

Periodisk information om kapitalbas och riskvägt exponeringsbelopp i enlighet med FFFS 2014:12

Denna rapport visar information om LOS Energy Trading AB:s, kapitalbas och riskvägda exponeringsbelopp per den 31 december 2017. Innehållet i denna rapport överensstämmer med Finansinspektionens föreskrift FFFS 2014:12 och måste offentliggöras minst fyra gånger per år. Informationen behöver inte, och har därför inte heller varit, föremål för extern revision.

Kapitaltäckningsgraden för LOS Energy Trading AB, beräknad enligt CRR som trädde ikraft 1 januari 2014, uppgick den 31 december 2017 till 28,46 procent. För ytterligare information om kapitaltäckning, risker samt Basel II, se LOS Energy Tradings AB:s årsredovisning för 2017.

KAPITALBAS

Skr	31 december 2017
Kärnprimärkapital	15 000 000
Primärkapitaltillskott	0
Summa primärkapital	15 000 000
Supplementärkapital	0
Total kapitalbas	15 000 000

KAPITALBAS-, TILLÄGGS OCH AVDRAGSPOSTER

Skr	31 december 2017
Aktiekapital	7 500 000
Reservfond	7 500 000
Summa kärnprimärkapital	15 000 000
Primärkapitaltillskott	0
Summa primärkapital	15 000 000
Supplementärkapital	0
Summa kapitalbas	15 000 000

KAPITALKRAV ENLIGT PELARE I

Skr	Kapitalkrav
Kreditrisk enligt schablonmetoden	
Stater	0
Kommuner	0
Finansiella institut	209 166
Summa kreditrisk schablonmetoden	209 166
Övriga risker	
Valutakursrisk	33 790
Beräkning fasta omkostnader	3 964 899
Övrigt	8 325
Summa övriga risker	4 007 014
Summa	4 216 181

KAPITALTÄCKNINGSPANALYS (PELARE I)
31 december 2017

Kärnprimärkapitalrelation	28,46%
Primärkapitalrelation	28,46%
Total kapitaltäckningsgrad	28,46%
Kapitaltäckningskvot	3,56

Buffertkrav

Kapitalkonserveringsbuffert	1 171 125
-----------------------------	-----------

Internt bedömt kapitalbehov (PELARE II)

Summa internt bedömt kapitalbehov	106 000
Summa totalt kapitalbehov	4 322 181
Varav täcks med kärnprimärkapital	4 322 181

Uppgifter om likviditet enligt FFFS 2010:7 med komplettering i FFFS 2014:21

Verksamheten i LOS Energy Trading AB är självfinansierad och extern finansiering eller kreditlöften behövs ej för att finansiera verksamheten. Genomförda stresstester visar att bolagets likviditetsreserv med god marginal överstiger utflöden i stressade scenarier.

Likviditet

Likviditetsreserv - 100% banktillgodohavanden	13 973 000
Kassa likviditet - Likviditetsreserv/ kortfristiga skulder	1,78