

**freiwillige offenlegung von
regulatorischen kennzahlen
der eigenmittel und liquidität
valiant holding ag
30. juni 2020**

Valiant Holding AG

Ergänzend zu den regulatorischen Offenlegungspflichten gemäss dem FINMA-Rundschreiben 2016/1 'Offenlegung - Banken' legt die Valiant noch nachfolgende zusätzliche freiwillige regulatorische Kennzahlen quartalsweise offen. Dies umfasst Kennzahlen zu den Eigenmitteln und der Liquidität der Valiant Holding AG, Valiant Bank AG (Einzelinstitut) sowie Valiant Bank AG (subkonsolidiert nach Beteiligungsquote an der Entris Banking AG). Die Berechnung der Kennzahlen erfolgt in Übereinstimmung mit den geltenden Eigenmittel- und Liquiditätsvorschriften.

	a	b	c
Anrechenbare Eigenmittel (in CHF 1 000)	30.06.2020	31.03.2020	31.12.2019
1 Hartes Kernkapital (CET1)	2 230 815	2 216 934	2 217 836
2 Kernkapital (Tier1)	2 230 815	2 216 934	2 217 836
3 Gesamtkapital total	2 230 815	2 216 934	2 217 836
Risikogewichtete Positionen (RWA) (in CHF 1 000)			
4 RWA	13 888 008	13 631 329	13 475 177
4a Mindesteigenmittel (in CHF 1 000)	1 111 041	1 090 506	1 078 014
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)			
5 CET1-Quote (in %)	16,06	16,26	16,46
6 Kernkapitalquote (in %)	16,06	16,26	16,46
7 Gesamtkapitalquote (in %)	16,06	16,26	16,46
CET1-Pufferanforderungen (in % der RWA)			
8 Eigenmittelpuffer nach Basler Mindeststandards (2,5% ab 2019) (in %)	2,50	2,50	2,50
9 Antizyklischer Puffer (Art. 44a ERV) nach Basler Mindeststandards (in %)	0,00	0,00	0,00
11 Gesamte Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards in CET1-Qualität (in %)	2,50	2,50	2,50
12 Verfügbares CET1 zur Deckung der Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards (nach Abzug von CET1 zur Deckung der Mindestanforderungen und ggf. zur Deckung von TLAC-Anforderungen) (in %)	8,06	8,26	8,46
Kapitalzielquoten nach Anhang 8 ERV (in % der RWA)			
12a Eigenmittelpuffer gemäss Anhang 8 ERV (in %)	4,00	4,00	4,00
12b Antizyklische Puffer (Art. 44 und 44a ERV) (in %)	0,00	0,00	1,13
12c CET1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	7,80	7,80	8,93
12d Tier1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	9,60	9,60	10,73
12e Gesamtkapital-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	12,00	12,00	13,13
Basel III Leverage Ratio			
13 Gesamtengagement (in CHF 1 000)	31 949 718	30 665 063	31 876 364
14 Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	6,98	7,23	6,96

	a	b	c	d	e
Liquiditätsquote (LCR)¹	30.06.2020	31.03.2020	31.12.2019	30.09.2019	30.06.2019
15 Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (in CHF)	5 468 448	4 881 634	4 051 749	3 238 044	3 044 605
16 Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (in CHF)	3 706 251	3 132 489	2 835 211	2 508 749	2 655 888
17 Liquiditätsquote, LCR (in %)	148	156	143	129	115

¹ Valiant Bank AG / Einzelabschluss

Valiant Bank AG (Einzelinstitut)

	a	b	c
Anrechenbare Eigenmittel (in CHF 1 000)	30.06.2020	31.03.2020	31.12.2019
1 Hartes Kernkapital (CET1)	2 121 864	2 123 396	2 123 260
2 Kernkapital (Tier1)	2 121 864	2 123 396	2 123 260
3 Gesamtkapital total	2 121 864	2 123 396	2 123 260
Risikogewichtete Positionen (RWA) (in CHF 1 000)			
4 RWA	13 643 497	13 347 033	13 178 400
4a Mindesteigenmittel (in CHF 1 000)	1 091 480	1 067 763	1 054 272
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)			
5 CET1-Quote (in %)	15,55	15,91	16,11
6 Kernkapitalquote (in %)	15,55	15,91	16,11
7 Gesamtkapitalquote (in %)	15,55	15,91	16,11
CET1-Pufferanforderungen (in % der RWA)			
8 Eigenmittelpuffer nach Basler Mindeststandards (2,5% ab 2019) (in %)	2,50	2,50	2,50
9 Antizyklischer Puffer (Art. 44a ERV) nach Basler Mindeststandards (in %)	0,00	0,00	0,00
11 Gesamte Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards in CET1-Qualität (in %)	2,50	2,50	2,50
12 Verfügbares CET1 zur Deckung der Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards (nach Abzug von CET1 zur Deckung der Mindestanforderungen und ggf. zur Deckung von TLAC-Anforderungen) (in %)	7,55	7,91	8,11
Kapitalzielquoten nach Anhang 8 ERV (in % der RWA)			
12a Eigenmittelpuffer gemäss Anhang 8 ERV (in %)	4,00	4,00	4,00
12b Antizyklische Puffer (Art. 44 und 44a ERV) (in %)	0,00	0,00	1,16
12c CET1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	7,80	7,80	8,96
12d Tier1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	9,60	9,60	10,76
12e Gesamtkapital-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	12,00	12,00	13,16
Basel III Leverage Ratio			
13 Gesamtengagement (in CHF 1 000)	28 352 089	27 255 016	30 406 707
14 Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	7,48	7,79	6,98

