

DISCIPLINA DE MERCADO

(em milhares de EUR)

30.06.2022 31.03.2022 31.12.2021 30.09.2021 30.06.2021

Fundos próprios disponíveis (montantes)						
1	Fundos próprios principais de nível 1 (CET1)	434 907	-	433 264	-	438 277
2	Fundos próprios de nível 1	541 496	-	540 195	-	545 415
3	Capital total	543 559	-	542 216	-	547 712
Montantes das exposições ponderadas pelo risco						
4	Montante total das exposições	2 417 249	-	2 297 225	-	2 080 086
Rácios de fundos próprios (em percentagem do montante de exposição ponderada pelo risco)						
5	Rácio de fundos próprios principais de nível 1 (%)	18,0%	-	18,9%	-	21,1%
6	Rácio de nível 1 (%)	22,4%	-	23,5%	-	26,2%
7	Rácio de fundos próprios total (%)	22,5%	-	23,6%	-	26,3%
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 (%)	10,7%	-	11,5%	-	13,8%
Rácio de alavancagem						
13	Medida de exposição total	3 606 739	-	3 174 342	-	3 481 494
14	Rácio de alavancagem (%)	15,0%	-	17,0%	-	15,7%

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%	-	0,0%	-	0,0%
EU 14b	do qual: a satisfazer através de fundos próprios CET1 (pontos percentuais)	0,0%	-	0,0%	-	0,0%
EU 14c	Requisitos totais de rácio de alavancagem SREP (%)	3,0%	-	3,0%	-	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%	-	0,0%	-	0,0%
EU 14e	Requisito de rácio de alavancagem global (%)	3,0%	-	3,0%	-	3,0%
Rácio de Cobertura de Liquidez						
15	Total dos ativos líquidos de elevada qualidade (HQLA) (valor ponderado - média)	729 746	723 252	724 096	721 700	707 485
EU 16a	Saídas de caixa - Valor ponderado total	410 458	404 228	383 330	366 534	342 464
EU 16b	Entradas de caixa - Valor ponderado total	114 609	103 618	81 160	74 111	66 300
16	Total de saídas de caixa líquidas (valor ajustado)	295 849	300 610	302 171	292 423	276 164
17	Rácio de cobertura de liquidez (%)	270%	263%	247%	252%	261%
Rácio de Financiamento Estável Líquido (NSFR)						
18	Total de financiamento estável disponível	2 165 330	2 075 764	2 088 029	1 879 475	1 911 897
19	Total de financiamento estável requerido	1 500 187	1 498 906	1 468 677	1 102 690	1 062 366
20	Rácio NSFR (%)	144%	138%	142%	170%	180%

Haitong Bank - principais indicadores (EU KM1)