

Tabela 1. EU KM1 – Najważniejsze wskaźniki na dzień 31 grudnia 2023 roku

		a	b	c	d	e
		31 grudnia 2023	30 września 2023	30 czerwca 2023	31 marca 2023	31 grudnia 2022
Dostępne fundusze własne (kwoty)						
1	Kapitał podstawowy Tier I	10 379 343	10 503 514	8 891 743	8 878 400	8 864 919
2	Kapitał Tier I	10 379 343	10 503 514	8 891 743	8 878 400	8 864 919
3	Łączny kapitał	10 379 343	10 503 514	8 891 743	8 878 400	8 864 919
Kwoty ekspozycji ważonych ryzykiem						
4	Łączna kwota ekspozycji na ryzyko	32 566 924	32 705 822	33 097 548	32 562 144	31 530 155
Współczynniki kapitałowe (jako odsetek kwoty ekspozycji ważonej ryzykiem)						
5	Współczynnik kapitału podstawowego Tier I (%)	31,87%	32,12%	26,87%	27,27%	28,12%
6	Współczynnik kapitału Tier I (%)	31,87%	32,12%	26,87%	27,27%	28,12%
7	Łączny współczynnik kapitałowy (%)	31,87%	32,12%	26,87%	27,27%	28,12%
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 połączonego 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 połączonego 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 (%)	23,87%	24,12%	18,87%	19,27%	20,12%
Wskaźnik dźwigni						
13	Miara ekspozycji całkowitej	96 239 227	90 565 063	85 031 797	90 275 344	94 873 125
14	Wskaźnik dźwigni (%)	25,25%	26,71%	23,01%	23,48%	22,13%
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)	7 041 085	6 832 049	7 137 051	7 119 458	8 113 907
EU-16a	Wpływy środków pieniężnych – Całkowita wartość ważona	11 261 901	8 383 706	7 907 765	9 250 322	11 072 160
EU-16b	Wpływy środków pieniężnych – Całkowita wartość ważona	14 037 745	13 116 883	11 684 491	12 881 800	13 412 056
16	Wpływy środków pieniężnych netto ogółem (wartość skorygowana)	2 815 475	2 095 926	1 976 941	2 312 580	2 768 040
17	Wskaźnik pokrycia wpływów netto (%)	250,09%	325,97%	361,01%	307,86%	293,13%
Wskaźnik stabilnego finansowania netto *						
18	Dostępne stabilne finansowanie ogółem	82 220 043	79 273 828	73 892 871	77 831 118	80 145 015
19	Wymagane stabilne finansowanie ogółem	59 221 571	55 332 847	52 695 685	55 669 032	58 232 465
20	Wskaźnik stabilnego finansowania netto (%)	138,83%	143,27%	140,23%	139,81%	137,63%

* Bank jako uczestnik systemu ochrony instytucjonalnej jest zwolniony z indywidualnego spełniania wymogu pokrycia płynności