



**ОПОВЕСТЯВАНИЯ
НА НЕКОНСОЛИДИРАНА ОСНОВА**

30 юни 2024

(Всички суми са в хиляди лева, освен ако не е упоменато друго)

Съдържание

1. EU KM1: Основни показатели	2
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.....	3

(Всички суми са в хиляди лева, освен ако не е упоменато друго)

Образец EU KM1 — Основни показатели

		а	в	д
		30.06.2024	31.12.2023	30.06.2023
	Налични собствени средства (стойност)			
1	Базов собствен капитал от първи ред (БСК1)	2 341 115	2 194 929	1 992 407
2	Капитал от първи ред	2 341 115	2 194 929	1 992 407
3	Общ капитал	2 556 256	2 410 070	2 207 548
	Рисково претеглена стойност на експозициите			
4	Обща рискова експозиция	11 825 644	11 544 200	10 401 594
	Коефициенти на капиталова адекватност (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)			
5	Отношение на БСК1 (%)	19.80%	19.01%	19.15%
6	Отношение на капитала от първи ред (%)	19.80%	19.01%	19.15%
7	Отношение на общата капиталова адекватност (%)	21.62%	20.88%	21.22%
	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 (%)	1.25%	1.25%	1.25%
EU 7b	в т.ч.: изпълнени с БСК1 (процентни пунктове)	0.70%	0.70%	0.70%
EU 7c	в т.ч.: изпълнени с капитал от първи ред (процентни пунктове)	0.94%	0.94%	0.94%
EU 7r	ОКИППО (%)	9.25%	9.25%	9.25%
	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 (%)	0.00%	0.00%	0.00%
9	Специфичен за институцията антицикличен капиталов буфер (%)	2.00%	2.00%	1.50%
EU 9a	Буфер за системен риск (%)	3.00%	3.00%	3.00%
10	Буфер за глобалните системно значими институции (%)	0.00%	0.00%	0.00%
EU 10a	Буфер за други системно значими институции (%)	0.75%	0.75%	0.75%
11	Комбинирано изискване за буфер (%)	8.25%	8.25%	7.75%
EU 11a	Съвкупно капиталово изискване (%)	17.50%	17.50%	17.00%
12	БСК1, наличен след изпълнение на ОКИППО (%)	1 462 832	1 342 590	1 451 524
	Отношение на ливъридж			
13	Мярка за общата експозиция	21 230 206	20 258 264	18 567 183
14	Отношение на ливъридж (%)	11.03%	10.83%	10.73%
	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 (%)	0.00%	0.00%	0.00%
EU 14b	в т.ч.: изпълнени с БСК1 (процентни пунктове)	0.00%	0.00%	0.00%
EU 14c	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 14r	Изискване за буфер на отношението на ливъридж (%)	0.00%	0.00%	0.00%
EU 14d	Съвкупно изискване за отношението на ливъридж (%)	3.00%	3.00%	3.00%
	Коефициент на ликвидно покритие			
15	Общо висококачествени ликвидни активи (ВКЛА) (среднопретеглена стойност)	3 999 274	3 558 360	3 134 634
EU 16a	Исходящи парични потоци — Обща претеглена стойност	3 065 054	2 763 248	2 413 167
EU 16b	Входящи парични потоци — Обща претеглена стойност	971 514	838 935	1 009 233
16	Общо нетни изходящи парични потоци (коригирана стойност)	2 093 540	1 924 313	1 430 659
17	Отношение на ликвидно покритие (%)	191.50%	186.82%	257.94%
	Коефициент на стабилност на нетното финансиране			
18	Общо налично стабилно финансиране	16 729 260	16 007 240	14 686 154
19	Общо изисквано стабилно финансиране	11 310 096	10 758 997	10 225 710
20	ОНСФ (%)	147.91%	148.78%	143.62%

(Всички суми са в хиляди лева, освен ако не е упоменато друго)

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

		а	б	в
		Минимално изискване за собствени средства и приемливи задължения (вътрешно МИПЗ)	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“, прилага ли се изискването на консолидирана или индивидуална основа? (К/И)			
EU-2a	Подлежи ли субектът на вътрешно МИПЗ? (ДА/НЕ)			Да
EU-2b	Ако в EU-2a е отговорено с „Да“, прилага ли се изискването на консолидирана или индивидуална основа? (К/И)			И
Собствени средства и приемливи задължения				
EU-3	Базов собствен капитал от първи ред (БСК1)	2 341 115		
EU-4	Приемлив допълнителен капитал от първи ред	0		
EU-5	Приемлив капитал от втори ред	215 141		
EU-6	Приемливи собствени средства	2 556 256		
EU-7	Приемливи задължения	801 890		
EU-8	в т.ч. разрешени гаранции	0		
EU-9a	(Корекции)	0		
EU-9b	Собствени средства и елементи на приемливите задължения след корекции	3 358 146		
Обща рискова експозиция и мярка за общата експозиция				
EU-10	Обща рискова експозиция (ОРЕ)	11 825 644		
EU-11	Мярка за общата експозиция (МОЕ)	21 230 206		
Коефициент на собствените средства и приемливите задължения				
EU-12	Собствени средства и приемливи задължения като процент от ОРЕ	28.40%		
EU-13	в т.ч. разрешени гаранции			
EU-14	Собствени средства и приемливи задължения като процент от МОЕ	15.82%		
EU-15	в т.ч. разрешени гаранции			
EU-16	БСК1 (като процент от ОРЕ), наличен след изпълнение на изискванията от субекта	4.12%		
EU-17	Специфично за институцията комбинирано изискване за буфер	8.25%		
Изисквания				
EU-18	Изискване, изразено като процент от ОРЕ	17.65%		
EU-19	в т.ч. частта от изискването, която може да бъде изпълнена с гаранции			
EU-20	Изискване, изразено като процент от МОЕ	5.91%		
EU-21	в т.ч. частта от изискването, която може да бъде изпълнена с гаранции			
Появяващи позиции				
EU-22	Общ размер на изключените задължения, посочени в член 72а, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	10 175 215		