

Skema EU KM1 – Skema om væsentlige målekriterier (Djurslands Bank A/S)

(mio. DKK.)

| | | a | b | c |
|--------|--|------------|-----|------------|
| | | 30-06-2023 | T-1 | 31-12-2022 |
| | Tilgængeligt kapitalgrundlag (beløb) | | | |
| 1 | Egentlig kernekapital (CET1) | 1.152 | | 1.169 |
| 2 | Kernekapital | 1.152 | | 1.169 |
| 3 | Samlet kapital | 1.291 | | 1.306 |
| | Risikovægtede eksponeringer | | | |
| 4 | Samlet risikoeksponering | 5.453 | | 5.113 |
| | Kapitalprocenter (som en procentdel af den risikovægtede eksponering) | | | |
| 5 | Egentlig kernekapitalprocent (%) | 21,13% | | 22,87% |
| 6 | Kernekapitalprocent (%) | 21,13% | | 22,87% |
| 7 | Kapitalprocent i alt (%) | 23,68% | | 25,54% |
| | Krav om yderligere kapitalgrundlag til at tage højde for andre risici end risikoen for overdreven gearing (procentdel af den risikovægtede eksponering) | | | |
| EU 7a | Krav om yderligere kapitalgrundlag til at tage højde for andre risici end risikoen for overdreven gearing (%) | 1,45% | | 1,61% |
| EU 7b | heraf: i form af egentlig kernekapital (procentpoint) | 0,82% | | 0,90% |
| EU 7c | heraf: i form af kernekapital (procentpoint) | 0,64% | | 1,20% |
| EU 7d | Samlede SREP-kapitalgrundlagskrav (%) | 9,45% | | 9,61% |
| | Kombineret bufferkrav og sammenlagt kapitalkrav (som en procentdel af den risikovægtede eksponering) | | | |
| 8 | Kapitalbevaringsbuffer (%) | 2,50% | | 2,50% |
| EU 8a | Bevaringsbuffer som følge af makroprudentiel eller systemisk risiko identificeret på medlemsstatsniveau (%) | 0,00% | | 0,00% |
| 9 | Institutspecifik kontracyklisk kapitalbuffer (%) | 2,50% | | 2,00% |
| EU 9a | Systemisk risikobuffer (%) | 0,00% | | 0,00% |
| 10 | Buffer for globale systemisk vigtige institutter (%) | 0,00% | | 0,00% |
| EU 10a | Buffer for andre systemisk vigtige institutter (%) | 0,00% | | 0,00% |
| 11 | Kombineret bufferkrav (%) | 5,00% | | 4,50% |
| EU 11a | Sammenlagte kapitalkrav (%) | 14,45% | | 14,11% |
| 12 | Tilgængelig egentlig kernekapital efter opfyldelse af samlede SREP- | 11,68% | | 13,26% |
| | Gearingsgrad | | | |
| 13 | Samlet eksponeringsmål | 12.087 | | 11.560 |
| 14 | Gearingsgrad (%) | 9,53% | | 10,12% |
| | Krav om yderligere kapitalgrundlag til at tage højde for risikoen for overdreven gearing (som en procentdel af den risikovægtede eksponering) | | | |
| EU 14a | Krav om yderligere kapitalgrundlag til at tage højde for risikoen for overdreven gearing (%) | 0,00% | | 0,00% |
| EU 14b | heraf: i form af egentlig kernekapital (procentpoint) | 0,00% | | 0,00% |
| EU 14c | Samlede SREP-gearingsgradkrav (%) | 4,50% | | 4,50% |
| | Gearingsgradbuffer og sammenlagt gearingsgradkrav (som en procentdel af det samlede eksponeringsmål) | | | |
| EU 14d | Krav vedrørende gearingsgradbuffer (%) | 0,00% | | 0,00% |
| EU 14e | Sammenlagt gearingsgradkrav (%) | 4,50% | | 4,50% |
| | Likviditetsdækningsgrad | | | |
| 15 | Likvide aktiver af høj kvalitet (HQLA) i alt (vægtet værdi — gennemsnit) | 4.903 | | 4.154 |
| EU 16a | Udgående pengestrømme — Samlet vægtet værdi | 1.080 | | 1.110 |
| EU 16b | Indgående pengestrømme — Samlet vægtet værdi | 153 | | 109 |
| 16 | Nettopengestrømme i alt (justeret værdi) | 928 | | 1.002 |
| 17 | Likviditetsdækningsgrad (%) | 528,47% | | 414,75% |
| | Net stable funding ratio | | | |
| 18 | Tilgængelig stabil finansiering i alt | 11.549 | | 11.436 |
| 19 | Krævet stabil finansiering i alt | 7.540 | | 8.026 |
| 20 | NSFR (%) | 153,18% | | 142,50% |