

COMISIÓN NACIONAL DEL MERCADO DE VALORES

A los efectos de dar cumplimiento al artículo 227 de la Ley 6/2023, de 17 de marzo, de los Mercados de Valores y de los Servicios de Inversión, Banco de Sabadell, S.A. (Banco Sabadell), pone en conocimiento de la Comisión Nacional del Mercado de Valores (CNMV) 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 2023 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 2022 y abarca un periodo de proyecciones de tres años (2023 – 2025) 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 2022), 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.

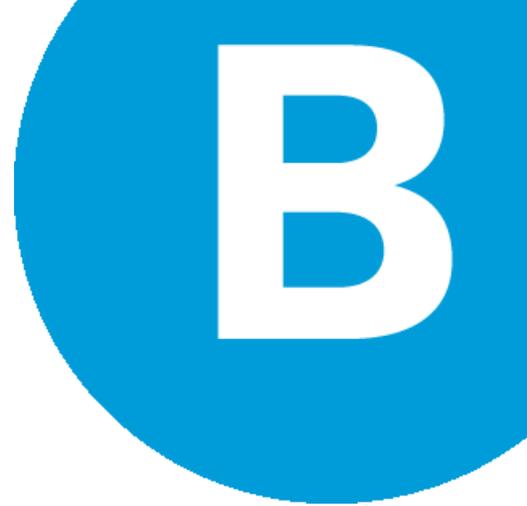
Banco Sabadell ha obtenido los siguientes resultados en el ejercicio:

- En el escenario base la ratio CET 1 (Fully Loaded) a 31 de diciembre de 2025 incrementa 254 puntos básicos, hasta el 15,09%, desde el nivel de salida de 12,55%.
- En el escenario adverso la ratio CET 1 regulatoria (Fully Loaded) a 31 de diciembre de 2025 desciende 374 puntos básicos, hasta el 8,81%.

A cierre de junio 2023 Banco Sabadell presenta una ratio CET 1 Fully Loaded del 12,87% y una ratio regulatoria (Phase In) del 12,88%, con un colchón sobre los requerimientos regulatorios (MDA buffer, por su denominación en inglés) de 422 puntos básicos.

Ad-hoc data collection de carteras de bonos a coste amortizado y posiciones a valor razonable con cambios en otro resultado global

El banco participó en el proceso *ad-hoc data collection* de carteras de bonos a coste amortizado y posiciones a valor razonable con cambios en otro resultado global. Los resultados de este



ejercicio, tal y como establece la EBA no deben añadirse a los resultados del test de estrés. La siguiente tabla muestra el valor contable y el valor razonable de los bonos a coste amortizado publicados por la EBA y no tienen en consideración el valor positivo de los instrumentos de cobertura. El impacto, antes de impuestos, de acuerdo a estos valores sería de una pérdida de €1.945M, sin embargo, considerando los mencionados instrumentos de cobertura se reduciría a €1.064M (€745M netos de impuestos y c.95pbs de CET1).

feb-23 (euros millones)						
	Valor contable instrumentos de deuda	Valor razonable instrumentos de deuda	Ajustes positivo coberturas	Pérdidas brutas	Pérdidas netas de impuestos	Impacto CET1
Total	21.799	19.854	881	1.064	745	95pbs

Para más información, consultar el sitio web de EBA (www.eba.europa.eu).

Gonzalo Baretino Coloma
Secretario General

Alicante, a 28 de julio de 2023