

Tabela 1. EU KM1 – Najważniejsze wskaźniki na dzień 31 grudnia 2021 roku

		a	b	c	d	e
		31 grudnia 2021	30 września 2021	30 czerwca 2021	31 marca 2021	31 grudnia 2020
Dostępne fundusze własne (kwoty)						
1	Kapitał podstawowy Tier I	8 578 610	8 602 616	8 187 990	8 187 136	8 189 078
2	Kapitał Tier I	8 578 610	8 602 616	8 187 990	8 187 136	8 189 078
3	Łączny kapitał	8 578 610	8 602 616	8 187 990	8 187 136	8 189 078
Kwoty ekspozycji ważonych ryzykiem						
4	Łączna kwota ekspozycji na ryzyko	35 641 849	34 638 855	34 133 255	35 316 941	35 540 617
Współczynniki kapitałowe (jako odsetek kwoty ekspozycji ważonej ryzykiem)						
5	Współczynnik kapitału podstawowego Tier I (%)	24,07%	24,84%	23,99%	23,18%	23,04%
6	Współczynnik kapitału Tier I (%)	24,07%	24,84%	23,99%	23,18%	23,04%
7	Łączny współczynnik kapitałowy (%)	24,07%	24,84%	23,99%	23,18%	23,04%
Dodatkowe wymogi w zakresie funduszy własnych w celu uwzględnienia ryzyka innego niż ryzyko nadmiernej dźwigni (jako odsetek kwoty ekspozycji ważonej ryzykiem)						
EU-7a	Dodatkowe wymogi w zakresie funduszy własnych w celu uwzględnienia ryzyka innego niż ryzyko nadmiernej dźwigni (%)					
EU-7b	W tym: obejmujące kapitał podstawowy Tier I (punkty procentowe)					
EU-7c	W tym: obejmujące kapitał Tier I (punkty procentowe)					
EU-7d	Łączne wymogi w zakresie funduszy własnych SREP (%)	8,00%	8,00%	8,00%	8,00%	8,00%
Wymóg połączony bufora i łączne wymogi kapitałowe (jako odsetek kwoty ekspozycji ważonej ryzykiem)						
8	Bufor zabezpieczający (%)	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
EU-8a	Bufor zabezpieczający wynikający z ryzyka makroostrożnościowego lub ryzyka systemowego zidentyfikowanego na poziomie państwa członkowskiego (%)					
9	Specyficzny dla instytucji bufor antycykliczny (%)					
EU-9a	Bufor ryzyka systemowego (%)					
10	Bufor globalnych instytucji o znaczeniu systemowym (%)					
EU-10a	Bufor innych instytucji o znaczeniu systemowym (%)					
11	Wymóg połączony bufora (%)	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
EU-11a	Łączne wymogi kapitałowe (%)	10,50%	10,50%	10,50%	10,50%	10,50%
12	Kapitał podstawowy Tier I dostępny po spełnieniu łącznych wymogów w zakresie funduszy własnych SREP (%)	16,07%	16,84%	15,99%	15,18%	15,04%
Wskaźnik dźwigni						
13	Miara ekspozycji całkowitej	98 175 297	84 419 386	81 852 465	79 159 564	70 299 323
14	Wskaźnik dźwigni (%)	8,26%	9,61%	9,41%	9,73%	10,95%
Dodatkowe wymogi w zakresie funduszy własnych w celu uwzględnienia ryzyka nadmiernej dźwigni finansowej (jako odsetek miary ekspozycji całkowitej)						
EU-14a	Dodatkowe wymogi w zakresie funduszy własnych w celu uwzględnienia ryzyka nadmiernej dźwigni finansowej (%)					
EU-14b	W tym: obejmujące kapitał podstawowy Tier I (punkty procentowe)					
EU-14c	Łączne wymogi w zakresie wskaźnika dźwigni SREP (%)	3%	3%	3%	3%	3%
Bufor wskaźnika dźwigni i łączny wymóg w zakresie wskaźnika dźwigni (jako odsetek miary ekspozycji całkowitej)						
EU-14d	Wymóg w zakresie bufora wskaźnika dźwigni (%)					
EU-14e	Łączny wymóg w zakresie wskaźnika dźwigni (%)	3%	3%	3%	3%	3%
Wskaźnik pokrycia wpływów netto *						
15	Aktywa płynne wysokiej jakości (HQLA) ogółem (wartość ważona – średnia)	7 423 150	6 606 129	5 655 958	6 879 603	7 821 183
EU-16a	Wpływy środków pieniężnych – Całkowita wartość ważona	13 598 266	9 159 930	8 808 223	8 111 722	6 348 694
EU-16b	Wpływy środków pieniężnych – Całkowita wartość ważona	11 612 885	6 547 418	9 913 976	8 798 978	6 261 433
16	Wpływy środków pieniężnych netto ogółem (wartość skorygowana)	3 399 566	2 612 512	2 202 056	2 027 930	1 587 173
17	Wskaźnik pokrycia wpływów netto (%)	218,36%	252,87%	256,85%	339,24%	492,77%
Wskaźnik stabilnego finansowania netto *						
18	Dostępne stabilne finansowanie ogółem	80 293 189	72 198 476	70 398 372	65 584 183	59 833 983
19	Wymagane stabilne finansowanie ogółem	60 318 780	33 704 884	34 227 928	36 789 301	35 445 924
20	Wskaźnik stabilnego finansowania netto (%)	133,11%	214,21%	205,68%	178,27%	168,80%