ОПОВЕСТЯВАНИЯ

НА НЕКОНСОЛИДИРАНА ОСНОВА

30 юни 2026

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

Образец EU KM1 — Основни показатели

		а	б	в	г	д
		30.06.2026	*31.03.2026*	31.12.2025	30.09.2025	30.06.2025
	Налични собствени средства (стойност)					
1	Базов собствен капитал от първи ред (БСК1)	1 459 592 646	1 376 246 283	1 386 334 702	1 392 588 313	1 397 416 442
2	Капитал от първи ред	1 459 592 646	1 376 246 283	1 386 334 702	1 392 588 313	1 397 416 442
3	Общ капитал	1 569 592 646	1 486 246 283	1 496 334 549	1 502 588 160	1 507 416 289
	Рисково претеглена стойност на експозициите					
4	Обща рискова експозиция	7 488 263 078	7 059 162 082	6 783 223 491	6 699 007 582	6 562 894 526
4a	Обща рискова експозиция преди долната граница	7 488 263 078	7 059 162 082	6 783 223 491	6 699 007 582	6 562 894 526
	Коефициенти на капиталова адекватност (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)					
5	Отношение на БСК1 (%)	19.49%	19.50%	20.44%	20.79%	21.29%
5a	Не е приложимо					
5b	Отношение на БСК1 при ОРРЕ без долна граница	19.49%	19.50%	20.44%	20.79%	21.29%
6	Отношение на капитала от първи ред (%)	19.49%	19.50%	20.44%	20.79%	21.29%
6a	Не е приложимо					
6b	Отношение на капитал от първи ред при ОРРЕ без долна граница	19.49%	19.50%	20.44%	20.79%	21.29%
7	Отношение на общата капиталова адекватност (%)	20.96%	21.05%	22.06%	22.43%	22.97%
7a	Не е приложимо					
7b	Отношение на общата капиталова адекватност при ОРРЕ без долна граница	20.96%	21.05%	22.06%	22.43%	22.97%
	Допълнителни капиталови изисквания с оглед на рисковете, различни от риска от прекомерен ливъридж (като процент от рисково претеглената стойност на експозициите)					
EU 7d	Допълнителни капиталови изисквания с оглед на рисковете, различни от риска от прекомерен ливъридж (%)	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%	1.25%
EU 7e	в т.ч.: изпълнени с БСК1 (процентни пунктове)	0.70%	0.70%	0.70%	0.70%	0.70%
EU 7f	в т.ч.: изпълнени с капитал от първи ред (процентни пунктове)	0.94%	0.94%	0.94%	0.94%	0.94%
EU 7g	ОКИПНПО (%)	9.25%	9.25%	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%	2.50%	2.50%
EU 8a	Предпазен буфер за установен на равнище държава членка макропруденциален или системен риск (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
9	Специфичен за институцията антицикличен капиталов буфер (%)	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%	2.00%
EU 9a	Буфер за системен риск (%)	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
10	Буфер за глобалните системно значими институции (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
EU 10a	Буфер за други системно значими институции (%)	1.00%	1.00%	0.75%	0.75%	0.75%
11	Комбинирано изискване за буфер (%)	8.50%	8.50%	8.25%	8.25%	8.25%
EU 11a	Съвкупно капиталово изискване (%)	17.75%	17.75%	17.50%	17.50%	17.50%
12	БСК1, наличен след изпълнение на ОКИПНПО (%)	876 875 606	832 981 126	868 930 838	882 929 498	900 428 974

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

		а	б	в	г	д
		30.06.2026	*31.03.2026*	31.12.2025	30.09.2025	30.06.2025
	Отношение на ливъридж					
13	Мярка за общата експозиция	15 187 215 154	14 505 733 328	14 206 635 546	13 236 885 108	12 907 603 422
14	Отношение на ливъридж (%)	9.61%	9.49%	9.76%	10.52%	10.83%
	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%	0.00%	0.00%
EU 14b	в т.ч.: изпълнени с БСК1 (процентни пунктове)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
EU 14c	Общо изискване за отношението на ливъридж по ПНПО (%)	3.00%	3.00%	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 14d	Изискване за буфер на отношението на ливъридж (%)	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
EU 14e	Съвкупно изискване за отношението на ливъридж (%)	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%	3.00%
	Коефициент на ликвидно покритие					
15	Общо висококачествени ликвидни активи (ВКЛА) (среднопретеглена стойност)	3 143 340 367	2 858 974 274	2 506 581 349	2 238 706 329	2 139 640 971
EU 16a	Изходящи парични потоци — Обща претеглена стойност	2 119 066 796	2 029 408 158	1 954 909 169	1 856 039 635	1 778 524 207
EU 16b	Входящи парични потоци — Обща претеглена стойност	583 148 187	665 238 373	756 406 232	748 928 588	700 662 123
16	Общо нетни изходящи парични потоци (коригирана стойност)	1 535 918 609	1 364 169 784	1 198 503 449	1 107 111 047	1 077 862 084
17	Отношение на ликвидно покритие (%)	205.63%	209.97%	208.35%	202.06%	198.48%
	Коефициент на стабилност на нетното финансиране					
18	Общо налично стабилно финансиране	11 703 559 897	11 348 884 012	11 141 129 853	10 293 840 467	10 013 757 331
19	Общо изисквано стабилно финансиране	7 855 713 372	7 453 456 015	7 197 245 671	6 996 721 085	6 740 915 622
20	ОНСФ (%)	148.98%	152.26%	154.80%	147.12%	148.55%

(Всички суми са в евра, 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 (вътрешен ОКПЗ)**	**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)	1 459 592 646		
EU-4	Приемлив допълнителен капитал от първи ред	0		
EU-5	Приемлив капитал от втори ред	110 000 000		
EU-6	Приемливи собствени средства	1 569 592 646		
EU-7	Приемливи задължения	810 000 000		
EU-8	в т.ч. разрешени гаранции	0		
EU-9a	(Корекции)	0		
EU-9b	Собствени средства и елементи на приемливите задължения след корекции	2 379 592 646		
Обща рискова експозиция и мярка за общата експозиция				
EU-10	Обща рискова експозиция (ОРЕ)	7 488 263 078		
EU-11	Мярка за общата експозиция (МОЕ)	15 187 215 154		
Коефициент на собствените средства и приемливите задължения				
EU-12	Собствени средства и приемливи задължения като процент от ОРЕ	31.78%		
EU-13	в т.ч. разрешени гаранции			
EU-14	Собствени средства и приемливи задължения като процент от МОЕ	15.67%		
EU-15	в т.ч. разрешени гаранции			
EU-16	БСК1 (като процент от ОРЕ), наличен след изпълнение на изискванията от субекта	5.79%		
EU-17	Специфично за институцията комбинирано изискване за буфер	8.50%		
Изисквания				
EU-18	Изискване, изразено като процент от ОРЕ	22.08%		
EU-19	в т.ч. частта от изискването, която може да бъде изпълнена с гаранция			
EU-20	Изискване, изразено като процент от МОЕ	5.91%		
EU-21	в т.ч. частта от изискването, която може да бъде изпълнена с гаранция			
Пояснителни позиции				
EU-22	Общ размер на изключените задължения, посочени в член 72a, параграф 2 от Регламент (ЕС) № 575/2013	6 616 472 670		