



# Offenlegungsbericht Q3 2024

J.P. Morgan SE

Januar 2026

# Inhaltsverzeichnis

1. EINLEITUNG .....	4
2. EIGENMITTEL, BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN UND SCHLÜSSELPARAMETER (GEMÄß ARTIKEL 437A, 438B UND 447 CRR) .....	10

# Abbildungsverzeichnis

ABBILDUNG 1: EU ILAC – INTERNE VERLUSTABSORPTIONSFÄHIGKEIT: MREL (INTERNE) UND, WENN ZUTREFFEND, ANFORDERUNGEN AN EIGENMITTEL UND BERÜCKSICHTIGUNGSFÄHIGE VERBINDLICHKEITEN FÜR NICHT-EU G-SIIS (IN MIO. €) .....	11
---	----

# Offenlegungsbericht Q3 2024 – J.P. Morgan SE

## 1. Einleitung

### Hintergrund

Der Baseler Ausschuss für Bankenaufsicht hat „Basel III“ als Regelwerk am 16. Dezember 2010 veröffentlicht.

Basel III im weiteren Sinne umfasst zusätzlich die Basel-II-Rahmenvereinbarung von 2004, bestehend aus drei sich gegenseitig ergänzenden Säulen, Säule 1 – Mindestkapitalanforderungen, Säule 2 – Aufsichtsrechtlicher Überprüfungsprozess und Säule 3 – Offenlegung, wodurch den Marktteilnehmern Informationen über den Anwendungsumfang, die Eigenmittel, das Risiko, den Risikoanalyseprozess und somit die Kapitaladäquanz publik gemacht werden sollen.

Die Umsetzung des Basel-III-Rahmenwerks in europäisches Recht in Form eines kombinierten Richtlinien- und Verordnungsvorschlags, der Eigenkapitalrichtlinie IV (Capital Requirements Directive (CRD) IV / EU-Richtlinie 2013/36/EU) und der Kapitaladäquanzverordnung (Capital Requirements Regulation (CRR) / Verordnung [EU] Nr. 575/2013) fand am 27. Juni 2013 mit der Veröffentlichung im Amtsblatt der EU statt. Teil 8 der CRR enthält die erweiterten Vorschriften zur aufsichtsrechtlichen Offenlegung der Kreditinstitute.

Am 3. September 2013 wurde das CRD IV-Umsetzungsgesetz im Bundesgesetzblatt veröffentlicht. Beides, Richtlinie und Verordnung, sind seit 1. Januar 2014 anzuwenden.

Mit der CRR-Änderungsverordnung (EU) 2019/876 (Capital Requirements Regulation II, CRR II) vom 20. Mai 2019 sind auch die Anforderungen an die aufsichtsrechtliche Offenlegung der Institute angepasst worden. Gemeinsam mit der Capital Requirements Directive V (EU) 2019/878 (CRD V) ist die CRR II seit 28. Juni 2021 verbindlich einzuhalten. Am 24. Juni 2020 hat die Europäische Bankenaufsichtsbehörde (European Banking Authority, EBA) die finalen Entwürfe zum aufsichtsrechtlichen Meldewesen (EBA/ITS/2020/05) und zur Offenlegung (EBA/ITS/2020/04) nach CRR II veröffentlicht. Alle im vorliegenden Offenlegungsbericht zur CRR gemachten Angaben schließen die CRR II ein.

Die J.P. Morgan SE setzt mit diesem Bericht die Offenlegungsanforderungen gemäß Artikel 431–455 der Verordnung (EU) 2019/876 – Capital Requirements Regulation II (CRR II), CRD V sowie den EBA/ITS/2020/04 und alle von den EBA-Offenlegungen veröffentlichten relevanten Vorgaben um.

### J.P. Morgan SE

Die J.P. Morgan SE („JPMSE“, die „Bank“, die „Einheit“, „wir“ oder „unser“) ist ein integraler Bestandteil der J.P. Morgan Chase & Co. („J.P. Morgan Chase“, die „Firma“ oder „JPM-Gruppe“) und deren Strategie, die in 15 Ländern im gesamten EWR und im Vereinigten Königreich tätig ist. Dies schaffen wir nur, indem wir wo immer möglich das globale Betriebsmodell nutzen und über einen starken Vorstand verfügen, der Führung, Governance, Risikomanagement und die Einhaltung regulatorischer Anforderungen sicherstellt.

