

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

30 september 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	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	131 869 kr	131 869 kr	131 869 kr	131 869 kr
Aktiekapital	131 869 kr	131 869 kr	131 869 kr	131 869 kr
Överkursfond	- kr	- kr	- kr	- kr
Ej utdelade vinstmedel	12 675 326 kr	12 675 326 kr	26 631 482 kr	12 702 716 kr
Ackumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	1 300 000 kr	1 021 800 kr	1 021 800 kr	1 300 000 kr
Delårsresultat som har verifierats av personer som har en oberoende ställning	- kr	- kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	14 107 195 kr	13 828 995 kr	27 785 151 kr	14 134 585 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar				
(-) Goodwill	- kr	- kr	- kr	- 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	0 kr	-6 174 601 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	0 kr	-6 174 601 kr	0 kr
Kärnprimärkapital	14 107 195 kr	13 828 995 kr	21 610 550 kr	14 134 585 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	14 107 195 kr	13 828 995 kr	21 610 550 kr	14 134 585 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	14 107 195 kr	13 828 995 kr	21 610 550 kr	14 134 585 kr
Totala riskvägda tillgångar	98 461 578 kr	98 461 578 kr	98 461 578 kr	95 674 000 kr

Exponeringsbelopp	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kredit- och motpartsrisk	37 645 841 kr	32 094 232 kr	32 324 641 kr	41 598 395 kr
Nationella Regeringar	10 938 kr	10 937 kr	20 537 kr	2 527 kr
Institut	26 758 816 kr	29 922 939 kr	29 283 096 kr	38 280 610 kr
Övrigt	10 876 087 kr	2 160 356 kr	3 021 008 kr	3 315 258 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	37 645 841 kr	32 094 232 kr	32 324 641 kr	41 598 395 kr

Riskvägda exponeringsbelopp	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kredit- och motpartsrisk	16 227 850 kr	8 144 944 kr	8 877 627 kr	10 971 380 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	5 351 763 kr	5 984 588 kr	5 856 619 kr	7 656 122 kr
Övrigt	10 876 087 kr	2 160 356 kr	3 021 008 kr	3 315 258 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	82 233 728 kr	90 316 634 kr	89 583 951 kr	84 702 620 kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	16 227 850 kr	8 144 944 kr	8 877 627 kr	10 971 380 kr

Fasta omkostnader	31 507 705 kr	31 507 705 kr	31 507 705 kr	30 615 680 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 653 920 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	98 461 578 kr	98 461 578 kr	98 461 578 kr	95 674 000 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	98 461 578 kr	98 461 578 kr	98 461 578 kr	95 674 000 kr
Kredit- och motpartsrisk	1 298 228 kr	651 596 kr	710 210 kr	877 710 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 578 698 kr	7 225 331 kr	7 166 716 kr	6 776 210 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapitalkrav	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 653 920 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kreditrisk och motpartsrisk	1 298 228 kr	651 596 kr	710 210 kr	877 710 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 578 698 kr	7 225 330 kr	7 166 716 kr	6 776 210 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 876 926 kr	7 653 920 kr

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

Kapitalrelationer och buffertar	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kärnprimärkapitalrelation	14,33%	14,05%	21,95%	14,77%
Primärkapitalrelation	14,33%	14,05%	21,95%	14,77%
Total kapitalrelation	14,33%	14,05%	21,95%	14,77%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	9,83%	9,55%	17,45%	10,27%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 461 539 kr	2 461 539 kr	2 461 539 kr	2 391 850 kr
<i>Kontracyklisk buffert (2%)</i>	- kr	- kr	- kr	- kr
<i>Kombinerat buffertkrav</i>	2 461 539 kr	2 461 539 kr	2 461 539 kr	2 391 850 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 338 466 kr	10 338 466 kr	10 338 466 kr	10 045 770 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	10 338 466 kr	10 338 466 kr	10 338 466 kr	10 045 770 kr
Överskottskapital (CET1)	9 676 424 kr	9 398 224 kr	17 179 779 kr	9 829 255 kr
Överkottskapital (Totalt)	3 768 729 kr	3 490 529 kr	11 272 084 kr	4 088 815 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	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	26 758 816 kr	29 922 939 kr	29 283 096 kr	38 280 610 kr
Finansiering				
Eget kapital	30 627 664 kr	20 349 583 kr	21 888 750 kr	28 063 352 kr
Skulder	7 018 176 kr	11 744 649 kr	10 540 663 kr	13 534 805 kr
Balansomslutning	37 645 840 kr	32 094 232 kr	32 429 413 kr	41 598 157 kr
Nyckeltal	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	71%	93%	90%	92%
Eget kapital / Balansomslutning	81%	63%	67%	67%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	455%	609%	790%	283%
Bruttosoliditet	87%	107%	67%	34%

