

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisker

31 december 2024

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	2024-12-31	2024-09-30
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	32 828 802 kr	32 828 802 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	- kr
Obeskattade och andra reserver	- kr	- kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	- kr	- kr
Delårsresultat		
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	34 977 799 kr	34 977 799 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	-9 330 666 kr	-16 827 413 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr
<i>Justeringar på grund av föreslagen utdelning</i>	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-9 330 666 kr	-16 827 413 kr
Kärnprimärkapital	25 647 133 kr	18 150 386 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr
Primärkapital	25 647 133 kr	18 150 386 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	25 647 133 kr	18 150 386 kr

K-faktor belopp	2024-12-31	2024-09-30
Kundrisk (RtC)	40 957 017 kr	42 666 046 kr
AUM		
CMH	40 957 017 kr	42 666 046 kr
ASA	- kr	
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	2024-12-31	2024-09-30
Kundrisk (RtC)	163 828 kr	170 664 kr
K-AUM		
K-CMH	163 828 kr	170 664 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	163 828 kr	170 664 kr
Fasta omkostnader kapitalkrav	2024-12-31	2024-09-30
Föregående års fasta omkostnader	59 352 683 kr	59 352 683 kr
Kapitalkrav baserat på fasta omkostnader	14 838 171 kr	14 838 171 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)		2024-12-31	2024-09-30
Permanent minimikapitalkrav		7 697 475 kr	7 697 475 kr
Kapitalkrav baserat på Fasta omkostnader		14 838 171 kr	14 838 171 kr
K-faktorkrav		163 828 kr	170 664 kr
Totalt kapitalkrav		14 838 171 kr	14 838 171 kr
Tillkommande Pelare 2-krav		2024-12-31	2024-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav		- kr	- kr
Kapitalrelationer och buffertar		2024-12-31	2024-09-30
Kärnprimärkapitalrelation		173%	122,32%
Primärkapitalrelation		173%	122,32%
Total kapitalrelation		173%	122,32%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert		168%	117,82%
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav		14 838 171 kr	14 838 171 kr
Överskottskapital (CET1)		10 808 962 kr	3 312 215 kr
Överkottskapital (Totalt)		10 808 962 kr	3 312 215 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	2024-12-31	2024-09-30
Likviditetskrav	4 946 057 kr	4 946 057 kr
Likviditetsreserv	7 789 637 kr	15 699 446 kr
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	7 789 637 kr	15 699 446 kr

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities, konsoliderad situation

Kapitalbas	2024-12-31	2024-09-30
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	27 244 981 kr	28 244 981 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	- kr
Obeskattade och andra reserver	- kr	- kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	10 023 893 kr	12 916 138 kr
Delårsresultat		
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	37 318 874 kr	41 211 119 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	-8 792 890 kr	-16 558 682 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr
<i>Justeringar på grund av föreslagen utdelning</i>	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-8 792 890 kr	-16 558 682 kr
Kärnprimärkapital	28 525 984 kr	24 652 437 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr
Primärkapital	28 525 984 kr	24 652 437 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	28 525 984 kr	24 652 437 kr

K-faktor belopp	2024-12-31	2024-09-30
Kundrisk (RtC)	40 957 017 kr	42 666 046 kr
AUM		
CMH	40 957 017 kr	42 666 046 kr
ASA	- kr	
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	2024-12-31	2024-09-30
Kundrisk (RtC)	163 828 kr	170 664 kr
K-AUM		
K-CMH	163 828 kr	170 664 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	163 828 kr	170 664 kr
Fasta omkostnader kapitalkrav	2024-12-31	2024-09-30
Föregående års fasta omkostnader	59 413 684 kr	59 413 684 kr
Kapitalkrav baserat på fasta omkostnader	14 853 421 kr	14 853 421 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)		2024-12-31	2024-09-30
Permanent minimikapitalkrav		7 697 475 kr	7 697 475 kr
Kapitalkrav baserat på Fasta omkostnader		14 853 421 kr	14 853 421 kr
K-faktorkrav		163 828 kr	170 664 kr
Totalt kapitalkrav		14 853 421 kr	14 853 421 kr
Tillkommande Pelare 2-krav		2024-12-31	2024-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav		- kr	- kr
Kapitalrelationer och buffertar		2024-12-31	2024-09-30
Kärnprimärkapitalrelation		192%	165,97%
Primärkapitalrelation		192%	165,97%
Total kapitalrelation		192%	165,97%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert		188%	161,47%
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav		14 853 421 kr	14 853 421 kr
Överskottskapital (CET1)		13 672 563 kr	9 799 016 kr
Överkottskapital (Totalt)		13 672 563 kr	9 799 016 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities, konsoliderad situation

Likviditetsrisk

Likviditetsrisk	2024-12-31	2024-09-30
Likviditetskrav	4 951 140 kr	4 951 140 kr
Likviditetsreserv	10 466 724 kr	19 403 557 kr
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	10 466 724 kr	19 403 557 kr