Die J.P. Morgan SE hat ihren Hauptsitz weiterhin in Frankfurt und unterhält ein Netzwerk aus 13 Niederlassungen im gesamten EWR sowie einer Niederlassung in London. Die J.P. Morgan SE beschäftigt mehr als 5.000 Mitarbeiter und ihre Betriebsschwerpunkte liegen in Dublin, Frankfurt, London, Luxemburg und Paris.

## Segment „Banking“

### *Segment „Banking“*

Unternehmen, Regierungen und Institutionen in ganz Europa vertrauen uns ihr Geschäft an. Unser Geschäftsbereich Investment & Corporate Banking liefert strategische Beratung, Kapitalbeschaffung und Risikomanagement-Expertise. Der Bereich Payments bietet eine vollständige Palette von Treasury-, Handels- und globalen Zahlungslösungen, während der Bereich Lending die Aktivitäten unserer Kunden durch die Gewährung von Kreditzusagen unterstützt.

### *Investment & Corporate Banking*

Der Geschäftsbereich Investment & Corporate Banking der J.P. Morgan SE gehört zu den führenden Großhandelsbankkunden-Franchiseunternehmen im EWR. Zu seinen Kunden gehören Unternehmen, Regierungen, Banken und Finanzinstitutionen, Private-Equity-Unternehmen und Familien-/Start-up-Unternehmen. Unsere Kunden sind im EWR und darüber hinaus tätig. Mit der Stärke unseres Franchise-Unternehmens bieten wir eine vollständige Palette an strategischen Bankdienstleistungen, um die Kunden beim Erreichen ihrer Ziele zu unterstützen. Unsere Herangehensweise an den Dienst am Kunden hat sich schon immer darauf konzentriert, erstklassige Geschäfte auf erstklassige Weise zu tätigen. Wir sind bestrebt, vertrauenswürdige, langfristige Beziehungen aufzubauen, indem wir eine ganzheitliche und zukunftsorientierte Sicht auf unsere Beziehungen einnehmen und Wege finden, um Kunden beim Erreichen ihrer wichtigsten Geschäftsziele zu unterstützen.

Das Global Investment Banking konzentriert sich auf die Beschaffung (Origination), Strukturierung und weitere Aktivitäten für die Debt Capital Markets („DCM“), Equity Capital Markets („ECM“) und Mergers & Acquisitions („M&A“).

### *Payments*

J.P. Morgan Payments („JPMP“) ist ein globaler Untergeschäftsbereich innerhalb der Corporate and Investment Bank der JPM-Gruppe. Payments in der J.P. Morgan SE („JPMSE“) besteht aus Payments & Commerce Solutions („P&CS“) (ohne Merchant Services und Commercial Cards), Liquidity & Account Solutions sowie Trade & Working Capital („TWC“), um Kunden in allen Branchensegmenten und Märkten integrierte, umfassende Zahlungs-, Liquiditäts- und Finanzierungslösungen sowie eine Reihe von Working-Capital- und Risikomanagementlösungen anzubieten.

Die J.P. Morgan SE und das zugehörige Payments-Geschäft verfügen über 6 Buchungsstandorte, davon liegen die wichtigsten Payments-Buchungszentren in Frankfurt, Amsterdam, Dublin und Luxemburg, während Brüssel und Paris nach der Migration der JPMCB Brussels und der JPMCB Paris in die J.P. Morgan SE kleinere Buchungsstandorte geworden sind.

Die J.P. Morgan SE betreut Finanzinstitute (darunter Zentralbanken), die öffentliche Hand, Finanzinstitute außerhalb des Bankensektors (darunter FinTech-Unternehmen), Unternehmen und andere Gesellschaften der JPM-Gruppe, wobei die mit FinTech-Kunden verarbeiteten Transaktionen stark zugenommen haben.

Die J.P. Morgan SE trägt weiterhin die globale Verantwortung für den konzernweiten „High Value“-Zahlungsverkehr in Euro. Die Bank ist Mitglied bei allen relevanten Euro-Clearing-Systemen für High-Value Payments sowie im Massenzahlungsverkehr und gehört zu den führenden Banken im Bereich Clearing in TARGET2 und EBA EURO1.