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities, konsoliderad situation

Kapitalbas	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr
Aktiekapital	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr
Överkursfond	- kr	- kr	- kr	- kr
Ej utdelade vinstmedel	12 001 666 kr	21 001 666 kr	21 001 666 kr	12 498 087 kr
Ackumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	887 243 kr	697 373 kr	697 373 kr	887 243 kr
Delårsresultat som har verifierats av personer som har en oberoende ställning	- kr	- kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	12 938 909 kr	21 749 039 kr	21 749 039 kr	13 435 330 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar				
(-) Goodwill	- kr	- kr	- kr	- 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	- kr	4 276 927 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	- kr	4 276 927 kr	0 kr
Kärnprimärkapital	12 938 909 kr	21 749 039 kr	17 472 112 kr	13 435 330 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	12 938 909 kr	21 749 039 kr	17 472 112 kr	13 435 330 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	12 938 909 kr	21 749 039 kr	17 472 112 kr	13 435 330 kr
Totala riskvägda tillgångar	98 907 006 kr	98 907 006 kr	98 907 006 kr	95 674 000 kr

Exponeringsbelopp	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kredit- och motpartsrisk	28 781 886 kr	34 153 814 kr	25 899 526 kr	32 250 466 kr
Nationella Regeringar	7 465 kr	7 464 kr	14 016 kr	1 725 kr
Institut	20 598 978 kr	31 935 887 kr	22 587 657 kr	28 751 097 kr
Övrigt	8 175 443 kr	2 210 463 kr	3 297 853 kr	3 497 644 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	28 781 886 kr	34 153 814 kr	25 899 526 kr	32 250 466 kr

Riskvägda exponeringsbelopp	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kredit- och motpartsrisk	12 295 239 kr	8 597 640 kr	7 815 384 kr	9 247 863 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	4 119 796 kr	6 387 177 kr	4 517 531 kr	5 750 219 kr
Övrigt	8 175 443 kr	2 210 463 kr	3 297 853 kr	3 497 644 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	86 611 769 kr	90 309 366 kr	91 091 622 kr	86 426 137 kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	12 295 239 kr	8 597 640 kr	7 815 384 kr	9 247 863 kr

Fasta omkostnader	31 650 242 kr	31 650 242 kr	31 650 242 kr	30 615 680 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 653 920 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	98 907 006 kr	98 907 006 kr	98 907 006 kr	95 674 000 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	98 907 006 kr	98 907 006 kr	98 907 006 kr	95 674 000 kr
Kredit- och motpartsrisk	983 619 kr	687 811 kr	625 231 kr	739 829 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 928 942 kr	7 224 749 kr	7 287 330 kr	6 914 091 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapitalkrav	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 653 920 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kreditrisk och motpartsrisk	983 619 kr	687 811 kr	625 231 kr	739 829 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 928 942 kr	7 224 749 kr	7 287 330 kr	6 914 091 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 912 561 kr	7 653 920 kr

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

Kapitalrelationer och buffertar	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Kärnprimärkapitalrelation	13,08%	21,99%	17,67%	14,04%
Primärkapitalrelation	13,08%	21,99%	17,67%	14,04%
Total kapitalrelation	13,08%	21,99%	17,67%	14,04%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	8,58%	17,49%	13,17%	9,54%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 472 675 kr	2 472 675 kr	2 472 675 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>2 472 675 kr</i>	<i>2 472 675 kr</i>	<i>2 472 675 kr</i>	<i>2 391 850 kr</i>
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 385 236 kr	10 385 236 kr	10 385 236 kr	10 045 770 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	10 385 236 kr	10 385 236 kr	10 385 236 kr	10 045 770 kr
Överskottskapital (CET1)	8 488 094 kr	17 298 224 kr	13 021 297 kr	9 130 000 kr
Överkottskapital (Totalt)	2 553 673 kr	11 363 803 kr	7 086 876 kr	3 389 560 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities, konsoliderad situation

Likviditet	2020-09-30	2020-06-30	2020-03-31	2019-12-31
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	20 598 978 kr	31 935 887 kr	22 587 657 kr	28 751 097 kr
Finansiering				
Eget kapital	23 968 474 kr	26 111 792 kr	17 661 982 kr	23 012 875 kr
Skulder	4 813 415 kr	8 042 020 kr	8 309 054 kr	9 237 430 kr
Balansomslutning	28 781 889 kr	34 153 812 kr	25 971 036 kr	32 250 305 kr
Nyckeltal				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	72%	94%	87%	89%
Eget kapital / Balansomslutning	83%	76%	68%	71%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	510%	945%	620%	311%
Bruttosoliditet	105%	103%	67%	42%