

**Periodisk information
om kapitaltäckning och likviditetsrisker
– Pelare 3**

30 juni 2020

Vator Securities AB

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisk

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:12) om offentliggörande av kapitaltäckning 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 kvartalsrapportering till Finansinspektionen och finns tillgänglig på Vators hemsida 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 tillsynskrav och kapitalbuffertar (FFFS 2014:12). Beräkning av kapitalkravet nedan ska bestå av lagstadgat minimikapitalkrav för kreditrisker, marknadsrisker och operativa risker. Kapitalbehovet för kapitalbuffertar redogörs även för nedan under kapitalrelationer och kapitalbuffertar. Buffertkravet för Vator utgörs av en kapitalkonserveringsbuffert som uppgår till 2,5 procent av riskvägda tillgångar.

Vid beräkning av kapitalkravet för operativ risk använder sig Vator 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.

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities AB

Kapitalbas	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	131 869 kr	131 869 kr	131 869 kr	1 034 093 kr
Aktiekapital	131 869 kr	131 869 kr	131 869 kr	123 259 kr
Överkursfond	- kr	- kr	- kr	910 834 kr
Ej utdelade vinstmedel	12 675 326 kr	26 631 482 kr	12 702 716 kr	12 734 059 kr
Ackumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	1 021 800 kr	1 021 800 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	13 828 995 kr	27 785 151 kr	14 134 585 kr	15 068 152 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar				
(-) Goodwill	- kr	- kr	- kr	46 739 kr
Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder)	- kr	- kr	- kr	- kr
Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet	- kr	- kr	- kr	- kr
Förluster för innevarande räkneskapsår	0 kr	-6 174 601 kr	0 kr	0 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr	- kr	- kr
<i>Justeringar på grund av föreslagen utdelning</i>	- kr	- kr	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	0 kr	-6 174 601 kr	0 kr	-46 739 kr
Kärnprimärkapital	13 828 995 kr	21 610 550 kr	14 134 585 kr	15 021 413 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	13 828 995 kr	21 610 550 kr	14 134 585 kr	15 021 413 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	13 828 995 kr	21 610 550 kr	14 134 585 kr	15 021 413 kr
Totala riskvägda tillgångar	98 461 578 kr	98 461 578 kr	95 674 000 kr	95 674 000 kr

Exponeringsbelopp	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kredit- och motpartsrisk	32 094 232 kr	32 324 641 kr	41 598 395 kr	41 088 454 kr
Nationella Regeringar	10 937 kr	20 537 kr	2 527 kr	81 kr
Institut	29 922 939 kr	29 283 096 kr	38 280 610 kr	39 636 888 kr
Övrigt	2 160 356 kr	3 021 008 kr	3 315 258 kr	1 451 485 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	32 094 232 kr	32 324 641 kr	41 598 395 kr	41 088 454 kr
Riskvägda exponeringsbelopp	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kredit- och motpartsrisk	8 144 944 kr	8 877 627 kr	10 971 380 kr	9 378 863 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	5 984 588 kr	5 856 619 kr	7 656 122 kr	7 927 378 kr
Övrigt	2 160 356 kr	3 021 008 kr	3 315 258 kr	1 451 485 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	8 144 944 kr	8 877 627 kr	10 971 380 kr	9 378 863 kr
Fasta omkostnader	31 507 705 kr	31 507 705 kr	30 615 680 kr	30 615 680 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 653 920 kr	7 653 920 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	98 461 578 kr	98 461 578 kr	95 674 000 kr	95 674 000 kr
Kapitalkrav (Pelare 1)	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	98 461 578 kr	98 461 578 kr	95 674 000 kr	95 674 000 kr
Kredit- och motpartsrisk	651 596 kr	710 210 kr	877 710 kr	750 309 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	7 225 331 kr	7 166 716 kr	6 776 210 kr	6 903 611 kr
Totalt kapitalkrav	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 653 920 kr	7 653 920 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kreditrisk och motpartsrisk	651 596 kr	710 210 kr	877 710 kr	750 309 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	7 225 330 kr	7 166 716 kr	6 776 210 kr	6 903 611 kr
Totalt	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 653 920 kr	7 653 920 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr	- kr	- kr

Kapitalrelationer och buffertar	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	14,05%	21,95%	14,77%	15,70%
Primärkapitalrelation	14,05%	21,95%	14,77%	15,70%
Total kapitalrelation	14,05%	21,95%	14,77%	15,70%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	9,55%	17,45%	10,27%	11,20%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 461 539 kr	2 461 539 kr	2 391 850 kr	2 391 850 kr
<i>Kontracyklisk buffert (2%)</i>	<i>- kr</i>	<i>- kr</i>	<i>- kr</i>	<i>- kr</i>
<i>Kombinerat buffertkrav</i>	<i>2 461 539 kr</i>	<i>2 461 539 kr</i>	<i>2 391 850 kr</i>	<i>2 391 850 kr</i>
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 338 466 kr	10 338 466 kr	10 045 770 kr	10 045 770 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	10 338 466 kr	10 338 466 kr	10 045 770 kr	10 045 770 kr
Överskottskapital (CET1)	9 398 224 kr	17 179 779 kr	9 829 255 kr	10 716 083 kr
Överkottskapital (Totalt)	3 490 529 kr	11 272 084 kr	4 088 815 kr	4 975 643 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.

