

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES

A los efectos de dar cumplimiento al artículo 227 del texto refundido de la Ley del Mercado de Valores aprobado por el Real Decreto Legislativo 4/2015, de 23 de octubre, Banco de Sabadell, S.A. (Banco Sabadell), pone en conocimiento de la Comisión Nacional del Mercado de Valores la siguiente

OTRA INFORMACIÓN RELEVANTE

Banco Sabadell ha participado en el ejercicio de resistencia sobre el sector bancario europeo (EU-wide stress test) del año 2021 llevado a cabo por la Autoridad Bancaria Europea (EBA, por sus siglas en inglés), en colaboración con Banco de España, el Banco Central Europeo (BCE) y la Junta Europea de Riesgo Sistémico (JERS).

El ejercicio toma en consideración datos con fecha de referencia 31 de diciembre de 2020 y abarca un periodo de proyecciones de tres años (2021 – 2023) bajo dos escenarios, base y adverso. El ejercicio de resistencia no contiene un nivel mínimo a superar (aprobado/suspenso) sino que está diseñado para ser una fuente de información a efectos del proceso supervisor de las entidades. Los resultados permiten a las autoridades supervisoras evaluar la capacidad de Banco Sabadell para cumplir con los requisitos mínimos de capital bajo condiciones de crisis económica.

El ejercicio de resistencia se ha llevado a cabo bajo una metodología de balance estático (diciembre 2020), y por tanto no toma en consideración estrategias de negocio futuras ni acciones de gestión. No constituye una proyección de los resultados de Banco Sabadell.

Banco Sabadell ha obtenido los siguientes resultados en el ejercicio:

En el escenario base la ratio CET 1 regulatoria (Phase In) a 31 de diciembre de 2023 incrementa 34 puntos básicos, hasta el 12,91%, desde el nivel de salida de 12,57%. En este mismo escenario, la ratio CET 1 Fully Loaded a 31 de diciembre de 2023 incrementa 72 puntos básicos, hasta el 12,75%, desde el nivel de salida de 12,02%.

En el escenario adverso la ratio CET 1 regulatoria (Phase In) a 31 de diciembre de 2023 desciende 550 puntos básicos, hasta el 7,07% al tiempo que la ratio CET 1 Fully Loaded a 31 de diciembre de 2023 desciende en 548 puntos básicos, hasta el 6,54%.



A cierre de junio 2021 Banco Sabadell presenta una ratio CET 1 Fully Loaded del 12,00% y una ratio regulatoria (Phase In) del 12,31%, con un colchón sobre los requerimientos regulatorios (MDA buffer, por su denominación en inglés) de 379 puntos básicos.

Para más información sobre el ejercicio de resistencia consultar el sitio web de la EBA (www.eba.europa.eu)

Gonzalo Baretino Coloma
Secretario General

Barcelona, 30 de julio de 2021