Im Bereich Trade and Working Capital („TWC“) bieten wir unseren Kunden eine große Anzahl an innovativen Working-Capital-orientierten Produkten neben den traditionellen Finanzierungs- und Absicherungsprodukten an. Hierbei handelt es sich um

Produkte wie Finanzierungsprogramme für Lieferanten oder Inventory-Finance-Programme. Für das Geschäft „Trade & Working Capital“ der J.P. Morgan SE buchen wir ausschließlich in Frankfurt.

### *Lending*

Die J.P. Morgan SE unterstützt ihre Kunden im Europäischen Wirtschaftsraum („EWR“), darunter private und öffentliche Unternehmen, Finanzinstitute und Private-Equity-Gesellschaften, durch die Vergabe von Kreditzusagen und bietet dabei eine umfassende Produktpalette an.

### Segment „Markets“

Die J.P. Morgan SE ist das Hauptunternehmen zur Betreuung von EWR-Kunden und hat im Auftrag der JPM-Gruppe die Mitgliedschaften für die EWR-Handelsplätze inne. Dazu gehören Mitgliedschaften an allen relevanten europäischen Börsen und bei der Mehrheit der europäischen zentralen Gegenparteien (Central Counterparties, „CCP“). Auf CCPs außerhalb des EWR erfolgt der Zugang im Rahmen indirekter Clearingvereinbarungen über die Mitgliedschaften anderer Schwesterunternehmen innerhalb der JPM-Gruppe.

Die Bank beschäftigt Trading-Mitarbeiter in Paris, Frankfurt, Madrid, Mailand und Dublin sowie Markets-Sales-Mitarbeiter in Brüssel, Frankfurt, Madrid, Mailand, Paris, Kopenhagen, Helsinki und Stockholm.

Der Kundenstamm besteht aus institutionellen Kunden aus allen Kundensektoren, darunter Banken, Vermögensverwalter, Pensionsfonds, Versicherungsgesellschaften, Hedgefonds, Private-Equity-Gesellschaften, Zweckgesellschaften („SPV“), Unternehmen der öffentlichen Hand sowie Privatunternehmen.

Ein Überblick über die Geschäftsbereiche im Segment Markets findet sich nachstehend:

#### Rentenwerte:

- Global Rates
- Fixed Income Financing
- Global Credit Trading & Syndicate
- Securitized Product Group
- Commodities
- Global Currency & Emerging Markets

#### Aktien:

- Cash Equities
- Aktienderivate
- Prime Finance
- Future and Derivatives Clearing.

## Segment „Securities Services“

Die J.P. Morgan SE bietet alle ihre Dienstleistungen über Niederlassungen in Amsterdam, Brüssel, Kopenhagen, Dublin, Helsinki, Luxemburg, Oslo, Stockholm und die Zentrale in Frankfurt an. Unser Produktsortiment umfasst Depot- und Verwahrstellenleistungen, Fondsdienstleistungen, darunter Fondsbuchhaltung, Transferstellen- und alternative Fondsdienstleistungen, Handelsdienstleistungen, darunter Wertpapierfinanzierung, Sicherheitenverwaltung und Barmittel-, Devisen- und Liquiditätsdienstleistungen, sowie Datenlösungen. Zu unseren Kunden gehören traditionelle und alternative Investmentmanager (einschließlich Hedgefonds), Vermögensigentümer (Rentenfonds, Versicherungsgesellschaften und Unternehmen) sowie Banken und Broker-Dealer.

Als globale Verwahrstelle nutzt die J.P. Morgan SE auch die Dienstleistungen innerhalb von JPMorgan Chase. Mit insgesamt 100 Unterdepotstellen verfügen wir über eines der größten Netzwerke der Welt. Ein Teil dieser Unterdepotstellen wird direkt von J.P. Morgan Chase verwaltet. Im Jahr 2023 haben wir eine Verwahrung im Gesamtwert von 2,6 Billionen Euro für unsere institutionellen Kunden in den Bereichen Depot und Sicherheiten bereitgestellt.

Innerhalb wichtiger EWR-Standorte sind wir die zweitgrößte Verwahrstelle in Luxemburg, die viertgrößte in Irland und die sechstgrößte in Deutschland. Wir sind auch der zweitgrößte Verwalter in Luxemburg.

