

2017-09-30

Startkapital 1 500

Uppgifter om kapitalbas

Aktiekapital 1 500

Reservfond 240

Balanserade vinstmedel 298 439

Summa 300 179

Kärnprimärkapital 300 179

Primärkapital 300 179

Totalt kapital 300 179

Uppgifter om kapitalkrav enligt fondlagstiftningen

125 000 EUR + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger 250 MEUR + 0,01 procent av fondförmögenheten i förvaltade specialfonder 12 129

14 403

Uppgifter om riskvägda exponeringsbelopp

Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden 515 753

Riskvägt exponeringsbelopp för valutakursrisk 47 469

Summa riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk och valutakursrisk 563 222

Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta omkostnader föregående år 604 703

Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 0,01 % av tillgångar i förvaltade specialfonder 52 549

Summa riskvägda exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta kostnader och 0,01% av tillgångar i förvaltade specialfonder 657 252

Kapitalrelationer

Kärnprimärkapitalrelation 49,64%

Primärkapitalrelation 49,64%

Total kapitalrelation 49,64%

Krav avseende kapitalbuffertar

Kapitalkrav kärnprimärkapital 4,50%

Kapitalkrav primärkapital 6,00%

Kapitalkrav totalt kapital 8,00%

Kontracyklisk kapitalbuffert 1,18%

Kapitalkonserveringsbuffert 2,50%

Lagstadgat totalkapitalkrav inklusive buffertkrav 11,68%

Totalkapitalrelation tillgängligt att använda som buffert 37,96%

Beräknad som Totalkapitalrelation minus lagstadgat kapitalkrav exklusive buffertkrav)

Kapitalbas

Kapitalbasen består endast av kärnprimärkapital. I bolagets kärnprimärkapital ingår aktiekapital, reservfond samt balanserade vinstmedel.

Kapitalkrav

De regulatoriska minimikapitalkraven är det högsta av följande:

- 125 000 EUR (startkapital) + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 miljoner euro + 0,01 procent av fondförmögenheten i förvaldade specialfonder.
- Summan av kapitalkraven för kredit- och marknadsrisker (eventuell valutakursrisk i balansräkningen)
- 25 procent av bolagets fasta omkostnader för det föregående året.

Kravet på att upprätthålla en kapitalkonserveringsbuffert är för närvarande 2,50 procent av riskvägt exponeringsbelopp. Reglerna om en kontracyklisk kapitalbuffert om 2,0 procent av riskvägt exponeringsbelopp för svenska exponeringar trädde ikraft 19 mars 2017. Kontracyklisk kapitalbuffert avseende andra exponeringar beräknas utifrån de procentsatser som beslutats av behörig myndighet i respektive jurisdiktion.

Beräkningsmetod

Bolaget tillämpar schablonmetoden vid beräkning av kreditrisker. Kreditrisk beräknas på alla tillgångsposter i och utanför balansräkningen som inte dras av från kapitalbasen.