

Periodisk information för kapitaltäckning och likviditetsrisk i bolaget VCG IM per 2017-09-30

Bolaget VCG IM är ett värdepappersbolag under Finansinspektionens tillsyn och offentliggör uppgifter om kapitaltäckning i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar.

Kapitalbas

SEK (tkr)	
Belopp för kärnprimärkapital	13 313
Övrigt primärkapital	-
Belopp för supplementärkapital	-
Total kapitalbas	13 313

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt fördelning nedan:	7 140
- Exponering mot nationella regeringar eller centralbanker	-
- Exponeringar mot delstatliga eller lokala självstyrelseorgan och myndigheter	-
- Exponeringar mot offentliga organ	-
- Exponeringar mot multilaterala utvecklingsbanker	-
- Exponeringar mot internationella organisationer	-
- Exponeringar mot institut	-
- Exponeringar mot företag	-
- Exponeringar mot hushåll	-
- Exponeringar säkrade genom panträtt i fastigheter	-
- Fallerande exponeringar	-
- Exponeringar förenade med särskilt hög risk	-
- Exponeringar i form av säkerställda obligationer	-
- Poster som avser positioner i värdepapperisering	-
- Exponering mot institut och företag med ett kortfristigt kreditbetyg	4 356
- Exponeringar i form av andelar eller aktier i företag för kollektiva investeringar (fond)	-
- Aktieexponeringar	-
- Övriga poster	2 784
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för operativa risker	51 550

Kapitalrelationer och buffertar

% av totalt riskvägt exponeringsbelopp	
Kärnprimärkapital	25,83 %
Primärkapital	25,83 %
Totalt kapital	25,83 %
Institutspecifika buffertkrav	2,50 %
Varav krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
Varav krav på kontracyklisk kapitalbuffert	-
Varav krav på systemriskbuffert	-

Internt bedömt kapitalbehov

SEK (tkr)	
Internt bedömt kapitalbehov enligt Pelare I	4 124

VCG IM uppfyller kravet på miniminivå för kapitalbasen samt kravet för de risker som behandlas under Pelare I.

Likviditetsreserven

Information om VCG IM likviditetsreserv redovisas kvartalsvis i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2010:7) om hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag. I enlighet med denna föreskrift är ett företag skyldig att hålla en reserv av högkvalitativa likvida tillgångar som kan användas för att säkra företagets kortsiktiga betalningsförmåga vid bortfall eller försämrad tillgång till vanligtvis tillgängliga finansieringskällor. Tillgångar som får medräknas i likviditetsreserven ska vara likvida på privata marknader och belåningsbara i centralbanker. Inlåningsmedel, i centralbanker eller en annan bank, som är tillgängliga påföljande dag får räknas med i likviditetsreserven. Tillgångarna i VCG IM likviditetsreserv är inte ianspråktaga som säkerheter. VCG IM likviditetsreserv består av sådana tillgångar att likviditet kan skapas på kort tid till förutsägbara värden. VCG IM likviditetsreserv består av inlåningsmedel i annat institut och innehav av likvida instrument enligt nedanstående förteckning.

Likviditetsreserv

SEK (tkr)	
Kassa och tillgodohavanden i bank	21 779
Innehav i statspapper	-
Innehav i säkerställda obligationer med högsta rating	-
Summa likviditetsreserv	21 779

Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Eget kapital	19 066
Kortfristiga skulder	5 498
Långfristiga skulder	-
Summa skulder och eget kapital	24 564

Övrig information

SEK (tkr)	
Kvot likviditetsreserv/balansomslutning	88,7 %
Kvot likviditetsreserv/totala skulder	396,1 %
Kvot likviditetsreserv/kortfristiga skulder	396,1 %