

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisker

31 december 2023

Vator Securities AB

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisk

I enlighet med Europaparlamentets och Rådets förordning (EU) 2019/2033 ("IFR") offentliggör Vator Securities AB ("Vator"), samt dess konsoliderade situation ("Gruppen") periodisk information om kapitaltäckning. Den konsoliderade situationen utgörs av Vator Securities AB samt dess moderbolag Supercluster AB, org.nr. 559111-5893, som moderbolag. Eftersom moderbolaget inte bedriver någon verksamhet utöver att äga aktier i Vator Securities AB samt förvalta de likvida medel som finns i moderbolaget så är det Vators verksamhet som i princip uteslutande driver riskerna i den konsoliderade situationen.

Uppgifterna offentliggörs i samband med årsredovisningen och finns tillgängliga på Vators hemsida www.vatorsecurities.se.

Kapitalkrav beräknas i enlighet med Europaparlamentets och Rådets förordning (EU) 2019/2033 ("IFR"). Kapitalkravet för Vator skall vara det högsta av det permanenta minimumkapitalet, kapitalkravet baserat på K-faktorer och kapitalkravet baserat på fasta kostnader.

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities AB

Kapitalbas	2023-12-31	2023-09-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	2 148 997 kr	2 148 997 kr
Aktiekapital	146 532 kr	146 532 kr
Överkursfond	2 002 465 kr	2 002 465 kr
Ej utdelade vinstmedel	30 722 331 kr	30 722 331 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	- kr
Obeskattade och andra reserver	- kr	- kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	- kr	- kr
Delårsresultat	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	32 871 328 kr	32 871 328 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar		
(-) Goodwill	- kr	- kr
Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder) (negativt belopp)	- kr	- kr
Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet	- kr	- kr
Förluster för innevarande räkneskapsår	0 kr	-12 245 363 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr
Justeringar på grund av föreslagen utdelning	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	0 kr	-12 245 363 kr
Kärnprimärkapital	32 871 328 kr	20 625 965 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr
Primärkapital	32 871 328 kr	20 625 965 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	32 871 328 kr	20 625 965 kr

K-faktor belopp	2023-12-31	2023-09-30
Kundrisk (RtC)	32 972 497 kr	32 597 834 kr
AUM		
CMH	32 972 497 kr	32 597 834 kr
ASA		
COH	- kr	- kr
Marknadsrisk (RtM)	- kr	0 kr
NPR	- kr	- kr
CMG		
Företagsrisk (RtF)	- kr	0 kr
DTF	- kr	- kr
TCD	- kr	- kr
CON	- kr	- kr
K-faktor kapitalkrav	2023-12-31	2023-09-30
Kundrisk (RtC)	131 890 kr	130 391 kr
K-AUM		
K-CMH	131 890 kr	130 391 kr
K-ASA	- kr	- kr
K-COH	- kr	- kr
Marknadsrisk (RtM)	- kr	0 kr
K-NPR	- kr	- kr
K-CMG		
Företagsrisk (RtF)	- kr	0 kr
K-DTF	- kr	- kr
K-TCD	- kr	- kr
K-CON	- kr	- kr
Totalt K-faktor kapitalkrav	131 890 kr	130 391 kr
Fasta omkostnader kapitalkrav	2023-12-31	2023-09-30
Föregående års fasta omkostnader	56 466 345 kr	56 466 345 kr
Kapitalkrav baserat på fasta omkostnader	14 116 586 kr	14 116 586 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2023-12-31	2023-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr
Kapitalrelationer och buffertar		
	2023-12-31	2023-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	233%	146%
Primärkapitalrelation	233%	146%
Total kapitalrelation	233%	146%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	228%	142%
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	14 116 586 kr	14 116 586 kr
Överskottskapital (CET1)	18 754 742 kr	6 509 379 kr
Överkottskapital (Totalt)	18 754 742 kr	6 509 379 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities AB

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:21) 5 kap. 9 § om hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag offentliggör Vator Securities AB samt dess konsoliderade situation nedan kvartalsvis periodisk information om sina likviditetspositioner.