## Segment „Commercial Banking“

Commercial Banking bietet umfassende Finanzlösungen, einschließlich Kredit-, Zahlungs- und Investmentbanking-Produkten, in zwei Coverage-Teams bei der J.P. Morgan SE an:

Corporate Client Banking und Specialized Industries International verwaltet Beziehungen zu Unternehmen mit Hauptsitz im EWR. Der Geschäftsbereich stellt seinen Kunden vor allem traditionelle Bankprodukte sowie Investmentbanking-Produkte zur Verfügung, darunter DCM, ECM, M&A und Corporate Derivatives.

Commercial Banking International („CBI“) verwaltet Beziehungen zu im EWR ansässigen Tochtergesellschaften ausländischer multinationaler Kunden. Der Geschäftsbereich stellt Kunden hauptsächlich Zahlungs-, Devisen-, Kredit- und Handelslösungen zur Verfügung. Die Tochtergesellschaften sind hauptsächlich in den Geschäftsbereichen US CCBSI, Middle Market and Specialized Industries („MMBSI“) sowie Commercial Real Estate Banking („REB“) von CB tätig.

Commercial Banking nutzt die Produkt- und Dienstleistungsangebote anderer Unternehmen in den Bereichen Zahlungen, DCM, ECM, M&A und Corporate Derivatives, um Kundenbedürfnisse zu erfüllen. Commercial Banking stützt sich maßgeblich auf die Service-, Betriebs- und Technologieabteilungen innerhalb von CIB. Commercial Banking verfügt auch über ein Kreditmarktteam mit Spezialisten für Schuldenlösungen, die sich darauf konzentrieren, Kunden bei ihren Finanzierungsbedürfnissen zu unterstützen.

## Segment „Private Bank“

Das Private-Bank-Segment („PB“) in der J.P. Morgan SE konzentriert sich strategisch auf die Erbringung von Dienstleistungen für ultra-wohlhabende Kunden (Ultra-High Net Worth, „UHNW“) in der gesamten EMEA-Region und bietet Fachwissen in verschiedenen Vermögensverwaltungsdisziplinen an, um die Kunden bei der Erreichung ihrer Ziele bezüglich Wachstum, Verwaltung und Erhalt ihres Vermögens zu unterstützen. PB hat einen klaren mehrjährigen Wachstumsplan definiert, der sich

auf die Akquisition von Kunden und die Vertiefung der Kundenbasis (Erhöhung des Anteils am Gesamtvolumen des Portfolios der bestehenden Kunden) konzentriert.

Das Ziel von J.P. Morgan SE PB ist es, den Kunden in der Vermögensverwaltung eine ganzheitliche Beratung zu bieten: Vermögenswerte, Verbindlichkeiten, Erträge und Liquidität sowie eine konsistente Bereitstellung von Anlage-, Kredit- und Banklösungen, um die Kundenbedürfnisse zu erfüllen. Der Geschäftsbereich („Line of Business, „LOB“) konzentriert sich auf die Bereitstellung außergewöhnlicher Kundenerfahrungen und die Steigerung der Effizienz und Skalierbarkeit durch die Vereinfachung unseres Geschäfts.

PB bedient Kunden in den bestehenden Kernmärkten Benelux (Belgien, Niederlande, Luxemburg), Frankreich, Deutschland, Griechenland, Italien, Spanien, Vereinigtes Königreich, Skandinavien (Schweden, Dänemark, Norwegen, Finnland und Island) sowie in den Offshore-Märkten Irland (von Luxemburg aus miterfasst), MENAT (Nahe Osten, Nordafrika und Türkei) und Schwellenländer (Osteuropa, Israel). Zur Erreichung unserer Wachstumsziele konzentrieren wir uns auf organisches Wachstum und investieren weiterhin in Talente und Technologie, indem wir die Zahl der Berater dadurch erhöhen, dass wir die Niederlassungen von J.P. Morgan SE nutzen, um das Beratererlebnis durch digitale Tools, modernisierte Systeme und vereinfachte Prozesse verbessern.

