

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)	27 631
Tillkommande kapitalkrav enligt tillsynsförordningen, se detaljer på nästa sida*	0
Tillkommande kapitalkrav enligt lagen om kapitalbuffertar, se detaljer på nästa sida*	8 635
Kapital till täckande av yrkesansvarsrisker enligt LAIF	1 504
SUMMA:	37 770
KAPITALKVOT:	1,16

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

	2017-03-31
Eget kapital i Catella Fondförvaltning	87 894
Aktiekapital & överkursfond	5 000
Ej utdelade vinstmedel fg år samt övriga reserver	50 833
Positivt resultat under löpande verksamhetsår som inte är verifierat	32 061
Justeringar av kärnprimärkapital	11 992
Uppskjutna skattefordringar	11 992
Kärnprimärkapital	43 841
Kapitalbas	43 841
Risikexponeringsbelopp	345 381
Kreditrisk	81 210
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	26 130
Exponering mot företag	24 215
Säkerställda obligationer	2 825
Övriga poster	28 040
Marknadsrisk	0
Ytterligare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	264 171
Kapitalkrav	27 631
Kreditrisk	6 497
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	2 090
Exponering mot företag	1 937
Säkerställda obligationer	226
Övriga poster	2 243
Marknadsrisk	0
Ytterligare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	21 134
Summa	27 631
Överskott i kärnprimärkapital	28 298
Överskott i sammanlagt kapital	16 210
Kärnprimärkapitalrelation	12,69%
Total kapitalrelation	12,69%
Kapitaltäckningskvot	1,59
Kapitalkonserveringsbuffert enligt lagen om kapitalbuffertar (2,5% av risikexponeringsbeloppet)	8 635
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8,00%
Kapitaltäckningskvot inkl. kapitalbuffert	1,21