

Offentliggörande av information angående kapitaltäckning och likviditet

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:12) om offentliggörande av kapitaltäckning offentliggör Vator Securities AB (556795-7260) periodisk information om kapitaltäckning. Uppgifterna offentliggörs i samband med kvartalsrapportering och finns tillgänglig på Bolagets hemsida <http://www.vatorsecurities.se/>

Kapitalkrav beräknas i enlighet med Europaparlamentets och Rådets förordning (EU) 575/2013 ("CRR"), lagen om kapitalbuffertar (2014:966), lagen om införande av lagen om kapitalbuffertar (2014:967) och Finansinspektionens föreskrifter om tillsyns krav och kapitalbuffertar (FFFS 2014:12).

Beräkning av kapitalkravet nedan ska bestå av lagstadgat minimikapitalkrav för kreditrisker, marknadsrisker och operativa risker. Kapitalbehovet för kapitalbuffertar redogörs också för nedan under kapitalrelationer och kapitalbuffertar.

Vid beräkning av kapitalkravet för operativ risk använder sig Vator Securities AB av fasta omkostnader. I metoden fasta omkostnader beräknas det totala riskvägda exponeringsbeloppet genom att multiplicera föregående års fasta omkostnader med 25% samt 12,5. Det totala riskvägda exponeringsbeloppet multipliceras sedan med 8 procent för att få fram minimikapitalkravet för kreditrisker.

Vator Securities AB - Uppgifter per 2019-03-31

Individual

Kapitalbas	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	114 944 kr	2 656 664 kr	100 000 kr	100 000 kr
Aktiekapital	114 944 kr	114 944 kr	100 000 kr	100 000 kr
Överkursfond	- kr	2 541 720 kr	- kr	0 kr
Ej utdelade vinstmedel	13 479 699 kr	13 316 957 kr	13 317 157 kr	13 317 157 kr
Accumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	1 300 000 kr	1 300 000 kr	1 300 000 kr	1 300 000 kr
Delårsresultat som har verifierats av personer som har en oberoende ställning	- kr	- kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	14 894 643 kr	17 273 621 kr	14 717 157 kr	14 717 157 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar				
(-) Goodwill	-327 172 kr	-467 389 kr	-607 606 kr	-747 657 kr
Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder) (nr)	- kr	- kr	- kr	0 kr
Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet	- kr	- kr	- kr	0 kr
Förluster för innevarande räkenskapsår	0 kr	0 kr	0 kr	0 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr	- kr	0 kr
Justeringar på grund av föreslagna utdelning	- kr	- kr	- kr	0 kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-327 172 kr	-467 389 kr	-607 606 kr	-747 657 kr
Kärnprimärkapital	14 567 471 kr	16 806 232 kr	14 109 551 kr	13 969 500 kr
Primärkapital	0 kr	0 kr	2 556 464 kr	1 251 064 kr
Aktiekapital	0 kr	0 kr	14 944 kr	6 384 kr
Överkursfond	0 kr	0 kr	2 541 520 kr	1 244 680 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättning				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital = primärkapital + supplementärkapital)	14 567 471 kr	16 806 232 kr	16 666 015 kr	15 220 564 kr
Totala riskvägda tillgångar	95 674 000 kr	65 880 934 kr	65 880 934 kr	65 880 934 kr
Kapitalrelationer och buffertar				
Kärnprimärkapital	15,23%	25,51%	21,42%	21,20%
Primärkapital	15,23%	25,51%	21,42%	21,20%
Totalt kapital	15,23%	25,51%	25,30%	23,10%
Institutspecifika buffertkrav	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	-	-	-	-
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	10,73%	21,01%	16,92%	16,70%

Exponeringsbelopp	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Kredit- och motpartsrisk	31 826 205 kr	43 043 778 kr	34 468 157 kr	35 639 820 kr
Nationella Regeringar	1 328 kr	1 331 kr	1 331 kr	521 590 kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institut	26 823 087 kr	38 856 792 kr	33 255 316 kr	22 722 684 kr
Företag	- kr	- kr	- kr	- kr
Hushåll	- kr	- kr	- kr	- kr
Aktieexponeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Företag för kollektiva investeringar (fond)	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	5 001 790 kr	4 185 655 kr	1 211 510 kr	12 395 546 kr
Marknadsrisk	0 kr	0 kr	0 kr	0 kr
Operativ risk	0 kr	0 kr	0 kr	0 kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	31 826 205 kr	43 043 778 kr	34 468 157 kr	35 639 820 kr