Likviditet	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	29 922 939 kr	29 283 096 kr	38 280 610 kr	39 636 888 kr
Finansiering				
Eget kapital	20 349 583 kr	21 888 750 kr	28 063 352 kr	33 990 396 kr
Skulder	11 744 649 kr	10 540 663 kr	13 534 805 kr	7 246 385 kr
Balansomslutning	32 094 232 kr	32 429 413 kr	41 598 157 kr	41 236 781 kr
Nyckeltal	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	93%	90%	92%	96%
Eget kapital / Balansomslutning	63%	67%	67%	82%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	609%	790%	283%	547%
Bruttosoliditet	107%	67%	34%	37%

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities, konsoliderad situation

Kapitalbas	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr	637 473 kr
Aktiekapital	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr
Överkursfond	- kr	- kr	- kr	587 473 kr
Ej utdelade vinstmedel	21 001 666 kr	21 001 666 kr	12 498 087 kr	12 031 315 kr
Ackumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	697 373 kr	697 373 kr	887 243 kr	- kr
Delårsresultat som har verifierats av personer som har en oberoende ställning	- kr	- kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	21 749 039 kr	21 749 039 kr	13 435 330 kr	12 668 788 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar				
(-) Goodwill	- kr	- kr	- kr	30 146 kr
Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder)	- kr	- kr	- kr	- kr
Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet	- kr	- kr	- kr	- kr
Förluster för innevarande räkneskapsår	0 kr	4 276 927 kr	- kr	- kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr	- kr	- kr
<i>Justeringar på grund av föreslagen utdelning</i>	- kr	- kr	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	0 kr	4 276 927 kr	0 kr	-30 146 kr
Kärnprimärkapital	21 749 039 kr	17 472 112 kr	13 435 330 kr	12 638 642 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	21 749 039 kr	17 472 112 kr	13 435 330 kr	12 638 642 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	21 749 039 kr	17 472 112 kr	13 435 330 kr	12 638 642 kr
Totala riskvägda tillgångar	98 907 006 kr	98 907 006 kr	95 674 000 kr	95 674 000 kr

Exponeringsbelopp	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kredit- och motpartsrisk	34 153 814 kr	25 899 526 kr	32 250 466 kr	30 370 817 kr
Nationella Regeringar	7 464 kr	14 016 kr	1 725 kr	52 kr
Institut	31 935 887 kr	22 587 657 kr	28 751 097 kr	28 199 580 kr
Övrigt	2 210 463 kr	3 297 853 kr	3 497 644 kr	2 171 185 kr
Marknadsrisk		- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	34 153 814 kr	25 899 526 kr	32 250 466 kr	30 370 817 kr
Riskvägda exponeringsbelopp	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kredit- och motpartsrisk	8 597 640 kr	7 815 384 kr	9 247 863 kr	7 811 101 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	6 387 177 kr	4 517 531 kr	5 750 219 kr	5 639 916 kr
Övrigt	2 210 463 kr	3 297 853 kr	3 497 644 kr	2 171 185 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	8 597 640 kr	7 815 384 kr	9 247 863 kr	7 811 101 kr
Fasta omkostnader	31 650 242 kr	31 650 242 kr	30 615 680 kr	30 615 680 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 653 920 kr	7 653 920 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	98 907 006 kr	98 907 006 kr	95 674 000 kr	95 674 000 kr
Kapitalkrav (Pelare 1)	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	98 907 006 kr	98 907 006 kr	95 674 000 kr	95 674 000 kr
Kredit- och motpartsrisk	687 811 kr	625 231 kr	739 829 kr	624 888 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	7 224 749 kr	7 287 330 kr	6 914 091 kr	7 029 032 kr
Totalt kapitalkrav	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 653 920 kr	7 653 920 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kreditrisk och motpartsrisk	687 811 kr	625 231 kr	739 829 kr	624 888 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Övrigt	7 224 750 kr	7 287 330 kr	6 914 091 kr	7 029 032 kr
Totalt	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 653 920 kr	7 653 920 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr	- kr	- kr

Kapitalrelationer och buffertar	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	21,99%	17,67%	14,04%	13,21%
Primärkapitalrelation	21,99%	17,67%	14,04%	13,21%
Total kapitalrelation	21,99%	17,67%	14,04%	13,21%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	17,49%	13,17%	9,54%	8,71%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 472 675 kr	2 472 675 kr	2 391 850 kr	2 391 850 kr
Kontracyklisk buffert (2%)	- kr	- kr	- kr	- kr
Kombinerat buffertkrav	2 472 675 kr	2 472 675 kr	2 391 850 kr	2 391 850 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 385 236 kr	10 385 236 kr	10 045 770 kr	10 045 770 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	10 385 236 kr	10 385 236 kr	10 045 770 kr	10 045 770 kr
Överskottskapital (CET1)	17 298 224 kr	13 021 297 kr	9 130 000 kr	8 333 312 kr
Överkottskapital (Totalt)	11 363 803 kr	7 086 876 kr	3 389 560 kr	2 592 872 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities, konsoliderad situation

Likviditet	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	31 935 887 kr	22 587 657 kr	28 751 097 kr	28 199 580 kr
Finansiering				
Eget kapital	26 111 792 kr	17 661 982 kr	23 012 875 kr	25 767 801 kr
Skulder	8 042 020 kr	8 309 054 kr	9 237 430 kr	4 698 684 kr
Balansomslutning	34 153 812 kr	25 971 036 kr	32 250 305 kr	30 466 485 kr
Nyckeltal	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31	2019-09-30
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	94%	87%	89%	93%
Eget kapital / Balansomslutning	76%	68%	71%	85%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	945%	620%	311%	600%
Bruttosoliditet	103%	67%	42%	42%