



Skandia Investment Management AB 556606-6832

INFORMATION OM KAPITALTÄCKNING

Periodisk information i enlighet med lagen om Kapitaltäckning och stora exponeringar samt Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2007:5) om offentliggörande av periodisk information om kapitaltäckning. Informationen publiceras på Skandias hemsida.

Kapitaltäckningsanalys	2014-03-31	2013-12-31
Kapitaltäckningsmått		
Kapitaltäckningsgrad ¹	27,66%	30,45%
Primärkapitalrelation ²	27,66%	30,45%
Kapitaltäckningskvot ³	3,46	3,81
Kapitalbas⁴		
Eget kapital	83 908	86 702
Föreslagen utdelning	-	-
Primärt kapital brutto^{4.1}	83 908	86 702
Ytterligare värdejusteringar för poster till verkligt värde	-69	-
Avgår uppskjuten skattefordran	-927	-192
Primärt kapital netto^{4.2}	82 912	86 510
Totalt supplementärt kapital	-	-
Kapitalbas	82 912	86 510
Riskvägda exponeringar / underlag för beräkning av kapitalkrav⁵		
Kreditrisk enligt schablonmetoden	20 192	12 554
Operativ risk enligt basmetoden	279 544	271 535
Totalt riskvägda exponeringar	299 736	284 089
Kapitalkrav⁶		
Kreditrisk enligt schablonmetoden	1 615	1 004
Operativ risk enligt basmetoden	22 364	21 723
Totalt minimikapitalkrav	23 979	22 727

Startkapital 6 096 KSEK⁷

Skandia Investment Management AB är ett helägt dotterbolag till Liförsäkringsbolaget 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, Orgnummer: 556606-6832

www.skandia.se

	2014-03-31	2014-03-31	2014-03-31	2013-12-31	2013-12-31	2013-12-31
Exponeringar för kreditrisker per exponeringsklass	Exponeringar ⁸	Riskvägda tillgångar ⁵	Kapitalkrav ⁶	Exponeringar ⁸	Riskvägda tillgångar ⁵	Kapitalkrav ⁶
1 Exponeringar mot stater och centralbanker	53	-	-	-	-	-
2 Exponeringar mot kommuner och därmed jämförlig samfällighet samt myndigheter	-	-	-	-	-	-
3 Exponeringar mot administrativa organ, icke-kommersiella företag, trossamfund	-	-	-	-	-	-
4 Exponeringar mot multilaterala utvecklingsbanker	-	-	-	-	-	-
5 Exponeringar mot internationella organisationer	-	-	-	-	-	-
6 Institutsexponeringar	19 411	3 882	311	22 132	4 426	354
7 Företagsexponeringar	8 666	8 501	680	826	826	66
8 Hushållsexponeringar	-	-	-	-	-	-
9 Exponeringar mot säkerhet i fastighet	-	-	-	-	-	-
10 Oreglerade poster	-	-	-	-	-	-
11 Högriskposter	-	-	-	-	-	-
12 Exponeringar i form av säkerställda obligationer	69 193	6 919	554	69 100	6 910	553
13 Positioner i värdepappersiseringar	-	-	-	-	-	-
14 Exponeringar mot fonder	-	-	-	-	-	-
15 Övriga poster	889	889	71	392	392	31
Totalt	98 214	20 192	1 615	92 450	12 554	1 004

Skandia Investment Management AB är ett helägt dotterbolag till Liförsäkringsbolaget 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, Orgnummer: 556606-6832

www.skandia.se

Beskrivning av kvantitativ information

1 Kapitältäckningsgrad

Kapitalbas i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 8 procent.

2 Primärkapitalrelation

Primärt kapital i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 4 procent.

3 Kapitältäckningskvot

Med kapitältäckningskvot avses kapitalbas i förhållande till totalt minimikrav på kapital.

4 Kapitalbasen fördelas på primärt kapital (Tier 1) och supplementärt kapital (Tier 2). Därutöver reduceras primärt och supplementärt kapital för negativt netto av aktuariella vinster och förluster. Primärt kapital skall uppgå till minst 50 procent av totalt primärt och supplementärt kapital. Supplementärt kapital avser eviga och tidsbundna förlagslån. De tidsbundna förlagslånen får högst uppgå till 50 procent av primärt kapital

4.1 Primärt kapital brutto avser eget kapital enligt balansräkning per den 31 december inklusive minoritetsintressen samt av styrelsen föreslagen disposition av årets resultat vilken tillförs eget kapital.

4.2 Primärt kapital netto avser primärt kapital brutto med avdrag för orealiserade förluster för aktier klassificerade som finansiella tillgångar som kan säljas, orealiserade vinster medräknas i supplementärt kapital. Orealiserade vinster och förluster avseende räntebärande värdepapper klassificerade som finansiella tillgångar som kan säljas exkluderas och medräknas inte i kapitalbasen. Andra avdrag avser immateriella tillgångar och uppskjutna skattefordringar.

5 Med riskvägda exponeringar avses åsatt värde på en exponering. Med exponering avses poster i och utanför balansräkningen. Koncerninterna exponeringar ingår, exklusive aktieinnehav i dotterföretag och där motparten står under Finansinspektionens tillsyn.

Enligt regelverket föreligger inte begreppet riskvägda exponeringar för valutakursrisk och operativ risk utan kapitalkravet åsatts dessa risker explicit. För att åskådliggöra beräkningen av kapitalkrav har dessa risker omvandlats till riskvägda exponeringar.

6 Kapitalkrav avser 8 % av riskvägda exponeringar.

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

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

Skandia Investment Management AB är ett helägt dotterbolag till Liförsäkringsbolaget 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, Orgnummer: 556606-6832

www.skandia.se