

Offentliggörande av information om kapitaltäckning och riskhantering

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2007:5) om offentliggörande av kapitaltäckning och riskhantering skall följande information lämnas varje kvartal.

För värdepappersbolag gäller enligt lag specifika minimikapitalkrav för kreditrisker, marknadsrisker och operativa risker. Catella Kapitalförvaltning har därutöver en intern kapitalutvärderingsprocess (IKU) som ska tillförsäkra att Catella Kapitalförvaltnings kapital även täcker andra risker i verksamheten. Kapitalbaskravet utvärderas löpande. Varje kvartal görs en beräkning utifrån den kapitalutvärderingsprocess som antagits av styrelsen.

Catella Kapitalförvaltning använder ett riskhanteringssystem för marknadsrisker i portföljerna. Systemet hanterar riskmått som t.ex. volatilitet, value at risk, aktiv risk och beta som kontinuerligt följs upp.

I Catella Kapitalförvaltnings Årsredovisning 2008, under noter, framgår en utförligare beskrivning av bolagets risker och riskhantering.

Uppgifter redovisas för Catella Capitals finansiella företagsgrupp och Catella Kapitalförvaltning AB (556484-9866).

Beräkning av kapitalkrav är utförd i enlighet med lagen (2006:1371) om kapitaltäckning och stora exponeringar samt Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd om kapitaltäckning och stora exponeringar (FFFS 2007:1).

Kapitaltäckning TSEK Periodisk information enligt FFFS 2007:5	Catella Kapitalförvaltning AB 2009-06-30	Finansiell företagsgrupp 2009-06-30
Uppgifter om kapitalbas		
Primärt kapital	13 020	79 300
Avdrag från primärt kapital	0	-1 073
Supplementärt kapital	0	0
Utvidgad kapitalbas	0	0
Total kapitalbas	13 020	78 227
Uppgifter om kapitalkrav		
25% av fasta omkostnader föregående räkenskapsår*	7 235	21 615
Totalt minimikapitalkrav	7 235	21 615
Överskott av kapital	5 785	56 612
Kapitaltäckningskvot	1,80	3,62

* Kapitalkravet beräknas enligt 2 kap 9 § lag om Kapitaltäckning och stora exponeringar.