



CAPTOR

Information om kapitaltäckning och likviditet

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar samt föreskrifter om hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag (FFFS 2010:7) skall följande information lämnas varje kvartal för Captor Investment Management AB (556970-2243).

Kapitaltäckning och likviditet, 2018-09-30

Kapitalbas	
Aktiekapital	1 000 000
Balanserat resultat	12 256 999
Periodens resultat	-7 049 791
Summa kapitalbas	6 207 208
Kärnprimärkapital	6 207 208
Primärkapital	6 207 208
Totalt kapital	6 207 208
Riskvägda exponeringsbelopp	
Kreditrisk enligt schablonmetoden	2 799 323
- varav institutioner	1 161 806
- varav övriga	1 637 517
Marknadsrisk	0
Summa riskvägt exponeringsbelopp för kredit- och marknadsrisk	2 799 323
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25% av fasta omkostnader föreg år	44 453 032
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	44 453 032
Kapitalkrav	
Kreditrisk	223 946
Marknadsrisk	0
Summa kapitalkrav kredit och marknadsrisk	223 946
Kapitalkrav fasta omkostnader	3 556 243
Totalt kapitalkrav pelare 1	3 556 243

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	223 946
Marknadsrisk	0
Operativ risk	300 000
- varav kapitalkrav pelare 2	300 000
Övrigt	3 332 297
Summa internt bedömt kapitalbehov	3 856 243

Kapitalrelationer och buffertar

Kärnprimärkapitalrelation	14.0%
Primärkapitalrelation	14.0%
Total kapitalrelation	14.0%
Total kapitalrelation inkl. pelare 2	12.9%
Kapitalkonserveringsbuffert	2.5%
Totalt kapitalkrav inkl. buffertkrav	10.5%
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert ¹	7.0%

Likviditet

Likviditetsreserv (kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut)	5 809 030
Limit	1 000 000
Likviditetskvot ²	1.5

¹ I förhållande till minimikravet om en kärnprimärkapitalrelation om 4.5% + buffertkravet om 2.5%

² Likviditetskvot = likvida medel / tre senaste månadernas kostnader