

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 marknadsrisk) 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	1 634
SUMMA:	38 456
KAPITALKVOT:	1,14

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

	2016-06-30
Eget kapital i Catella Fondförvaltning	79 196
Aktiekapital & överkursfond	5 000
Ej utdelade vinstmedel fg år samt övriga reserver	51 232
Positivt resultat under löpande verksamhetsår som inte är verifierat	22 964
Justeringar av kärnprimärkapital	12 367
Uppskjutna skattefordringar	12 367
Kärnprimärkapital	43 865
Kapitalbas	43 865
Risikexponeringsbelopp	350 689
Kreditrisk	75 461
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	17 967
Exponering mot företag	23 529
Säkerställda obligationer	1 813
Övriga poster	32 152
Marknadsrisk	0
Ytterliggare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	275 227
Kapitalkrav	28 055
Kreditrisk	6 037
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	1 437
Exponering mot företag	1 882
Säkerställda obligationer	145
Övriga poster	2 572
Marknadsrisk	0
Ytterliggare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	22 018
Summa	28 055
Överskott i kärnprimärkapital	28 084
Överskott i sammanlagt kapital	15 810
Kärnprimärkapitalrelation	12,51%
Total kapitalrelation	12,51%
Kapitaltäckningskvot	1,56

Kapitalkonserveringsbuffert enligt lagen om kapitalbuffertar (2,5% av riskexponeringsbeloppet)	8 767
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8,00%
Kapitaltäckningskvot inkl. kapitalbuffert	1,19