

## Konformitätserklärung nach Artikel 26 Absatz 3 der Verordnung (EU) 2016/1011

--	--

### A. Allgemeine Angaben

1. Datum der Erklärung und gegebenenfalls der letzten Aktualisierung	1. Erstellt am: 17 /09/ 2019 Letzte Aktualisierung: [10/12/2019]
2. Name des Administrators	2. Landesbank Baden-Württemberg

*Im folgenden Abschnitt sind anzugeben:*

- *der nicht signifikante Referenzwert oder die nicht signifikanten Referenzwerte, bei denen Bestimmungen nicht eingehalten werden,*
- *die Bestimmungen, die vom Administrator nicht angewandt werden,*
- *die Gründe, warum nichts dagegen einzuwenden ist, dass der Administrator die jeweilige Bestimmung nicht einhält.*

*Betrifft diese Erklärung eine vom Administrator bereitgestellte Referenzwert-Familie aus nicht signifikanten Referenzwerten, ist ein gesonderter Abschnitt für jede Gruppe von Referenzwerten auszufüllen, bei der*

- *die Bestimmungen, die vom Administrator nicht eingehalten werden, dieselben sind, und*
- *bei jeder einzelnen Bestimmung der Grund, warum nichts gegen die Nichteinhaltung einzuwenden ist, für alle betroffenen Referenzwerte derselbe ist.*

### **B. Die Landesbank Baden-Württemberg wendet die folgenden Bestimmungen der Verordnung (EU) 2016/1011 bei dem/den nachstehenden nicht signifikanten Referenzwert(en) nicht an**

1. Referenzwerte, bei denen die Bestimmungen nicht eingehalten werden	1 LBBW Favoriten Aktien-Indizes:  LBBW Research Favoriten Aktien-Index (DE000SLA1JF1)  LBBW Favoriten Aktien-Zertifikat Nachhaltigkeit (DE000SLA42E8)  LBBW Research Blockchain-Favoriten Aktien-Index (DE000SLA5T80)
2. i) Bestimmung(en) der Verordnung (EU) 2016/1011, die nicht angewandt wird/werden	ii) für jede Bestimmung die Gründe, warum nichts da- gegen einzuwenden ist, dass der Administrator die jeweilige Bestimmung nicht einhält
Art. 4(8) BMR Ein Administrator legt zur Sicherstellung der Integrität und Zuverlässigkeit der Mitarbeiter oder Personen, die den Referenzwert bestimmen, spezifische Verfahren der internen Kontrolle fest und verlangt vor Verbreitung des Referenzwerts zumindest eine interne Abzeichnung durch die Geschäftsleitung.	Alle Eingaben und Berechnungen für die Index-Bereitstellung sind an die Index-Berechnungsstelle ausgelagert. Auf die tägliche Abzeichnung durch die Geschäftsleitung vor der Verbreitung wird verzichtet, da die Bank die implementierten Prozesse als angemessen in der Relation zur Bedeutung der Referenzwerte ansieht.

