

FOREX BANK AB (publ)
KAPITAL- OCH LIKVIDITETSHANTERING
INFORMATION ENLIGT PELARE III Q2-2021

Innehållsförteckning

Inledning	2
Publiceringskrav	2
Tillämpningsområde	2
Översikt av riskvägda exponeringsbelopp	3
Tabell 1. Kapitalbas, Kapitalkrav och kapitalrelationer.....	3

Inledning

Syftet med denna rapport är att offentliggöra information om FOREX Banks kapital- och likviditetshantering i enlighet med Kapitäläckningsdirektivet (CRD) 2013/36/EU och Kapitäläckningsförordningen om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag (EU) nr 575/2013 (CRR) samt delegerade akter.

Publiceringskrav

Rapporten innehåller de upplysningar som krävs enligt CRD och CRR med beaktande av EU-kommissionens delegerade akter samt Finansinspektionens föreskrifter, 2014:12 om tillsynskrav och kapitalbuffertar och 2014:21 om hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag, med hänsyn taget till gällande ändringsföreskrifter. Alla belopp anges i SEK.

Tillämpningsområde

Upplysningarna i rapporten avser individuell nivå för FOREX Bank AB med organisationsnummer 516406-0104.

Översikt av riskvägda exponeringsbelopp

I enlighet med EU-kommissionens genomförandeförordning använder FOREX Bank AB EU:s framtagna mallar för att underlätta marknadsaktörers tillgång till väsentlig finansiell information.

Tabell 1. Kapitalbas, kapitalkrav och kapitalrelationer

Mall EU KM1 – Mall för nyckeltal		2021-06-30	2021-03-31	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
		a	b	c	d	e
		T	T-1	T-2	T-3	T-4
Tillgänglig kapitalbas (belopp)						
1	Kärnprimärkapital	1 016 407 530	1 162 067 535	1 220 142 845	1 241 461 989	1 266 247 782
2	Primärkapital	1 016 407 530	1 162 067 535	1 220 142 845	1 241 461 989	1 266 247 782
3	Totalt kapital	1 265 738 155	1 411 111 285	1 468 899 720	1 489 931 989	1 514 430 907
Riskvägda exponeringsbelopp						
4	Totalt riskvägt exponeringsbelopp	2 459 395 157	7 557 102 031	8 131 520 923	8 260 315 619	8 247 453 880
Kapitalrelationer (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)						
5	Kärnprimärkapitalrelation (i %)	41,33%	15,38%	15,01%	15,03%	15,40%
6	Primärkapitalrelation (i %)	41,33%	15,38%	15,01%	15,03%	15,40%
7	Total kapitalrelation (i %)	51,47%	18,67%	18,06%	18,04%	18,40%
Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera andra risker än risken för alltför låg bruttosoliditet (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)						
EU 7a	Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera andra risker än risken för alltför låg bruttosoliditet (i %)	0	0	0	0	0
EU 7b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procentenheter)					
EU 7c	varav: ska utgöras av primärkapital (i procentenheter)					
EU 7d	Totala kapitalbaskrav för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	8,00%	8,00%	8,00%	8,00%	8,00%
Kombinerat buffertkrav och samlat kapitalkrav (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)						
8	Kapitalkonservingsbuffert (i %)	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
EU 8a	Konservingsbuffert på grund av makrotillsynsrisiker eller systemrisiker identifierade på medlemsstatsnivå (i %)	0,00%				
9	Institutspecifik kontryckisk kapitalbuffert (i %)	0,06%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
EU 9a	Systemrisikuffert (i %)	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
10	Buffert för globalt systemviktigt institut (i %)					
EU 10a	Buffert för andra systemviktiga institut (i %)					
11	Kombinerat buffertkrav (i %)	2,56%	2,50%	2,50%	2,50%	2,50%
EU 11a	Samlade kapitalkrav (i %)	10,56%	10,50%	10,50%	10,50%	10,50%
12	Tillgängligt kärnprimärkapital efter uppfyllande av de totala kapitalbaskraven för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	34,32%	8,87%	8,67%	8,72%	9,02%
Bruttosoliditetsgrad						
13	Totalt exponeringsmått	1 454 710 105	9 612 550 458	10 680 712 645	10 853 066 688	10 948 341 777
14	Bruttosoliditetsgrad (i %)	67,94%	11,80%	11,42%	11,44%	11,57%
Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera risken för alltför låg bruttosoliditet (som en procentandel av det totala exponeringsmättet)						
EU 14a	Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera risken för alltför låg bruttosoliditet (i %)					
EU 14b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procentenheter)					
EU 14c	Totala krav avseende bruttosoliditetsgrad för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
Bruttosoliditetsbuffert och samlat bruttosoliditetskrav (som en procentandel av det totala exponeringsmättet)						
EU 14d	Krav på bruttosoliditetsbuffert (i %)					
EU 14e	Samlat bruttosoliditetskrav (i %)	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%	3,00%
Likviditetstäckningskvot						
15	Totala högkvalitativa likvida tillgångar (viktat värde – genomsnitt)	210 040 215	1 320 905 018	1 999 983 588	1 589 020 117	2 013 571 616
EU 16a	Likviditetsutflöden – totalt viktat värde	85 366 488	664 093 715	621 987 867	625 861 552	626 897 079
EU 16b	Likviditetsinflöden – totalt viktat värde	526 407 708	526 259 972	581 483 529	733 270 129	612 131 042
16	Totala nettolikviditetsutflöden (justerat värde)	21 341 622	166 023 429	155 496 967	156 465 388	156 724 270
17	Likviditetstäckningskvot (i %)	984,18%	795,61%	1286,19%	1015,57%	1284,79%
Stabil nettofinansieringskvot						
18	Total tillgänglig stabil finansiering	1 374 987 997	-	-	-	-
19	Totalt behov av stabil finansiering	592 060 154	-	-	-	-
20	Stabil nettofinansieringskvot (i %)	232,24%	-	-	-	-

FOREX Bank AB har inget ytterligare kapitalbaskrav för att hantera andra risker eller risken för alltför låg bruttosoliditet. Vidare har FOREX Bank AB inget krav på att hålla en bruttosoliditetsbuffert, och FOREX är inte klassat som något systemviktigt institut och undantas även från dessa buffertkrav.

Beräkningen av stabil nettofinansieringskvot uppdaterades till rapporteringstillfället 2021-06-30 i linje med den uppdaterade tillsynsförordningen, då kravet på en kvot om minst 100% infördes. Tidigare perioder har lämnats tomma eftersom en annan beräkningsmetod har använts historiskt, samt att det då inte fanns något krav på stabil nettofinansieringskvot.