Verwendung fortgeschrittener Messansätze für operationelle Risiken	Spezifisches Risikomanagement > F. Operationelle Risiken	EU OR1
455 a), b)	Verwendung interner Modelle für das Marktrisiko	Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Risikomanagement > D. Marktrisiken > Marktrisikomodell	-
455 c)	Verwendung interner Modelle für das Marktrisiko	Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Risikomanagement > Handelbarkeit und Bewertung von Finanzinstrumenten	-
455 d) - f)	Verwendung interner Modelle für das Marktrisiko	Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Quantitative Angaben zu Marktrisiken	EU MR2-A EU MR3 addMR1
455 g)	Verwendung interner Modelle für das Marktrisiko	Spezifisches Risikomanagement > D. Marktrisiken > Marktrisikomodell	EU MR4