<p>Art. 5(2) BMR</p> <p>Ein Administrator entwickelt und unterhält solide Verfahren in Bezug auf seine Aufsichtsfunktion und stellt sie den jeweils zuständigen Behörden zur Verfügung.</p>	<p>Die Bank hat eine Aufsichtsfunktion implementiert und die notwendigen Prozesse definiert, um die Überwachung der Referenzwert-Bereitstellung angemessen zu gewährleisten. Auf eine Auflieferung an die Aufsicht wird in Anbetracht der geringen Bedeutung der Referenzwerte verzichtet.</p>
<p>Art 5(3) BMR:</p> <p>Die Aufsichtsfunktion arbeitet integer und umfasst die folgenden Zuständigkeiten, die vom Administrator entsprechend der Komplexität, Verwendung und Anfälligkeit des Referenzwerts angepasst werden:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) die mindestens jährliche Überprüfung der Referenzwert-Definition und –Methodik</li> <li>b) die Überwachung etwaiger Änderungen der Referenzwert-Methodik und die Möglichkeit, vom Administrator eine Konsultation bzgl. dieser Veränderungen zu verlangen</li> <li>c) die Überwachung des Kontrollrahmens des Referenzwert-Managements und der Referenzwert-Anwendung des Administrators und – falls der Referenzwert auf Eingabedaten von Kontributoren basiert – des Verhaltenskodex des Administrators i.S. des Artikels 15</li> <li>d) die Überprüfung und Genehmigung von Verfahren für die Einstellung des Referenzwerts und Konsultationen über die Einstellung</li> <li>e) die Beaufsichtigung von Dritten, die an der Bereitstellung des Referenzwerts einschließlich Berechnung und Verbreitung beteiligt sind</li> <li>f) die Bewertung interner und externer Prüfungen oder Überprüfungen sowie die Überwachung der Umsetzung ermittelter Abhilfemaßnahmen</li> <li>g) wenn der Referenzwert auf Eingabedaten basiert, die Überwachung der Eingabedaten und der Kontributoren sowie der Maßnahmen des Administrators zur Überprüfung oder Validierung des Beitrags von Eingabedaten</li> <li>h) wenn der Referenzwert auf Eingabedaten von Kontributoren basiert, wirksame Maßnahmen bei Verstößen gegen den Verhaltenskodex im Sinne des Artikels 15</li> <li>i) die Unterrichtung der jeweils zuständigen Behörden über von der Aufsichtsfunktion festgestelltes Fehlverhalten von Kontributoren, wenn der Referenzwert auf Eingabedaten von Kontributoren basiert, oder von Administratoren sowie über ungewöhnliche oder verdächtige Eingabedaten</li> </ul>	<p>Die Bank hat eine Aufsichtsfunktion implementiert und die notwendigen Prozesse definiert, um die Überwachung der Referenzwert-Bereitstellung angemessen zu gewährleisten.</p> <p>In den Referenzwerten werden ausschließlich ohne weiteres verfügbare Eingabedaten verwendet, die über Vendoren von Börsen/Handelsplätzen bezogen werden. Wesentliche Änderungen, die die abgebildete wirtschaftliche Realität der Referenzwerte verändern würden, müssen vorab vom Aufsichtsgremium freigegeben werden.</p>

<p>Art. 6(3) BMR: Der Kontrollrahmen umfasst:</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) Steuerung operationeller Risiken,</li> <li>b) angemessene und wirksame Pläne für die Fortführung des Geschäftsbetriebs und die Notfallbewältigung</li> <li>c) vorhandene Notfallverfahren für den Fall von Störungen im Prozess der Bereitstellung des Referenzwerts.</li> </ul>	<p>Die Bank hat allgemein gültige Regelungen für die Punkte a) bis c) getroffen und überprüft diese turnusmäßig. Diese Regelungen decken auch die Prozesse rund um die Bereitstellung der Referenzwerte mit ab. Auf eine gesonderte Aufnahme in den Kontrollrahmen im Zusammenhang mit der BMR wird daher verzichtet.</p>
<p>Art. 6(5) BMR Der Kontrollrahmen wird dokumentiert, überprüft und gegebenenfalls aktualisiert sowie den jeweils zuständigen Behörden und auf Anfrage den Nutzern zur Verfügung gestellt.</p>	<p>Der Kontrollrahmen enthält Informationen zu sensiblen internen Daten. Die Bank hat sich daher entschieden, auf eine Veröffentlichung zu verzichten und den Kontrollrahmen Nutzern auch auf Anfrage nicht zur Verfügung zu stellen.</p>
<p>Art. 13(2) BMR Bei den gemäß Absatz 1 Buchstabe c erforderlichen Verfahren</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>a) werden vorgeschlagene wesentliche Änderungen innerhalb eindeutiger Fristen im Voraus mitgeteilt, um mögliche Auswirkungen analysieren und kommentieren zu können</li> <li>b) werden die unter Buchstabe a dieses Absatzes genannten Kommentare und die entsprechende Stellungnahme des Administrators nach jeder Konsultation zugänglich gemacht, es sei denn, der Verfasser der Kommentare hat um Vertraulichkeit ersucht</li> </ul>	<p>Methodikänderungen werden rechtzeitig vor deren Anwendung auf <a href="http://www.solactive.com">www.solactive.com</a> angekündigt.</p> <p>Auf die Veröffentlichung von Kommentaren zu Methodikänderungen wird aus Proportionalitätsgründen im Hinblick auf die nicht gegebene Signifikanz der Referenzwerte verzichtet.</p>