

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisker

31 december 2022

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	2022-12-31	2022-09-30
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	26 009 436 kr	26 009 436 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	- kr
Obeskattade och andra reserver	- kr	- kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	- kr	- kr
Delårsresultat	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	28 158 433 kr	28 158 433 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	0 kr	0 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr
<i>Justeringar på grund av föreslagen utdelning</i>	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	0 kr	0 kr
Kärnprimärkapital	28 158 433 kr	28 158 433 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr
Primärkapital	28 158 433 kr	28 158 433 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	28 158 433 kr	28 158 433 kr

K-faktor belopp	2022-12-31	2022-09-30
Kundrisk (RtC)	19 396 730 kr	29 837 586 kr
AUM		
CMH	19 396 730 kr	29 837 586 kr
ASA		
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	2022-12-31	2022-09-30
Kundrisk (RtC)	77 587 kr	119 350 kr
K-AUM		
K-CMH	77 587 kr	119 350 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	77 587 kr	119 350 kr
Fasta omkostnader kapitalkrav	2022-12-31	2022-09-30
Föregående års fasta omkostnader	49 446 431 kr	49 446 431 kr
Kapitalkrav baserat på fasta omkostnader	12 361 608 kr	12 361 608 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2022-12-31	2022-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr
Kapitalrelationer och buffertar		
	2022-12-31	2022-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	228%	228%
Primärkapitalrelation	228%	228%
Total kapitalrelation	228%	228%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	223%	223%
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	12 361 608 kr	12 361 608 kr
Överskottskapital (CET1)	15 796 825 kr	15 796 825 kr
Överkottskapital (Totalt)	15 796 825 kr	15 796 825 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	2022-12-31	2022-09-30
Likviditetskrav	4 120 536 kr	4 120 536 kr
Likviditetsreserv	37 942 238 kr	25 514 516 kr
Kassa och tillgodoavande hos kreditinstitut	37 942 238 kr	25 514 516 kr

Kapitaltäckningsanalys – Vator Securities, konsoliderad situation

Kapitalbas	2022-12-31	2022-09-30
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	25 397 168 kr	25 397 168 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	- kr	- kr
Obeskattade och andra reserver	- kr	- kr
Kärnprimärkapital hänförligt till minoritetsintressen	4 769 108 kr	4 769 108 kr
Delårsresultat	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	30 216 276 kr	30 216 276 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	0 kr	0 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn	- kr	- kr
Justeringar på grund av föreslagen utdelning	- kr	- kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	0 kr	0 kr
Kärnprimärkapital	30 216 276 kr	30 216 276 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr
Primärkapital	30 216 276 kr	30 216 276 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar		
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	30 216 276 kr	30 216 276 kr

K-faktor belopp	2022-12-31	2022-09-30
Kundrisk (RtC)	19 396 730 kr	29 837 586 kr
AUM		
CMH	19 396 730 kr	29 837 586 kr
ASA		
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	2022-12-31	2022-09-30
Kundrisk (RtC)	77 587 kr	119 350 kr
K-AUM		
K-CMH	77 587 kr	119 350 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	77 587 kr	119 350 kr
Fasta omkostnader kapitalkrav	2022-12-31	2022-09-30
Föregående års fasta omkostnader	50 106 231 kr	50 106 231 kr
Kapitalkrav baserat på fasta omkostnader	12 526 558 kr	12 526 558 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)	2022-12-31	2022-09-30
Permanent minimikapitalkrav	7 697 475 kr	7 697 475 kr
Kapitalkrav baserat på Fasta omkostnader	12 526 558 kr	12 526 558 kr
K-faktorkrav	77 587 kr	119 350 kr
Totalt kapitalkrav	12 526 558 kr	12 526 558 kr
Tillkommande Pelare 2-krav	2022-12-31	2022-09-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	- kr	- kr
Kapitalrelationer och buffertar	2022-12-31	2022-09-30
Kärnprimärkapitalrelation	241%	241%
Primärkapitalrelation	241%	241%
Total kapitalrelation	241%	241%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	237%	237%
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	12 526 558 kr	12 526 558 kr
Överskottskapital (CET1)	17 689 718 kr	17 689 718 kr
Överkottskapital (Totalt)	17 689 718 kr	17 689 718 kr

Likviditetsrisk och finansiering – Vator Securities, konsoliderad situation

Likviditetsrisk

Likviditetsrisk	2022-12-31	2022-09-30
Likviditetskrav	4 175 519 kr	4 175 519 kr
Likviditetsreserv	42 195 389 kr	30 431 025 kr
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	42 195 389 kr	30 431 025 kr