

Полугодишни оповестявания по Стълб 3 с данни за 2Q2024

Съдържание

1. Образец EU KM1 — Основни показатели (консолидирана база).....	3
2. EU ILAC — Вътрешен капацитет за поемане на загуби: вътрешно МИПЗ и по целесъобразност изискване за собствени средства и приемливи задължения за Г-СЗИ извън ЕС (индивидуална база).....	4

1. Образец EU KM1 — Основни показатели (консолидирана база)

		а	б	в
		Q2 2023	Q4 2023	Q2 2024
Налични собствени средства (стойност)				
1	Базов собствен капитал от първи ред (БСК1)	2 755 070	2 756 568	3 523 277
2	Капитал от първи ред	2 868 508	2 870 006	3 523 277
3	Общ капитал	3 046 489	3 047 987	3 701 258
Рисково претеглена стойност на експозициите				
4	Обща рискова експозиция	15 072 677	15 703 816	17 108 153
Коефициенти на капиталова адекватност (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)				
5	Отношение на БСК1 (%)	18.28%	17.55%	20.59%
6	Отношение на капитала от първи ред (%)	19.03%	18.28%	20.59%
7	Отношение на общата капиталова адекватност (%)	20.21%	19.41%	21.63%
Допълнителни капиталови изисквания с оглед на рисковете, различни от риска от прекомерен ливъридж (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)				
EU 7a	Допълнителни капиталови изисквания с оглед на рисковете, различни от риска от прекомерен ливъридж (%)	1.50%	1.50%	1.50%
EU 7б	в т.ч.: изпълнени с БСК1 (процентни пунктове)	0.84%	0.84%	0.84%
EU 7в	в т.ч.: изпълнени с капитал от първи ред (процентни пунктове)	1.13%	1.13%	1.13%
EU 7г	ОКИПНПО (%)	9.50%	9.50%	9.50%
Комбинирано изискване за буфер и съвкупно капиталово изискване (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)				
8	Предпазен капиталов буфер (%)	2.50%	2.50%	2.50%
EU 8a	Предпазен буфер за установен на равнище държава членка макропруденциален или системен риск (%)	0	0	0
9	Специфичен за институцията антицикличен капиталов буфер (%)	1.50%	2.00%	2.00%
EU 9a	Буфер за системен риск (%)	3%	3%	3%
10	Буфер за глобалните системно значими институции (%)	0	0	0
EU 10a	Буфер за други системно значими институции (%)	1.00%	1.00%	1.00%
11	Комбинирано изискване за буфер (%)	8.00%	8.50%	8.50%
EU 11a	Съвкупно капиталово изискване (%)	17.50%	18.00%	18.00%
12	БСК1, наличен след изпълнение на ОКИПНПО (%)	10.71%	9.91%	12.13%
Отношение на ливъридж				
13	Мярка за общата експозиция	33 699 326	35 960 930	36 812 606
14	Отношение на ливъридж (%)	8.51%	7.98%	9.57%
Допълнителни капиталови изисквания с оглед на риска от прекомерен ливъридж (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)				
EU 14a	Допълнителни капиталови изисквания с оглед на риска от прекомерен ливъридж (%)	0%	0%	0%
EU 14б	в т.ч.: изпълнени с БСК1 (процентни пунктове)	0	0	0
EU 14в	Общо изискване за отношението на ливъридж по ПНПО (%)	3.00%	3.00%	3.00%
Изискване за буфер на отношението на ливъридж и съвкупно изискване за отношението на ливъридж (като процент от мярката за общата експозиция)				
EU 14г	Изискване за буфер на отношението на ливъридж (%)	0.00%	0.00%	0.00%
EU 14д	Съвкупно изискване за отношението на ливъридж (%)	3.00%	3.00%	3.00%
Коефициент на ликвидно покритие				
15	Общо висококачествени ликвидни активи (ВКЛА) (среднопретеглена стойност)	11 557 231	13 446 182	12 438 310
EU 16a	Изходящи парични потоци — Обща претеглена стойност	6 857 357	12 834 740	10 708 052
EU 16б	Входящи парични потоци — Обща претеглена стойност	1 349 734	6 917 822	5 812 447
16	Общо нетни изходящи парични потоци (коригирана стойност)	5 507 623	5 916 918	4 895 605
17	Отношение на ликвидно покритие (%)	210%	227%	254%
Коефициент на стабилност на нетното финансиране				
18	Общо налично стабилно финансиране	23 637 864	25 855 556	27 161 577
19	Общо изисквано стабилно финансиране	14 585 928	15 311 955	16 186 690
20	ОНСФ (%)	162%	169%	168%

2. EU ILAC — Вътрешен капацитет за поемане на загуби: вътрешно МИПЗ и по целесъобразност изискване за собствени средства и приемливи задължения за Г-СЗИ извън ЕС (индивидуална база)

		а	б	в
		Минимално изискване за собствени средства и приемливи задължения	Изискване за собствени средства и приемливи задължения за Г-СЗИ извън ЕС	Качествена информация
Приложимо изискване и ниво на прилагане				
EU-1	Подлежи ли субектът на изискване за собствени средства и приемливи задължения за Г-СЗИ извън ЕС? (ДА/НЕ)			НЕ
EU-2	Ако в EU-1 е отговорено с „Да“, дали изискването се прилага на консолидирана или индивидуална основа? (К/И)			
EU-2 а	Подлежи ли субектът на вътрешно МИПЗ? (ДА/НЕ)			ДА
EU-2b	Ако в EU-2а е отговорено с „Да“, дали изискването се прилага на консолидирана или индивидуална основа? (К/И)			И
Собствени средства и приемливи задължения				
EU-3	Базов собствен капитал от първи ред (БСК1)	3 533 417 000		
EU-4	Приемлив допълнителен капитал от първи ред	-		
EU-5	Приемлив капитал от втори ред	177 981 000		
EU-6	Приемливи собствени средства	3 711 398 000		
EU-7	Приемливи задължения	1 251 731 200		
EU-8	в т.ч. разрешени гаранции	-		
EU-9 а	(Корекции)	-		
EU-9b	Собствени средства и елементи на приемливите задължения след корекции	4 963 129 200		
Обща рискова експозиция и мярка за общата експозиция				
EU-10	Обща рискова експозиция (ОРЕ)	17 156 753 000		
EU-11	Мярка за общата експозиция (МОЕ)	37 068 190 000		
Коефициенти на собствените средства и приемливите задължения				
EU-12	Собствени средства и приемливи задължения като процент от ОРЕ	28.93%		
EU-13	в т.ч. разрешени гаранции	0.00%		
EU-14	Собствени средства и приемливи задължения като процент от МОЕ	13.39%		
EU-15	в т.ч. разрешени гаранции	0.00%		
EU-16	БСК1 (като процент от ОРЕ), наличен след изпълнение на изискванията от субекта	10.72%		
EU-17	Специфично за институцията комбинирано изискване за буфер			
Изисквания				
EU-18	Изискване, изразено като процент от ОРЕ	18.21%		
EU-19	в т.ч. частта от изискването, която може да бъде изпълнена с гаранция			
EU-20	Изискване, изразено като процент от МОЕ	5.90%		
EU-21	в т.ч. частта от изискването, която може да бъде изпълнена с гаранция			
Поясняващи позиции				
EU-22	Общ размер на изключените задължения, посочени в член 72а, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013			