

Offentliggörande av information om kapitaltäckning

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) och allmänna råd, Europaparlamentets och rådets förordning nr 575/2013 (CRR) samt Kommissionens genomförande förordning (EU) nr 1423/2013 offentliggör Catella Fondförvaltning AB periodisk information om kapitaltäckning

Kapitalbas

Kapitalbasen består enbart av kärnprimärkapital i form av aktiekapital, ej utdelade vinstmedel fg år samt övriga reserver.

Kapitalkrav

Bolaget har tillstånd till fondverksamhet, förvaltning av alternativa investeringsfonder och diskretionär portföljförvaltning.

Basen i det regulatoriska minimikapitalkravet är enligt lagen om värdepappersfonder (LVF) och lagen om alternativa investeringsfonder (LAIF) det högsta av följande:

- 125 000 EUR (startkapital) + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 miljoner euro.
- 25 procent av bolagets fasta omkostnader det föregående året.

Till detta belopp adderas följande:

- Eventuella överstigande belopp som följer av bolagets tillämpning av tillsynsförordningen (575/2013/EU) (det högsta av 25 procent av bolagets fasta omkostnader eller ett belopp baserat på bolagets kredit- och marknadsrisker) samt lagen om kapitalbuffertar (2,5 procent av det riskvägda exponeringsbeloppet enligt tillsynsförordningen).
- Kapital till täckande av yrkesansvarsrisker i förvaltningen av alternativa investeringsfonder (0,01 procent av värdet på tillgångarna i de specialfonder som bolaget förvaltar).

Sammanställning över kapitalkrav (tkr)

Kapitalkrav enligt LVF/LAIF (25% av föregående års fasta omkostnader)	28 055
Tillkommande kapitalkrav enligt tillsynsförordningen, se detaljer på nästa sida*	0
Tillkommande kapitalkrav enligt lagen om kapitalbuffertar, se detaljer på nästa sida*	8 767
Kapital till täckande av yrkesansvarsrisker enligt LAIF	1 507
SUMMA:	38 329
KAPITALKVOT:	1,14

* Uppgifter offentliggörs i enlighet med tillsynsförordningen (575/2013/EU)

	2016-12-31
Eget kapital i Catella Fondförvaltning	55 833
Aktiekapital & överkursfond	5 000
Ej utdelade vinstmedel fg år samt övriga reserver	51 232
Positivt resultat under löpande verksamhetsår som inte är verifierat	-399
Justeringar av kärnprimärkapital	11 992
Uppskjutna skattefordringar	11 992
Kärnprimärkapital	43 840
Kapitalbas	43 840
Risikexponeringsbelopp	350 689
Kreditrisk	78 232
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	21 878
Exponering mot företag	23 117
Säkerställda obligationer	2 828
Övriga poster	30 410
Marknadsrisk	0
Ytterligare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	272 456
Kapitalkrav	28 055
Kreditrisk	6 259
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	1 750
Exponering mot företag	1 849
Säkerställda obligationer	226
Övriga poster	2 433
Marknadsrisk	0
Ytterligare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	21 796
Summa	28 055
Överskott i kärnprimärkapital	28 060
Överskott i sammanlagt kapital	15 785
Kärnprimärkapitalrelation	12,50%
Total kapitalrelation	12,50%
Kapitaltäckningskvot	1,56
Kapitalkonserveringsbuffert enligt lagen om kapitalbuffertar (2,5% av risikexponeringsbeloppet)	8 767
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8,00%
Kapitaltäckningskvot inkl. kapitalbuffert	1,19