	a	b	c	d	e
Liquiditätsquote (LCR)	30.06.2020	31.03.2020	31.12.2019	30.09.2019	30.06.2019
15 Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (in CHF)	5 468 448	4 881 634	4 051 749	3 238 044	3 044 605
16 Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (in CHF)	3 706 251	3 132 489	2 835 211	2 508 749	2 655 888
17 Liquiditätsquote, LCR (in %)	148	156	143	129	115

Valiant Bank AG (subkonsolidiert)

	a	b	c
Anrechenbare Eigenmittel (in CHF 1 000)	30.06.2020	31.03.2020	31.12.2019
1 Hartes Kernkapital (CET1)	2 258 485	2 260 017	2 257 417
2 Kernkapital (Tier1)	2 258 485	2 260 017	2 257 417
3 Gesamtkapital total	2 258 485	2 260 017	2 257 417
Risikogewichtete Positionen (RWA) (in CHF 1 000)			
4 RWA	13 928 686	13 597 651	13 443 454
4a Mindesteigenmittel (in CHF 1 000)	1 114 295	1 087 812	1 075 476
Risikobasierte Kapitalquoten (in % der RWA)			
5 CET1-Quote (in %)	16,21	16,62	16,79
6 Kernkapitalquote (in %)	16,21	16,62	16,79
7 Gesamtkapitalquote (in %)	16,21	16,62	16,79
CET1-Pufferanforderungen (in % der RWA)			
8 Eigenmittelpuffer nach Basler Mindeststandards (2,5% ab 2019) (in %)	2,50	2,50	2,50
9 Antizyklischer Puffer (Art. 44a ERV) nach Basler Mindeststandards (in %)	0,00	0,00	0,00
11 Gesamte Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards in CET1-Qualität (in %)	2,50	2,50	2,50
12 Verfügbares CET1 zur Deckung der Pufferanforderungen nach Basler Mindeststandards (nach Abzug von CET1 zur Deckung der Mindestanforderungen und ggf. zur Deckung von TLAC-Anforderungen) (in %)	8,21	8,62	8,79
Kapitalzielquoten nach Anhang 8 ERV (in % der RWA)			
12a Eigenmittelpuffer gemäss Anhang 8 ERV (in %)	4,00	4,00	4,00
12b Antizyklische Puffer (Art. 44 und 44a ERV) (in %)	0,00	0,00	1,14
12c CET1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	7,80	7,80	8,94
12d Tier1-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	9,60	9,60	10,74
12e Gesamtkapital-Zielquote (in %) gemäss Anhang 8 ERV zzgl. antizyklischer Puffer nach Art. 44 und 44a ERV	12,00	12,00	13,14
Basel III Leverage Ratio			
13 Gesamtengagement (in CHF 1 000)	29 368 512	28 017 888	31 865 561
14 Basel III Leverage Ratio (Kernkapital in % des Gesamtengagements)	7,69	8,07	7,08

	a	b	c	d	e
Liquiditätsquote (LCR)¹	30.06.2020	31.03.2020	31.12.2019	30.09.2019	30.06.2019
15 Zähler der LCR: Total der qualitativ hochwertigen, liquiden Aktiven (in CHF)	5 468 448	4 881 634	4 051 749	3 238 044	3 044 605
16 Nenner der LCR: Total des Nettomittelabflusses (in CHF)	3 706 251	3 132 489	2 835 211	2 508 749	2 655 888
17 Liquiditätsquote, LCR (in %)	148	156	143	129	115

¹ Valiant Bank AG / Einzelabschluss