

Citigroup Global Markets Europe AG

Pillar 3 - Offenlegungsbericht

30 Juni 2022



Inhaltsverzeichnis

Tabellenverzeichnis	2
Einführung	3
Schlüsselparameter	5

Tabellenverzeichnis

Tabelle 1: Nicht relevante Offenlegungstabellen

4

Tabelle 2: Schlüsselparameter (KM1)

5

Einführung

Die Citigroup Global Markets Europe AG (folgend „CGME“) ist eine der führenden ausländischen Investmentbanken in Deutschland und ist ein CRR- Kreditinstitut gemäß Artikel 4 CRR. Gegenstand des Unternehmens ist das Betreiben von Bank- und Finanzgeschäften aller Art mit Ausnahme des Investmentgeschäfts i.S.d. § 1 Abs. 1 des Gesetzes über Kapitalanlagegesellschaften sowie des Einlagengeschäftes nach §1 Abs. 1 Nr. 1 KWG.

Die Geschäftsschwerpunkte der CGME sind:

- Beratung bei Fusionen und Akquisitionen
- Zahlungsverkehrs- und Wertpapierabwicklung
- Begleitung von Fremd- und Eigenkapitalemissionen in der Rolle des Konsortialführers
- Emission von Optionsscheinen, Zertifikaten und strukturierten Produkten
- Vertrieb von Anleihen, Zins- und Kreditderivaten

Die CGME unterhält eine Niederlassung in London, die für die Durchführung des Eigenhandelsgeschäfts mit Optionsscheinen und Zertifikaten verantwortlich ist. Darüber hinaus unterhält die CGME Zweigniederlassungen in London, Madrid, Paris und Mailand, über die im Wesentlichen der Vertrieb der oben genannten Produkte betrieben wird.

Anwendungsbereich

Die CGME ist ein großes, nicht kapitalmarktorientiertes Institut und ist gemäß Teil VIII der Verordnung (EU) 575/2013 (im folgenden CRR genannt) in Verbindung mit Verordnung (EU) 2019/876 und in Verbindung mit §26a Kreditwesengesetz (KWG) verpflichtet, im halbjährlichen Turnus bestimmte aufsichtsrechtliche Informationen zu offenzulegen. Das Unternehmen ist nicht mehr Bestandteil eines aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreises und erstellt keinen Konzernabschluss nach den Vorschriften des Handelsgesetzbuches.

Eine Kapitalunterdeckung im Sinne von Art. 436 Buchstabe d) CRR liegt nicht vor.

Der vorliegende Offenlegungsbericht setzt die entsprechenden Offenlegungsanforderungen um und ermöglicht einen umfassenden Überblick über das Risikoprofil und das Risikomanagement der CGME.

Die dargestellten Berichtsinhalte unterliegen gemäß Artikel 432 CRR und im Einklang mit den EBA Leitlinien zur Wesentlichkeit und Vertraulichkeit der Offenlegung (EBA/GL/2014/14) dem Wesentlichkeitsgrundsatz. Rechtlich geschützte oder vertrauliche Informationen sind nicht Gegenstand dieses Berichts.

Die Verordnung wird durch die Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 ergänzt. Auf Basis dieses Standards, wurden die im Bericht enthaltenen Tabellen erstellt.

Um eine angemessene Offenlegungspraxis zu gewährleisten, werden regelmäßige Überprüfungen der Berichtsinhalte stattfinden.

Die offengelegten Informationen wurden auf Basis der HGB Rechnungslegung sowie den Mindesteigenkapitalanforderungen gemäß CRR erstellt.

Der Offenlegungsbericht wird gemäß Artikel 434 CRR im Bundesanzeiger (<http://www.bundesanzeiger.de/>) sowie auf der Website der CGME (<http://www.citifirst.com>) veröffentlicht. Damit kommt die CGME der Anforderung nach, das Medium mit dem größtmöglichen Publizitätswirkung für die Veröffentlichung zu verwenden.

Meldeformat

Durch Artikel 434aCRR entstand die Verpflichtung für die Europäische Bankenaufsichtsbehörde (EBA) technische Durchführungsstandards (ITS) zu entwickeln, um einen einheitliche Offenlegungsstandard zu gewährleisten.

