

Skandia Investment Management AB 556606-6832

INFORMATION OM KAPITALTÄCKNING

Rapporten innehåller information om kapitaltäckning i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd om offentliggörande av information om kapitaltäckning och riskhantering (FFFS 2007:5), benämnt Pelare 3. Termer och uttryck har anpassats till tillsynsförordning (575/2013/EU) som trädde i kraft vid årsskiftet.

Minimikrav på kapital - Pelare I			
Kapitaltäckningsmått	2014-06-30	2013-12-31	2013-06-30
Total kapitalrelation ¹	25,99%	30,45%	31,11%
Primärkapitalrelation ²	25,99%	30,45%	31,11%
Kärnprimärkapitalrelation ³	25,99%	30,45%	31,11%
Kapitaltäckningskvot ⁴	3,25	3,81	3,89
Kapitalbas⁵			
Kärnprimärkapital: instrument och reserver	80 492	86 702	90 059
Aktiekapital	7 000	7 000	7 000
Balanserade vinstmedel	73 472	79 682	83 039
<i>Varav periodens förlust som ej verifierats</i>	<i>-6 210</i>	<i>-3 357</i>	<i>-160</i>
Reservfond	20	20	20
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar	-1 922	-192	-46
Uppskjuten skattefordran	-1 864	-192	-46
Ytterligare värdejusteringar för poster till verkligt värde	-58	-	-
Totalt kärnprimärkapital^{5.1}	78 571	86 510	90 014
Primärkapitaltillskott: instrument	-	-	-
Totalt primärkapital	78 571	86 510	90 014
Supplementärkapital: instrument och avsättningar	-	-	-
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	78 571	86 510	90 014

Skandia Investment Management AB är ett helägt dotterbolag till Livförsäkringsbolaget Skandia, ömsesidigt. Bolaget är ett värdepappersbolag och står under Finansinspektionens tillsyn.

Adress: Lindhagensgatan 86, 106 55 Stockholm

Telefon: 08-788 10 00

Styrelsens säte: Stockholm, Organisationsnummer: 556606-6832

www.skandia.se

Riskvägda exponeringar	2014-06-30	2013-12-31	2013-06-30
Kreditrisk enligt schablonmetoden	22 758	12 554	17 840
Operativ risk enligt basmetoden	279 544	271 535	271 535
Totala riskvägda exponeringar⁶	302 301	284 089	289 374
Totalt kapitalbaskrav⁷			
Kreditrisk enligt schablonmetoden	1 821	1 004	1 427
Operativ risk enligt basmetoden	22 364	21 723	21 723
Minimikapitalkrav i Pelare 1	24 184	22 727	23 150
Startkapital 6 096 KSEK⁸			

	2014-06-30	2014-06-30	2014-06-30	2013-12-31	2013-12-31	2013-12-31
Exponeringar för kreditrisk per exponeringsklass	Exponeringsbelopp ⁹	Riskvägda exponeringar ⁶	Totalt kapitalbaskrav ⁷	Exponeringsbelopp ⁹	Riskvägda exponeringar ⁶	Totalt kapitalbaskrav ⁷
Exponeringar mot nationella regeringar och centralbanker	127	-	-	-	-	-
Exponeringar mot delstatliga och lokala självstyrelseorgan	-	-	-	-	-	-
Exponeringar mot offentliga organ	-	-	-	-	-	-
Exponeringar mot multilaterala utvecklingsbanker	-	-	-	-	-	-
Exponeringar mot internationella organisationer	-	-	-	-	-	-
Exponeringar mot institut	23 703	4 741	379	22 132	4 426	354
Exponeringar mot företag	11 681	11 488	919	826	826	66
Exponeringar mot hushåll	-	-	-	-	-	-
Exponeringar säkrade genom panträtt i fastigheter.	-	-	-	-	-	-
Fallerande exponeringar	-	-	-	-	-	-
Exponeringar som är förenade med särskilt hög risk	-	-	-	-	-	-
Exponeringar i form av säkerställda obligationer	58 003	5 800	464	69 100	6 910	553
Poster som avser positioner i värdepapperisering	-	-	-	-	-	-
Exponeringar mot institut och företag med ett kortfristigt kreditbetyg	-	-	-	-	-	-
Exponeringar i form av andelar eller aktier i företag för kollektiva investeringar	-	-	-	-	-	-
Aktieexponeringar	-	-	-	-	-	-
Övriga poster	728	728	58	392	392	31
Summa	94 241	22 758	1 821	92 450	12 554	1 004

Skandia Investment Management AB är ett helägt dotterbolag till Livförsäkringsbolaget Skandia, ömsesidigt. Bolaget är ett värdepappersbolag och står under Finansinspektionens tillsyn.

Adress: Lindhagensgatan 86, 106 55 Stockholm

Telefon: 08-788 10 00

Styrelsens säte: Stockholm, Organisationsnummer: 556606-6832

www.skandia.se

Beskrivning av kvantitativ information

1 Total kapitalrelation

Kapitalbas i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 8 procent. Motsvarar begreppet kapitaltäckningsgrad till och med 31 december 2013.

2 Primärkapitalrelation

Primärt kapital i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 6 procent.

3 Kärnprimärkapitalrelation

Kärnprimärkapital i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 4,5 procent före buffertkrav.

4 Kapitaltäckningskvot

Kvoten av kapitalbas och totalt minimikrav på kapital.

5 Kapitalbasen fördelas på primärkapital och supplementärkapital. Primärkapital består av kärnprimärkapital och övrigt primärkapital.

5.1 Kärnprimärkapitalet består av eget kapital reducerat för poster som inte får medräknas i kapitalbasen som immateriella tillgångar, uppskjutna skattefordringar, orealiserade förluster avseende värdepapper klassificerade som finansiella tillgångar som kan säljas och prisjusteringar. Avdrag från kärnprimärkapitalet för prisjusteringar ska göras då en försiktigare värdering anses nödvändig för poster värderade till verkligt värde, vilka inte redan exkluderas från kapitalbasen.

6 Med riskvägda exponeringar avses exponeringar som multiplicerats med en riskvikt för att åskådliggöra risken i åtagandet. Med exponering avses poster i och utanför balansräkningen. Enligt regelverket föreligger inte begreppet riskvägda exponeringar för valutakursrisk och operativ risk utan kapitalkravet åsätts dessa risker explicit. För att åskådliggöra beräkningen av kapitalkrav har dessa risker omvandlats till riskvägda exponeringar.

7 Kapitalbaskrav avser 8 % av riskvägda exponeringar.

8 I enlighet med Lag (2007:528) om värdepappersmarknaden ska ett värdepappersbolag som ska driva verksamhet som avses i 2 kap 1 § 3, 6 och 9, inneha ett startkapital uppgående till 730 tusen euro vid tidpunkt för erhållet tillstånd.

9 Med exponeringar avses exponeringar i balansräkningen efter reservering för kreditförluster samt åtaganden utanför balansräkningen.

Skandia Investment Management AB är ett helägt dotterbolag till Livförsäkringsbolaget Skandia, ömsesidigt. Bolaget är ett värdepappersbolag och står under Finansinspektionens tillsyn.

Adress: Lindhagensgatan 86, 106 55 Stockholm

Telefon: 08-788 10 00

Styrelsens säte: Stockholm, Organisationsnummer: 556606-6832

www.skandia.se