## Ziel des Offenlegungsberichts

Der Offenlegungsbericht setzt die Anforderungen der Artikel 431–455 der CRR um. Der Offenlegungsbericht umfasst insbesondere Angaben über:

- interne Verlustabsorptionsfähigkeit

Gemäß Artikel 432 CRR und im Einklang mit der EBA/GL/2014/14 zur Wesentlichkeit und Vertraulichkeit der Offenlegung unterliegen die dargestellten Berichtsinhalte dem Wesentlichkeitsgrundsatz. Rechtlich geschützte oder vertrauliche Informationen sind nicht Gegenstand dieses Berichts. Um eine adäquate Offenlegungspraxis zu gewährleisten, finden regelmäßige Überprüfungen der Berichtsinhalte statt.

## Bescheinigung der Angemessenheit der Offenlegungspflichten (gemäß Artikel 431 CRR)

Der Vorstand der J.P. Morgan SE bescheinigt, dass die Bank die in diesem Teil vorgeschriebenen Offenlegungen im Einklang mit den förmlichen Verfahren und internen Abläufen, Systemen und Kontrollen vorgenommen hat. Die Anforderungen gemäß Artikel 432, 433 und 434 CRR werden regelmäßig überprüft und falls erforderlich für die Bank angepasst. Die Bank wendet ein Qualitätssicherungsverfahren an, das über mehrere Hierarchieebenen Sichtungen des Offenlegungsberichts erfordert. Trotz Anwendung einer regulatorischen Standardsoftware werden Abstimmungshandlungen zwischen den relevanten Offenlegungsvordrucken und den Meldevordrucken aus COREP, FINREP, Liquidität, Unbelastete Vermögenswerte, Verbriefungen usw. durchgeführt.

Ich bestätige, dass ich alle zumutbaren Maßnahmen getroffen habe, um sicherzustellen, dass die in dieser Säule-3-Offenlegung dargelegten Informationen nach meinem besten Wissen den Anforderungen von Teil 8 der EU-Verordnung Nr. 2013/575, 2019/876 (und seine nachfolgenden Änderungen) (CRR2) entsprechen und im Einklang mit den auf Ebene der Leitungsorgane vereinbarten internen Richtlinien, internen Kontrollverfahren, Richtlinien, Systemen und Kontrollen erstellt wurden.

David Fellowes-Freeman

CFO J.P. Morgan SE

## Häufigkeit und Mittel der Offenlegung (gemäß Artikel 433, 433a, 433b, 433c, 434 CRR)

Die J.P. Morgan SE erstellt seit Q1 2021 vierteljährlich einen Offenlegungsbericht entsprechend Artikel 433a CRR und seit Q2 2021 als großes, nicht börsennotiertes Institut gemäß Artikel 433a (2) und 433a (3) CRR.

Der Offenlegungsbericht wird gemäß Art. 434 CRR auf der Internetseite der JPMorgan Chase & Co unter <http://investor.shareholder.com/jpmorganchase/basel.cfm> veröffentlicht.

## Anwendungsbereich (gemäß Artikel 436 CRR)

Der vorliegende Offenlegungsbericht basiert auf dem aufsichtsrechtlichen Konsolidierungskreis. Dieser umfasst die J.P. Morgan SE. Mit Stand zum 30.09.2024 besitzt die J.P. Morgan SE drei Tochtergesellschaften, die aufgrund ihrer Größe keiner Konsolidierungspflicht gemäß Artikel 19 CRR unterliegen.

Der Jahresabschluss der J.P. Morgan SE wird gemäß IFRS erstellt. Dies stellt die Basis der quantitativen Angaben des vorliegenden Berichtes und die Grundlage für die Erstellung der aufsichtsrechtlichen Meldungen gemäß CRR dar. Die Bank wendet Artikel 473a CRR nicht an.

Alle Angaben im vorliegenden Offenlegungsbericht sind, falls nicht anders angegeben, in Mio. Euro ausgewiesen. Zellen, die als „0“ oder „-“ angezeigt werden, beziehen sich auf Beträge von weniger als 500.000 EUR. Leere Zellen bedeuten, dass kein Wert existiert. Aufgrund der Rundung ergeben die in den Vorlagen dargestellten Zahlen möglicherweise nicht immer genau die angegebenen Summen. Die Angaben in diesem Bericht beziehen sich, falls nicht anders angegeben, auf den 30.09.2024.

