

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.

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

I Catella Capitals Årsredovisning 2009, under noter, framgår en utförligare beskrivning av bolagets risker och riskhantering.

Uppgifter redovisas för Catella Capitals finansiella företagsgrupp och Catella Fondförvaltning AB (556533-6210).

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	Catella	Finansiell
Periodisk information enligt FFFS 2007:5	Fondförvaltning AB	Företagsgrupp
	2010-06-30	2010-06-30
Uppgifter om kapitalbas		
Primärt kapital	54 357	125 133
Avdrag från primärt kapital	0	-38 000
Supplementärt kapital	0	0
Utvidgad kapitalbas	0	0
Total kapitalbas	54 357	87 133
Uppgifter om kapitalkrav		
25% av fasta omkostnader föregående räkenskapsår*	28 403	46 972
0,02% av förvaltade fonders sammanlagda värde > 250 miljoner Euro	2 644	
Totalt minimikapitalkrav	31 047	46 972
Överskott av kapital	23 310	40 161
Kapitaltäckningskvot	1,75	1,85

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