

INDICATEURS PRUDENTIELS

Tableau 9 (EU KM1)		INDICATEURS CLES (en €)	31/12/2023	30/09/2023	30/06/2023	31/03/2023	31/12/2022
			T	T-1	T-2	T-3	T-4
Fonds propres disponibles (montants)							
1	Fonds propres de base de catégorie 1 (CET1)		35 034 839	34 994 397	34 980 513	33 324 386	34 178 704
2	Fonds propres de catégorie 1		35 034 839	34 994 397	34 980 513	33 324 386	34 178 704
3	Fonds propres totaux		35 034 839	34 994 397	34 980 513	33 324 386	34 178 704
Montants d'exposition pondérés							
4	Montant total d'exposition au risque		441 881 892	447 599 898	421 790 675	419 397 123	431 401 150
Ratio de solvabilité (en % du montant d'exposition pondéré)							
5	Ratio de fonds propres de base de catégorie 1 (%)		16,26%	16,35%	16,01%	15,60%	15,11%
6	Ratio de fonds propres de catégorie 1 (%)		16,26%	16,35%	16,01%	15,60%	15,11%
7	Ratio de fonds propres totaux (%)		16,26%	16,35%	16,01%	15,60%	15,11%
Exigence de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif (en % du montant d'exposition pondéré)							
7a	Exigence de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques autres que le risque de levier excessif (%)		1,25%	1,25%	1,25%	1,25%	1,25%
7b	dont : à satisfaire avec des fonds propres CET1 (points de pourcentage)		0,70%	0,70%	0,70%	0,70%	0,70%
7c	dont : à satisfaire avec des fonds propres de catégorie 1 (points de pourcentage)		0,94%	0,94%	0,94%	0,94%	0,94%
7d	Exigence totales de fonds propres SREP (%)		9,25%	9,25%	9,25%	9,25%	9,25%
Exigence globale de coussin et exigence globale de fonds propres (en % du montant d'exposition pondéré)							
8	Coussin de conservation des fonds propres (%)		2,5%	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%
8a	Coussin de conservation découlant du risque macroprudentiel ou systémique constaté au niveau d'un Etat membre (%)						
9	Coussin de fonds propres contractuel spécifique à l'établissement (%)		0,050%	0,039%	0,000%	0,000%	0,000%
9a	Coussin pour le risque systémique (%)						
10	Coussin pour les établissements d'importance systémique mondiale (%)						
10a	Coussin pour les autres établissements d'importance systémique (%)						
11	Exigence globale de coussin (%)		2,55%	2,54%	2,50%	2,50%	2,50%
11a	Exigences globales de fonds propres (%)		11,80%	11,79%	11,75%	11,75%	11,75%
12	Fonds propres CET1 disponibles après le respect des exigences totales de fonds propres SREP (%)		8,26%	8,35%	8,01%	7,60%	7,11%
Ratio de levier							
13	Mesure de l'exposition totale		467 449 165	470 707 632	491 301 329	498 522 277	502 904 461
14	Ratio de levier (%)		7,49%	7,43%	7,12%	6,68%	6,80%
Exigence de fonds propres supplémentaires pour faire face au risque de levier excessif (en % de la mesure de l'exposition totale)							
14a	Exigence de fonds propres supplémentaires pour faire face aux risques de levier excessif (%)		0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
14b	dont : à satisfaire avec des fonds propres CET1 (points de pourcentage)		0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
14c	Exigence totales de ratio de levier globale (%)		3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
Exigence de coussin lié au ratio de levier et exigence de ratio de levier globale (en % de la mesure de l'exposition totale)							
14d	Exigence de coussin lié au ratio de levier		0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
14e	Exigence de ratio de levier globale (%)		3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
Ratio de couverture des besoins de liquidité							
15	Actifs liquides de qualité élevée (HQLA) Totaux (valeur pondérée - moyenne)		104 869 791	110 503 937	109 482 978	106 163 143	61 042 941
16a	Sorties de trésorerie - Valeur pondérée totale		24 114 434	25 786 580	25 452 110	25 767 805	30 150 340
16b	Entrées de trésorerie - Valeur pondérée totale		5 170 678	4 513 471	6 259 296	9 404 491	15 069 247
16	Sorties de trésorerie nettes totales (valeur ajustée)		18 943 755	21 273 109	19 192 814	16 363 314	15 081 093
17	Ratio de couverture des besoins de liquidité (%)		553,59%	519,45%	570,44%	648,79%	404,76%
Ratio de financement stable net							
18	Financement stable disponible total		424 888 865	430 469 961	432 183 293	430 442 732	447 269 389
19	Financement stable requis total		241 812 711	261 048 101	260 040 191	260 158 824	302 378 136
20	Ratio NSFR (%)		175,71%	164,90%	166,20%	165,45%	147,92%