

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

30 juni 2021

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	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	1 028 999 kr	1 028 999 kr	1 028 999 kr	131 869 kr
Aktiekapital	136 366 kr	136 366 kr	136 366 kr	131 869 kr
Överkursfond	892 633 kr	892 633 kr	892 633 kr	- kr
Ej utdelade vinstmedel	15 115 358 kr	12 472 890 kr	12 472 890 kr	12 675 326 kr
Ackumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- 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	16 144 357 kr	14 801 889 kr	14 801 889 kr	14 107 195 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	-1 799 111 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	-1 799 111 kr	0 kr	0 kr
Kärnprimärkapital	16 144 357 kr	13 002 778 kr	14 801 889 kr	14 107 195 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	16 144 357 kr	13 002 778 kr	14 801 889 kr	14 107 195 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	16 144 357 kr	13 002 778 kr	14 801 889 kr	14 107 195 kr
Totala riskvägda tillgångar	96 308 866 kr	96 308 866 kr	98 461 578 kr	98 461 578 kr

Error! Not a valid link.

Exponeringsbelopp	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kredit- och motpartsrisk	75 900 648 kr	65 200 767 kr	68 585 517 kr	37 645 841 kr
Nationella Regeringar	2 047 998 kr	2 033 311 kr	10 939 kr	10 938 kr
Institut	69 380 271 kr	53 481 471 kr	33 958 958 kr	26 758 816 kr
Övrigt	4 349 949 kr	9 563 555 kr	34 493 190 kr	10 876 087 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	75 900 648 kr	65 200 767 kr	68 585 517 kr	37 645 841 kr
Riskvägda exponeringsbelopp	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kredit- och motpartsrisk	18 348 433 kr	20 382 279 kr	41 407 412 kr	16 227 850 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	13 876 054 kr	10 696 294 kr	6 791 792 kr	5 351 763 kr
Övrigt	4 349 949 kr	9 563 555 kr	34 493 190 kr	10 876 087 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	77 960 428 kr	75 926 591 kr	57 054 166 kr	82 233 728 kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	18 348 433 kr	20 382 279 kr	41 407 412 kr	16 227 850 kr
Fasta omkostnader	30 818 837 kr	30 818 837 kr	31 507 705 kr	31 507 705 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 704 709 kr	7 704 709 kr	7 876 926 kr	7 876 926 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	96 308 866 kr	96 308 866 kr	98 461 578 kr	98 461 578 kr
Kapitalkrav (Pelare 1)	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	96 308 866 kr	96 308 866 kr	98 461 578 kr	98 461 578 kr
Kredit- och motpartsrisk	1 467 875 kr	1 630 582 kr	3 312 593 kr	1 298 228 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 236 834 kr	6 074 127 kr	4 564 333 kr	6 578 698 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapitalkrav	7 704 709 kr	7 704 710 kr	7 876 926 kr	7 876 926 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kreditrisk och motpartsrisk	1 467 875 kr	1 630 582 kr	3 312 593 kr	1 298 228 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 236 834 kr	6 074 127 kr	4 564 333 kr	6 578 698 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt	7 704 709 kr	7 704 709 kr	7 876 926 kr	7 876 926 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr	- kr	- kr

Kapitalrelationer och buffertar	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	16,76%	13,50%	15,03%	14,33%
Primärkapitalrelation	16,76%	13,50%	15,03%	14,33%
Total kapitalrelation	16,76%	13,50%	15,03%	14,33%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	12,26%	9,00%	10,53%	9,83%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 407 722 kr	2 407 722 kr	2 461 539 kr	2 461 539 kr
<i>Kontracyklisk buffert (2%)</i>	<i>- kr</i>	<i>- kr</i>	<i>- kr</i>	<i>- kr</i>
<i>Kombinerat buffertkrav</i>	<i>2 407 722 kr</i>	<i>2 407 722 kr</i>	<i>2 461 539 kr</i>	<i>2 461 539 kr</i>
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 112 431 kr	10 112 431 kr	10 338 466 kr	10 338 466 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	10 112 431 kr	10 112 431 kr	10 338 466 kr	10 338 466 kr
Överskottskapital (CET1)	11 810 458 kr	8 668 880 kr	10 371 118 kr	9 676 424 kr
Överkottskapital (Totalt)	6 031 926 kr	2 890 347 kr	4 463 423 kr	3 768 729 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	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	69 380 271 kr	53 481 471 kr	33 958 958 kr	26 758 816 kr
Finansiering				
Eget kapital	23 003 997 kr	44 345 678 kr	45 251 278 kr	30 627 664 kr
Skulder	52 896 651 kr	20 855 092 kr	23 334 240 kr	7 018 176 kr
Balansomslutning	75 900 648 kr	65 200 770 kr	68 585 518 kr	37 645 840 kr
Nyckeltal	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	91%	82%	50%	71%
Eget kapital / Balansomslutning	30%	68%	66%	81%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	143%	595%	329%	455%

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities, konsoliderad situation