Am 15. März 2021 hat die Europäische Kommission die Durchführungsverordnung (EU) 2021/637 zur Festlegung technischer Durchführungsstandards für die Offenlegung der in Teil 8 Titel II und III der CRR veröffentlicht.

Der ITS unterscheidet in qualitativen und quantitativen Vorgaben. Die Vorgaben bestimmen die Inhalte und das Format der Offenlegung. Die quantitativen Angaben wurden durch das „EBA Mapping Tool“ (Version vom 06.08.2021) erstellt, welches die quantitativen Offenlegungstabellen auf Basis der Corep und Finrep Bögen befüllt.

Für die qualitativen Offenlegungsanforderungen wird Fließtext verwendet, dies ist im Einklang mit der freien Formatwahl des ITS.

Bei den offengelegten Werten in den Tabellen handelt es sich um Angaben in € Millionen. In Folge können Rundungsdifferenzen in den Tabellen auftreten.

Nicht relevante Meldebögen

Die CGME erfüllt alle Offenlegungsanforderungen nach der CRR, jedoch sind nicht alle zur Offenlegung verlangten Informationen relevant. Eine Übersicht dazu gibt die Tabelle auf der nachfolgenden Seite.

Tabelle 1: Nicht relevante Offenlegungstabellen

MELDEBOGEN	RELEVANZ FÜR CGME	ERLÄUTERUNG
EU CCR4	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CQ1	nicht relevant	Forborne und ausgefallene Positionen kommen bei CGME aufgrund des Geschäftsmodells nicht vor
EU CQ2	nicht relevant	Forborne und ausgefallene Positionen kommen bei CGME aufgrund des Geschäftsmodells nicht vor
EU CQ6	nicht relevant	Forborne und ausgefallene Positionen kommen bei CGME aufgrund des Geschäftsmodells nicht vor
EU CQ7	nicht relevant	Es kommt zu keiner Annahme und Besitznahme von Sicherheiten
EU CQ8	nicht relevant	Es kommt zu keiner Annahme und Besitznahme von Sicherheiten
EU CR10	nicht relevant	Die CGME betreibt kein Specialised Lending
EU CR2	nicht relevant	Forborne und ausgefallene Positionen kommen bei CGME aufgrund des Geschäftsmodells nicht vor
EU CR2A	nicht relevant	Forborne und ausgefallene Positionen kommen bei CGME aufgrund des Geschäftsmodells nicht vor
EU CR6	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CR6-A	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CR7	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CR7-A	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CR8	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CR9	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CR9.1	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU CRE	nicht relevant	Die CGME verwendet keinen IRB Ansatz
EU INS1	nicht relevant	Die CGME hat keine Beteiligungen in Versicherungen, Rückversicherungen oder anderen Versicherungsbeteiligungsgesellschaften.
EU INS2	nicht relevant	Die CGME hat keine Beteiligungen an Finanzkonglomeraten.
EU SEC1	nicht relevant	Die CGME betreibt keinerlei Geschäft mit Verbriefungen.
EU SEC2	nicht relevant	Die CGME betreibt keinerlei Geschäft mit Verbriefungen.
EU SEC3	nicht relevant	Die CGME betreibt keinerlei Geschäft mit Verbriefungen.
EU SEC4	nicht relevant	Die CGME betreibt keinerlei Geschäft mit Verbriefungen.
EU SEC5	nicht relevant	Die CGME betreibt keinerlei Geschäft mit Verbriefungen.
EU SECA	nicht relevant	Die CGME betreibt keinerlei Geschäft mit Verbriefungen.
EU LIB	nicht relevant	Die CGME hat keine Tochterunternehmen und führt deshalb keine Konsolidierung durch
EU LI3	nicht relevant	Die CGME hat keine Tochterunternehmen und führt deshalb keine Konsolidierung durch

Schlüsselparameter

Die Tabelle KM1 stellt die geforderten Informationen aus Art. 447 (a) – (g) CRR sowie Artikel 438 (b) CRR dar. Die Tabelle bietet eine Zusammenfassung der aufsichtsrechtlichen Kennzahlen der Eigenmittel, der Verschuldungsquote, der LCR und NSFR.

Da die Kennzahlen LCR sowie NSFR zum ersten Mal mit Stichtag 30.09.2021 ermittelt und gemeldet wurden, liegen in Folge keine historischen Werte für diese Kennzahlen vor. Die betroffenen Zeilen werden leer gemeldet.

