

## 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
<b>SUMMA:</b>	<b>38 329</b>
<b>KAPITALKVOT:</b>	<b>1,14</b>

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

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