## 2. Eigenmittel, berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten und Schlüsselparameter (gemäß Artikel 437a, 438b und 447 CRR)

### Hauptmerkmale der berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten

Zum 30.09.2024 hat die J.P. Morgan SE keine anrechenbaren Verbindlichkeiten.

### TLAC und MREL

2019 begann die Einführung der Anforderung zur Verlustabsorptionsfähigkeit (Total Loss Absorbing Capacity, TLAC) und für Banken in der Europäischen Union zusätzlich die Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (Minimum Requirements for Own Funds and Eligible Liabilities, MREL). Damit soll sichergestellt werden, dass im Falle einer Abwicklung ausreichende Mittel zur Verlustabsorption zur Verfügung stehen, um Rückgriffe auf Steuergelder zu vermeiden.

Die nachfolgenden Tabellen legen die Anforderungen an interne MREL und interne TLAC offen.

Abbildung 1: EU ILAC – Interne Verlustabsorptionsfähigkeit: MREL (interne) und, wenn zutreffend, Anforderungen an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten für nicht-EU G-SIIs (in Mio. €)

30.09.2024		a	b	c
		Mindestanforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (interne MREL)	Nicht-EU G-SII-Anforderung für Eigenkapital und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (interne TLAC)	Qualitative Informationen
<b>Ansetzbare Anforderung und Grad der Anwendung</b>				
EU-1	Unterliegt das Unternehmen einer Nicht-EU G-SII-Anforderung an Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten? (J/N)			J
EU-2	Wenn EU-1 mit „Ja“ beantwortet wird: Ist die Anforderung auf konsolidierter oder auf individueller Basis anwendbar? (K/I)			I
EU-2a	Unterliegt das Unternehmen einer internen MREL-Anforderung? (J/N)			J
EU-2b	Wenn EU-2a mit „Ja“ beantwortet wird: Ist die Anforderung auf konsolidierter oder auf individueller Basis anwendbar? (K/I)			I
<b>Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten</b>				
EU-3	Hartes Kernkapital Tier 1 (CET1)	24.030	24.030	
EU-4	Berücksichtigungsfähige zusätzliche Tier-1-Instrumente			
EU-5	Anrechenbare Tier-2-Instrumente	17.516	17.516	
EU-6	Berücksichtigungsfähige Eigenmittel	41.546	41.546	
EU-7	Berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten			
EU-8	Davon zulässige Garantien			
EU-9a	(Anpassungen)			
EU-9b	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeitspositionen nach Anpassungen	41.546	41.546	
<b>Gesamtrisikobetrag und Gesamtrisikopositionsmessgröße</b>				
EU-10	Gesamtrisikobetrag	128.108	128.108	
EU-11	Gesamtrisikopositionsmessgröße	418.088	418.088	
<b>Verhältnis von Eigenmitteln und berücksichtigungsfähigen Verbindlichkeiten</b>				
EU-12	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (als Prozentwert der TREA)	32,43 %	32,43 %	
EU-13	Davon zulässige Garantien			
EU-14	Eigenmittel und berücksichtigungsfähige Verbindlichkeiten (als Prozentwert der Fremdkapitalrisikopositionen)	9,94 %	9,94 %	
EU-15	Davon zulässige Garantien			
EU-16	CET1 (als ein Prozentwert der TREA) verfügbar, nachdem die Anforderungen des Unternehmens erfüllt worden sind			
EU-17	Institutsspezifische kombinierte Pufferanforderung		4,64 %	
<b>Anforderungen</b>				
EU-18	Anforderung, ausgedrückt als Prozentsatz des Gesamtrisikobetrags	24,75 %	16,20 %	
EU-19	Davon möglicherweise durch Garantien gedeckt			
EU-20	Interne MREL, ausgedrückt als Prozentsatz der Gesamtrisikoposition	6,00 %	6,08 %	
EU-21	Davon möglicherweise durch Garantien gedeckt			
<b>Nachrichtliche Positionen</b>				
EU-22	Gesamtbetrag der ausgeschlossenen Verbindlichkeiten, die in Artikel 72a(2) CRR aufgeführt sind		355.558	

HERAUSGEBER

J.P. Morgan SE

Taunustor 1

60310 Frankfurt am Main