Tabelle 2: Schlüsselparameter (KM1)

Zum Stichtag 30.06.2022 liegen keine zusätzlichen Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung vor (Zeile EU 14a-c).

Aufgrund der kontinuierlichen Geschäftsausweitung kommt es ebenso zu einem Anstieg der RWA über die letzten vier Quartale hinweg.

		30.06.2022	31.12.2021	30.06.2021
	Verfügbare Eigenmittel (Beträge)			
1	Hartes Kernkapital (CET1)	3,138	3,142	3,139
2	Kernkapital (T1)	3,138	3,142	3,139
3	Gesamtkapital	3,138	3,142	3,139
	Risikogewichtete Positionsbeträge			
4	Gesamtrisikobetrag	16,427	16,168	15,022
	Kapitalquoten (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)			
5	Harte Kernkapitalquote (CET1-Quote) (%)	19.10%	19.43%	20.90%
6	Kernkapitalquote (%)	19.10%	19.43%	20.90%
7	Gesamtkapitalquote (%)	19.10%	19.43%	20.90%
	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für andere Risiken als das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)			
EU 7a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für andere Risiken als das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	4.00%	4.00%	4.00%
EU 7b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	2.25%	4.00%	4.00%
EU 7c	Davon: in Form von T1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	3.00%	4.00%	4.00%
EU 7d	SREP-Gesamtkapitalanforderung (%)	12.00%	12.00%	12.00%
	Kombinierte Kapitalpuffer- und Gesamtkapitalanforderung (in % des risikogewichteten Positionsbetrags)			
8	Kapitalerhaltungspuffer (%)	2.50%	2.50%	2.50%
EU 8a	Kapitalerhaltungspuffer aufgrund von Makroaufsichtsrisiken oder Systemrisiken auf Ebene eines Mitgliedstaats (%)	0.00%	0.00%	0.00%
9	Institutsspezifischer antizyklischer Kapitalpuffer (%)	0.05%	0.02%	0.03%
EU 9a	Systemrisikopuffer (%)	0.00%	0.00%	0.00%
10	Puffer für global systemrelevante Institute (%)	0.00%	0.00%	0.00%
EU 10a	Puffer für sonstige systemrelevante Institute (%)	0.00%	0.00%	0.00%
11	Kombinierte Kapitalpufferanforderung (%)	2.55%	2.52%	2.53%
EU 11a	Gesamtkapitalanforderungen (%)	14.55%	14.52%	14.53%
12	Nach Erfüllung der SREP-Gesamtkapitalanforderung verfügbares CET1 (%)	12.35%	10.93%	9.86%
	Verschuldungsquote			
13	Gesamtrisikopositionsmessgröße	58,795	44,867	58,843
14	Verschuldungsquote (%)	5.34%	7.00%	5.33%
	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)			
EU 14a	Zusätzliche Eigenmittelanforderungen für das Risiko einer übermäßigen Verschuldung (%)	-	-	-
EU 14b	Davon: in Form von CET1 vorzuhalten (Prozentpunkte)	-	-	-
EU 14c	SREP-Gesamtverschuldungsquote (%)	-	-	-
	Anforderung für den Puffer bei der Verschuldungsquote und die Gesamtverschuldungsquote (in % der Gesamtrisikopositionsmessgröße)			
EU 14d	Puffer bei der Verschuldungsquote (%)	-	-	-
EU 14e	Gesamtverschuldungsquote (%)	-	-	-
	Liquiditätsdeckungsquote			
15	Liquide Aktiva hoher Qualität (HQLA) insgesamt (gewichteter Wert – Durchschnitt)	6,779	4,774	-
EU 16a	Mittelabflüsse – Gewichteter Gesamtwert	4,163	3,417	-
EU 16b	Mittelzuflüsse – Gewichteter Gesamtwert	2,827	2,089	-
16	Nettomittelabflüsse insgesamt (angepasster Wert)	1,336	1,327	-
17	Liquiditätsdeckungsquote (%)	507.47%	359.7%	-
	Strukturelle Liquiditätsquote			
18	Verfügbare stabile Refinanzierung, gesamt	7,927	7,103	-
19	Erforderliche stabile Refinanzierung, gesamt	4,479	4,983	-
20	Strukturelle Liquiditätsquote (NSFR) (%)	177%	0	-