

Offentliggörande av information angående kapitaltäckning

Cicero Fonder AB (556588-8731) offentliggör härmed periodisk information om kapitaltäckning. Upplysningar avseende periodisk information lämnas i enlighet med tillsynsförordningen, Finansinspektionens föreskrifter om tillsynskrav och kapitalbuffertar och Kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1423/2013 om tekniska standarder för genomförande med avseende på de upplysningskrav om kapitalbasen som gäller för institut enligt tillsynsförordningen. Ett fondbolag som utför diskretionär portföljförvaltning avseende finansiella instrument ska ha det eventuella ytterligare kapital för kreditrisker, marknadsrisker och operativa risker som enligt Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 av den 26 juni 2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och om ändring av förordning EU nr 648/2012, 2 kap. lagen (2014:968) om särskild tillsyn över kreditinstitut och värdepappersbolag och lagen (2014:966) om kapitalbuffertar krävs av ett värdepappersbolag med motsvarande verksamhet. Lag (2014:981).

Kapitalbas

Kapitalbasen består endast av kärnprimärkapital. I bolagets kärnprimärkapital ingår aktiekapital, balanserat resultat samt kapitalandelen av obeskattade reserver.

Kapitalkrav

Minimikapitalkravet beräknas på det högsta av följande:

- a) 125 000 euro (startkapital) + 0,02 procent av värdet på fondvolymen som överstiger motsvarande 250 miljoner euro.
- b) Summan av kapitalkraven för kreditrisker och marknadsrisker.
- c) 25 % av föregående års fasta kostnader.

Förutom ovan nämnda kapitalbaskrav ska institut hålla extra kärnprimärkapital i form av olika buffertar, utöver det så kallade Pelare 1-kravet. Reglerna om kapitalkonserveringsbuffertar innebär att samtliga institut påförs ett extra kapitalkrav om 2,5 procent av riskvägt belopp.

Beräkningsmetod

Bolaget tillämpar schablonmetoden vid beräkning av kreditrisk, vilket innebär att det finns sjutton exponeringsklasser med ett flertal olika riskvikter inom respektive klass.

Minimikrav för kapitalrelationen är 8 % plus kapitalbufferten om 2,5 %, dvs. totalt 10,5 %.

Från kvartal 4 2016 rapporteras kapitaltäckning för konsoliderad situation med moderbolaget Cicero Holding AB (556693-9921) enligt beslut från Finansinspektionen.

CICERO FONDER

Offentliggörande av information ang. kapitaltäckning	Cicero Fonder AB	Cicero Holding AB konsoliderad situation
(TSEK)	2017-09-30	2017-09-30
Uppgifter om kapitalbas		
Kärnprimärkapital	20 994	21 065
Primärkapital	20 994	21 065
Supplementärkapital	0	0
Total kapitalbas	20 994	21 065
Riskvägda exponeringsbelopp		
Kreditrisk (schablonmetoden)	28 228	28 132
Kostnadsrisk (baseras på 25 % av fasta kostnader)	88 963	88 963
Riskvägt exponeringsbelopp	88 963	88 963
Kapitalkrav		
Kostnadsrisk	7 117	7 117
Buffertkrav (2,5 %)	2 224	2 224
Verksamhetens kapitalkrav	9 341	9 341
Kapitalkrav enligt fondlagstiftningen		
125 000 EUR + 0,02 % av fondvolym över 250 miljoner EUR	2 192	2 192
Kapitalrelationer		
Kärnprimärkapitalrelation (lägst 4,5 %)	23,6%	23,7%
Primärkapitalrelation (lägst 6 %)	23,6%	23,7%
Total kapitalrelation (lägst 8 %)	23,6%	23,7%
Lagstadgat totalkapitalkrav inkl. buffert (lägst 10,5 %)	23,6%	23,7%