Riskvägda exponeringsbelopp	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Kredit- och motpartsrisk	10 366 407 kr	11 957 013 kr	7 862 573 kr	16 940 083 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	5 364 617 kr	7 771 358 kr	6 651 063 kr	4 544 537 kr
Företag	- kr	- kr	- kr	- kr
Hushåll	- kr	- kr	- kr	- kr
Aktieexponeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Företag för kollektiva investeringar (fond)	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	5 001 790 kr	4 185 655 kr	1 211 510 kr	12 395 546 kr
Marknadsrisk	0 kr	0 kr	0 kr	0 kr
Operativ risk	0 kr	0 kr	0 kr	0 kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	10 366 407 kr	11 957 013 kr	7 862 573 kr	16 940 083 kr

Fasta omkostnader	30 615 680 kr	21 081 899 kr	21 081 899 kr	21 081 899 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 653 920 kr	5 270 475 kr	5 270 475 kr	5 270 475 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	95 674 000 kr	65 880 934 kr	65 880 934 kr	65 880 934 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	95 674 000 kr	65 880 934 kr	65 880 934 kr	65 880 934 kr
Kredit- och motpartsrisk	829 313 kr	956 561 kr	629 006 kr	1 355 207 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	6 824 607 kr	4 313 914 kr	4 641 469 kr	3 915 268 kr
Totalt kapitalkrav	7 653 920 kr	5 270 475 kr	5 270 475 kr	5 270 475 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Kreditrisk och motpartsrisk	829 313 kr	956 561 kr	629 006 kr	1 355 207 kr
Marknadsrisk	0 kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	0 kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	6 824 607 kr	4 313 914 kr	4 641 469 kr	3 915 268 kr
Totalt	7 653 920 kr	5 270 475 kr	5 270 475 kr	5 270 475 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr	- kr	- kr

Kapitalrelationer och buffertar	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Kärnprimärkapitalrelation	15,23%	25,51%	21,42%	21,20%
Primärkapitalrelation	15,23%	25,51%	25,30%	23,10%
Total kapitalrelation	15,23%	25,51%	25,30%	23,10%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 391 850 kr	1 647 023 kr	1 647 023 kr	1 647 023 kr
Kontracyklisk buffert (2%)	- kr	- kr	- kr	- kr
Kombinerat buffertkrav	2 391 850 kr	1 647 023 kr	1 647 023 kr	1 647 023 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 045 770 kr	6 917 498 kr	6 917 498 kr	6 917 498 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2-krav	10 045 770 kr	6 917 498 kr	6 917 498 kr	6 917 498 kr
Överskottskapital (CET1)	10 262 141 kr	13 841 590 kr	11 144 909 kr	11 004 858 kr
Överskottskapital (Totalt)	4 521 701 kr	9 888 734 kr	9 748 517 kr	8 303 066 kr

Offentliggörande av information angående likviditetstäckning

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 (Individual) kvartalsvis periodisk information om sina likviditetspositioner. Uppgifterna offentliggörs i samband med kvartalsrapportering och finns tillgänglig på Bolagets hemsida <http://www.vatorsecurities.se/>

Likviditet	2019-03-31	2018-12-31	2018-09-30	2018-06-30
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	26 823 087 kr	38 856 792 kr	33 255 316 kr	22 722 684 kr
Finansiering				
Eget kapital	22 087 890 kr	28 944 332 kr	30 066 730 kr	29 587 266 kr
Skulder	10 065 487 kr	14 559 160 kr	5 009 033 kr	6 800 211 kr
Balansomslutning	32 153 377 kr	43 503 492 kr	35 075 763 kr	36 387 477 kr
Nyckeltal				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	83%	89%	95%	62%
Eget kapital / Balansomslutning	69%	67%	86%	81%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	266%	267%	664%	334%
Bruttosoliditet	46%	39%	48%	43%