Likviditetsrisk

Likviditetsrisk	2023-12-31	2023-09-30
Likviditetskrav	4 705 529 kr	4 705 529 kr
Likviditetsreserv	8 419 950 kr	17 573 535 kr
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	8 419 950 kr	17 573 535 kr

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities, konsoliderad situation

Kapitalbas	2023-12-31	2023-09-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	50 000 kr	50 000 kr
Aktiekapital	50 000 kr	50 000 kr
Överkursfond	- kr	- kr
Ej utdelade vinstmedel	25 231 805 kr	27 403 112 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	- kr
Obeskattade och andra reserver	- kr	- kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	7 617 487 kr	10 170 440 kr
Delårsresultat	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	32 899 292 kr	37 623 552 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar		
(-) Goodwill	- kr	- kr
Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder) (negativt belopp)	- kr	- kr
Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet	- kr	- kr
Förluster för innevarande räkneskapsår	0 kr	-12 353 461 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr
Justeringar på grund av föreslagen utdelning	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	0 kr	-12 353 461 kr
Kärnprimärkapital	32 899 292 kr	25 270 091 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr
Primärkapital	32 899 292 kr	25 270 091 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	32 899 292 kr	25 270 091 kr

K-faktor belopp	2023-12-31	2023-09-30
Kundrisk (RtC)	32 972 497 kr	32 597 834 kr
AUM		
CMH	32 972 497 kr	32 597 834 kr
ASA		
COH	- kr	- kr
Marknadsrisk (RtM)	- kr	0 kr
NPR	- kr	- kr
CMG		
Företagsrisk (RtF)	- kr	0 kr
DTF	- kr	- kr
TCD	- kr	- kr
CON	- kr	- kr
K-faktor kapitalkrav	2023-12-31	2023-09-30
Kundrisk (RtC)	131 890 kr	130 391 kr
K-AUM		
K-CMH	131 890 kr	130 391 kr
K-ASA	- kr	- kr
K-COH	- kr	- kr
Marknadsrisk (RtM)	- kr	0 kr
K-NPR	- kr	- kr
K-CMG		
Företagsrisk (RtF)	- kr	0 kr
K-DTF	- kr	- kr
K-TCD	- kr	- kr
K-CON	- kr	- kr
Totalt K-faktor kapitalkrav	131 890 kr	130 391 kr
Fasta omkostnader kapitalkrav	2023-12-31	2023-09-30
Föregående års fasta omkostnader	57 708 556 kr	57 708 556 kr
Kapitalkrav baserat på fasta omkostnader	14 427 139 kr	14 427 139 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)	2023-12-31	2023-09-30
Permanent minimikapitalkrav	7 697 475 kr	7 697 475 kr
Kapitalkrav baserat på Fasta omkostnader	14 427 139 kr	14 427 139 kr
K-faktorkrav	131 890 kr	130 391 kr
Totalt kapitalkrav	14 427 139 kr	14 427 139 kr
Tillkommande Pelare 2-krav	2023-12-31	2023-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr
Kapitalrelationer och buffertar	2023-12-31	2023-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	228%	175%
Primärkapitalrelation	228%	175%
Total kapitalrelation	228%	175%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	224%	171%
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	14 427 139 kr	14 427 139 kr
Överskottskapital (CET1)	18 472 153 kr	10 842 952 kr
Överkottskapital (Totalt)	18 472 153 kr	10 842 952 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities, konsoliderad situation

Likviditetsrisk

Likviditetsrisk	2023-12-31	2023-09-30
Likviditetskrav	4 809 046 kr	4 809 046 kr
Likviditetsreserv	12 509 445 kr	21 198 044 kr
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	12 509 445 kr	21 198 044 kr