



Kapitaltäckning – 2017 Q4

Tundra Fonder AB omfattas av tillsynsförordningen EU nr 575/2013 (CRR). Information i detta dokument lämnas i enlighet med förordningen (EU) 575/2013 samt FFFS 2014:12 om tillsynskrav och kapitalbuffertar.

	2017-12-31
Inbetalt aktiekapital	2 968 790
Balanserade vinstmedel	6 129 537
Årets resultat	-2 740 711
Kärnprimärkapital	6 357 616
Övrigt Primärkapital	-
Supplementärt kapital	-
Total kapitalbas	6 357 616

Tundra Fonder ABs kapitalbas består enbart av kärnprimärkapital. De regulatoriska minimikapitalkraven är det högsta av följande: summan av kapitalkraven för kreditrisk och marknadsrisk eller 25% av bolagets fasta omkostnader för det föregående året. Det föreligger inga materiella eller rättsliga hinder för en snabb överföring av medel ur kapitalbasen.

<i>Kreditrisk enligt schablonmetoden</i>	2017-12-31
Exponering mot institut	1 933 594
Exponeringar mot företag	707 852
Exponeringar mot fonder	4 617 060
Övrig exponering	43 297
Summa kreditrisk	7 301 802
 <i>Marknadsrisk</i>	 2017-12-31
<i>Valuta</i>	
<i>Tillgångar</i>	
Fonder noterade i annan valuta än SEK	5 558
Likvida bankmedel i annan valuta än SEK	279 337
	284 895
 <i>Skulder</i>	 0
Summa marknadsrisk	284 895
 Riskvägt exponeringsbelopp avseende kreditrisk och marknadsrisk	 7 586 697



2017-12-31

Total riskvägt exponeringsbelopp, beräknat som 25% av de fasta omkostnaderna multiplicerat med 12,5. Enligt art 92, 95-97 (EU) förordning 575/2013.

52 932 128

(Enligt art. 95 (EU) förordning 575/2013 ska totalt riskvägt exponeringsbelopp utgöras av det största av beloppet för kreditrisk och kostnadsrisk)

Kapitalkrav, beräknad som 8 procent av det högsta av totalt riskvägt exponeringsbelopp och kredit- och marknadsriskeponering
Överskott av kapital

4 234 570

2 123 046

*Lägsta nivå
enligt
art. 92*

2017-12-31 (EU) 575/2013

Kärnprimärkapitalrelation

12,01%

4,5%

(Kärnprimärkapital i relation till totala riskvägda exponeringsbeloppet)

Primärkapitalrelation

12,01%

6%

(Primärkapital i relation till totala riskvägda exponeringsbeloppet)

Total kapitalrelation

12,01%

8%

(Kapitalbas i relation till totala riskvägda exponeringsbeloppet)

(som 2,5% av det totala riskvägda exponeringsbeloppet enligt art 129 Europaparlamentets och rådets direktiv 2013/36/EU)

1 323 303

Totalt kärnkapitalkrav inklusive buffertkrav

7,0%

-varav: kapitalkonserveringsbuffert

2,5%

Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav

10,5%

Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert: 7,51%.

I enlighet med art 92, 95-97 (EU) förordning 575/2013 beräknar Tundra Fonder AB kapitalkravet med utgångspunkt från föregående års fasta omkostnader, vilka beräknades uppgå till 16 938 281 kr.