Kapitalbas	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	942 633 kr	639 129 kr	639 129 kr	50 000 kr
Aktiekapital	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr	50 000 kr
Överkursfond	892 633 kr	589 129 kr	589 129 kr	- kr
Ej utdelade vinstmedel	29 222 995 kr	11 582 815 kr	11 582 815 kr	12 001 666 kr
Ackumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	857 988 kr	857 988 kr	887 243 kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	- kr	4 050 065 kr	3 515 219 kr	- kr
Delårsresultat som har verifierats av personer som har en oberoende ställning	- kr	- kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	30 165 628 kr	17 129 997 kr	16 595 151 kr	12 938 909 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	1 975 048 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	1 975 048 kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital	30 165 628 kr	15 154 949 kr	16 595 151 kr	12 938 909 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	30 165 628 kr	15 154 949 kr	16 595 151 kr	12 938 909 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar				
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	30 165 628 kr	15 154 949 kr	16 595 151 kr	12 938 909 kr
Totala riskvägda tillgångar	97 675 191 kr	97 675 191 kr	98 907 006 kr	98 907 006 kr

Exponeringsbelopp	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kredit- och motpartsrisk	79 556 016 kr	67 939 662 kr	71 545 729 kr	28 781 886 kr
Nationella Regeringar	2 091 111 kr	2 076 421 kr	10 941 kr	7 465 kr
Institut	72 225 550 kr	55 410 721 kr	36 088 508 kr	20 598 978 kr
Övrigt	5 116 925 kr	10 330 090 kr	35 323 850 kr	8 175 443 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	79 556 016 kr	67 939 662 kr	71 545 729 kr	28 781 886 kr
Riskvägda exponeringsbelopp	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kredit- och motpartsrisk	19 684 465 kr	21 534 664 kr	42 663 982 kr	12 295 239 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr	- kr
Institutioner	14 445 110 kr	11 082 144 kr	7 217 702 kr	4 119 796 kr
Övrigt	5 116 925 kr	10 330 090 kr	35 323 850 kr	8 175 443 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	77 990 728 kr	76 140 528 kr	56 243 019 kr	86 611 769 kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	19 684 465 kr	21 534 664 kr	42 663 982 kr	12 295 239 kr
Fasta omkostnader	31 256 061 kr	31 256 061 kr	31 650 242 kr	31 650 242 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	7 814 015 kr	7 814 015 kr	7 912 561 kr	7 912 561 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	97 675 191 kr	97 675 191 kr	98 907 006 kr	98 907 006 kr
Kapitalkrav (Pelare 1)	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	97 675 191 kr	97 675 191 kr	98 907 006 kr	98 907 006 kr
Kredit- och motpartsrisk	1 574 757 kr	1 722 773 kr	3 413 119 kr	983 619 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 239 258 kr	6 091 242 kr	4 499 442 kr	6 928 942 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt kapitalkrav	7 814 015 kr	7 814 015 kr	7 912 560 kr	7 912 561 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kreditrisk och motpartsrisk	1 574 757 kr	1 722 773 kr	3 413 119 kr	983 619 kr
Marknadsrisk	- kr	- kr	- kr	- kr
Operativ risk	6 239 258 kr	6 091 242 kr	4 499 442 kr	6 928 942 kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr	- kr
Totalt	7 814 015 kr	7 814 015 kr	7 912 561 kr	7 912 561 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr	- kr	- kr

Kapitalrelationer och buffertar	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	30,88%	15,52%	16,78%	13,08%
Primärkapitalrelation	30,88%	15,52%	16,78%	13,08%
Total kapitalrelation	30,88%	15,52%	16,78%	13,08%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	26,38%	11,02%	12,28%	8,58%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	2 441 880 kr	2 441 880 kr	2 472 675 kr	2 472 675 kr
Kontracyklisk buffert (2%)	- kr	- kr	- kr	- kr
Kombinerat buffertkrav	2 441 880 kr	2 441 880 kr	2 472 675 kr	2 472 675 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	10 255 895 kr	10 255 895 kr	10 385 235 kr	10 385 236 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	10 255 895 kr	10 255 895 kr	10 385 235 kr	10 385 236 kr
Överskottskapital (CET1)	25 770 244 kr	10 759 565 kr	12 144 336 kr	8 488 094 kr
Överkottskapital (Totalt)	19 909 733 kr	4 899 054 kr	6 209 916 kr	2 553 673 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities, konsoliderad situation

Likviditet	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Likviditetsreserv				
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	72 225 550 kr	55 410 721 kr	36 088 508 kr	20 598 978 kr
Finansiering				
Eget kapital	36 560 028 kr	46 991 011 kr	48 072 550 kr	23 968 474 kr
Skulder	42 995 988 kr	20 948 772 kr	23 473 181 kr	4 813 415 kr
Balansomslutning	79 556 016 kr	67 939 783 kr	71 545 731 kr	28 781 889 kr
Nyckeltal	2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	91%	82%	50%	72%
Eget kapital / Balansomslutning	46%	69%	67%	83%
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	187%	610%	345%	510%