

DISCIPLINA DE MERCADO

(em milhares de EUR)

30.06.2021 31.03.2021 31.12.2020 30.09.2020 30.06.2020

Fundos próprios disponíveis (montantes)						
1	Fundos próprios principais de nível 1 (CET1)	438 277	-	421 756	-	404 132
2	Fundos próprios de nível 1	545 415	-	528 717	-	511 038
3	Capital total	547 712	-	530 281	-	512 528
Montantes das exposições ponderadas pelo risco						
4	Montante total das exposições	2 080 086	-	1 861 841	-	1 516 505
Rácios de fundos próprios (em percentagem do montante de exposição ponderada pelo risco)						
5	Rácio de fundos próprios principais de nível 1 (%)	21,1%	-	22,7%	-	26,6%
6	Rácio de nível 1 (%)	26,2%	-	28,4%	-	33,7%
7	Rácio de fundos próprios total (%)	26,3%	-	28,5%	-	33,8%
Requisitos de fundos próprios adicionais para fazer face a outros riscos que não o risco de alavancagem excessiva (em percentagem do montante da exposição ponderada pelo risco)						
EU 7a	Requisitos de fundos próprios adicionais para fazer face a outros riscos que não o risco de alavancagem excessiva (%)	5,0%	-	5,0%	-	5,0%
EU 7b	do qual: a satisfazer através de fundos próprios CET1 (pontos percentuais)	2,8%	-	2,8%	-	2,8%
EU 7c	do qual: a satisfazer através de fundos próprios de nível 1 (pontos percentuais)	3,8%	-	3,8%	-	3,8%
EU 7d	Total dos requisitos de fundos próprios SREP (%)	13,0%	-	13,0%	-	13,0%
Requisito combinado de fundos próprios global e de reserva de fundos próprios (em percentagem do montante da exposição ponderada pelo risco)						
8	Reserva de conservação de fundos próprios	2,5%	-	2,5%	-	2,5%
EU 8a	Reserva de conservação decorrente de riscos macroprudenciais ou sistémicos identificados ao nível de um Estado-Membro (%)	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
9	Reserva contracíclica de fundos próprios específica da instituição (%)	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
EU 9a	Reserva para risco sistémico (%)	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
10	Reserva das instituições de importância sistémica global (%)	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
EU 10a	Reserva das outras instituições de importância sistémica (%)	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
11	Requisito combinado de reservas de fundos próprios (%)	2,5%	-	2,5%	-	2,5%
EU 11a	Requisito global de fundos próprios (%)	15,5%	-	15,5%	-	15,5%
12	CET1 disponíveis após satisfação dos requisitos de fundos próprios totais SREP (%)	13,8%	-	-	-	-
Rácio de alavancagem						
13	Medida de exposição total	3 481 494	-	3 394 515	-	2 778 682
14	Rácio de alavancagem (%)	15,7%	-	15,5%	-	18,4%

Requisitos de fundos próprios adicionais para fazer face ao risco de alavancagem excessiva (em percentagem da medida de exposição total)						
EU 14a	Requisitos de fundos próprios adicionais para fazer face ao risco de alavancagem excessiva (%)	0,0%	-	-	-	-
EU 14b	do qual: a satisfazer através de fundos próprios CET1 (pontos percentuais)	0,0%	-	-	-	-
EU 14c	Requisitos totais de rácio de alavancagem SREP (%)	3,0%	-	-	-	-
Requisito de reserva para rácio de alavancagem e requisito de rácio de alavancagem global (em percentagem da medida de exposição total)						
EU 14d	Requisito de reserva para rácio de alavancagem (%)	0,0%	-	-	-	-
EU 14e	Requisito de rácio de alavancagem global (%)	3,0%	-	-	-	-
Rácio de Cobertura de Liquidez						
15	Total dos ativos líquidos de elevada qualidade (HQLA) (valor ponderado - média)	707 485	692 497	703 868	733 646	725 782
EU 16a	Saídas de caixa - Valor ponderado total	342 464	318 496	288 861	244 744	219 384
EU 16b	Entradas de caixa - Valor ponderado total	66 300	59 913	50 248	51 703	48 019
16	Total de saídas de caixa líquidas (valor ajustado)	276 164	258 583	238 612	193 041	171 365
17	Rácio de cobertura de liquidez (%)	261%	274%	321%	424%	457%
Rácio de Financiamento Estável Líquido (NSFR)						
18	Total de financiamento estável disponível	1 911 897	-	-	-	-
19	Total de financiamento estável requerido	1 062 366	-	-	-	-
20	Rácio NSFR (%)	180%	-	-	-	-

Haitong Bank - principais indicadores (EU KM1)