

Periodisk information om likviditetsrisk i enlighet med FFFS 2010:7 med komplettering i FFFS 2014:21

Denna rapport visar information om Entelios Trading AB:s (Entelios) likviditetsrisker. Innehållet i denna rapport överensstämmer med Finansinspektionens föreskrift FFFS 2010:7, med komplettering i FFFS 2014:21, och måste offentliggöras minst fyra gånger per år via rapporten periodisk information. Informationen behöver inte, och har därför inte heller varit, föremål för extern revision.

Organisation

Styrelsen fastställer Entelios risktolerans, övergripande likviditets- och finansieringsstrategi.

VD ansvarar för att upprätta beredskapsplan, rapportering av likviditetsriskmått till styrelsen samt genomförande av stresstester.

Likviditetsstrategi

Målet med Entelios likviditetshantering är att säkerställa tillräcklig likviditet vid alla tidpunkter och att säkerställa att betalningsförpliktelser är uppfyllda i tid. Entelios har ett antal nyckeltal som ska säkerställa att likviditetsrisken ligger inom fastställd risktolerans.

Entelios rapporterar löpande förväntade kassaflöden till Entelios AB. Vidare genomförs regelbundet olika stresstester för att säkerställa att Entelios ska ha en tillfredställande likviditetsberedskap även i tider av stress.

Finansieringsstrategi

Entelios har endast två finansieringskällor – moderbolaget Entelios AB och koncernmodern Agder Energi AS. Entelios har av sin ägare ej tillåtelse att använda andra finansieringskällor. Detta gör att Entelios inte har någon diversifiering vad gäller sin finansiering.

Eventuell likviditetsrisk intradag kommer att hanteras via Entelios AB:s tillgång till koncernmodern Agder Energi AS cash pool.

Likviditetsreserv

Entelios definierar sin likviditetsreserv som ej pantsatta likvida medel, både inom och utom cash pool, samt kortfristig utlåning till moderbolaget Entelios AB.

Stresstester och beredskapsplan

Entelios genomför regelbundet stresstester som identifierar och mäter bolagets likviditetsrisk under olika scenarier för att säkerställa att risken är i enlighet med den fastställda risktoleransen. Entelios genomför tre stycken olika stresstester. I det första stressas marknadsrelaterade faktorer, i det andra stressas företagsspecifika faktorer och i det tredje sker en kombination av marknads- och företagsspecifika faktorer.

Entelios har en beredskapsplan för hantering av en likviditetskris. Planen definierar vad Entelios anser vara indikatorer för vidtagande av åtgärder samt vilka åtgärder bolaget skulle vidta om kris bedöms föreligga. I beredskapsplanen framgår även bolagets beslutsorganisation vid en likviditetskris.

Likviditetsriskmått

- (i) Entelios ska mäta och dokumentera om det vid någon tidpunkt inträffat att bolaget inte kunnat uppfylla ett betalningsåtagande.
- (ii) Entelios likviditetsreserv ska med marginal överstiga utflöden även under stressade kassaflödesscenarier.
- (iii) Likviditetsreserven/Kortfristiga skulder vilket visar likviditeten på ett bra sätt på kort tidshorisont.

Offentliggörande

Relevant och tydlig information om bolagets likviditet ska lämnas i bolagets årsredovisning, bilaga till den eller på bolagets webbplats. Bolagets Likviditetsreserv och redovisning av likviditetsmått finns redovisat i bolagets periodiska information.