

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	2 378
SUMMA:	38 643
KAPITALKVOT:	1,13

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

	2017-06-30
Eget kapital i Catella Fondförvaltning	126 020
Aktiekapital & överkursfond	5 000
Ej utdelade vinstmedel fg år samt övriga reserver	50 833
Positivt resultat under löpande verksamhetsår som inte är verifierat	70 187
Justeringar av kärnprimärkapital	11 992
Uppskjutna skattefordringar	11 992
Kärnprimärkapital	43 841
Kapitalbas	43 841
Risikexponeringsbelopp	345 381
Kreditrisk	96 090
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	18 863
Exponering mot företag	23 692
Säkerställda obligationer	2 829
Övriga poster	50 707
Marknadsrisk	0
Ytterliggare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	249 291
Kapitalkrav	27 631
Kreditrisk	7 687
Exponering mot stater banker	0
Exponering mot institut	1 509
Exponering mot företag	1 895
Säkerställda obligationer	226
Övriga poster	4 057
Marknadsrisk	0
Ytterliggare risikexponeringsbelopp på grund av fast kostnader	19 943
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 kapitalbuffetar (2,5% av risikexponeringsbeloppet)	8 635
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8,00%
Kapitaltäckningskvot inkl. kapitalbuffert	1,21