

Enligt Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar, Europaparlamentets och rådets förordning nr 575/2013 (CRR) samt Kommissionens genomförande förordning (EU) nr 1423/2013 ska Volt Capital Management AB offentliggöra periodisk information avseende bolagets kapitaltäckning samt riskhantering.

Kapitalbas

Kapitalbasen består enbart av kärnprimärkapital. I bolagets kärnprimärkapital ingår aktiekapital, reservfond, aktieägartillskott, balanserat resultat, samt periodens förlust.

Kapitalkrav

Det regulatoriska minimikapitalkraven är det högsta av följande:

- 125 000 EUR (startkapital) + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 miljoner euro.

samt

- det högsta av summan av kapitalkraven för kreditrisker och marknadsrisker gentemot 25 procent av bolagets fasta omkostnader för det föregående året.

Kravet på att upprätthålla en kapitalkonserveringsbuffert på 2,5 % gäller sedan den 2 augusti 2014.

Beräkningsmetod

Bolaget tillämpar schablonmetoden vid beräkning av kreditrisk, vilket innebär att det finns sjutton exponeringsklasser med ett flertal olika riskvikter inom respektive klass. Kreditrisk beräknas på alla tillgångsposter i och utanför balansräkningen som inte dras av från kapitalbasen.

Volt Capital Management AB	2017-03-31
Kärnprimärkapital	3 965 963
Total Kapitalbas	3 965 963
25% av fasta omkostnader	769 735
Minimumnivå 125 000 EUR	1 250 000
Kapitalkrav skadeståndsansvar 0,05% av fondvärdet	225 250
Summa riskviktat exponeringsbelopp (kreditrisk och marknadsrisk)	876 388
varav riskviktat exponeringsbelopp kreditrisk enligt schablonmetoden:	
institut	779 267
företag	97 122
varav riskviktat exponeringsbelopp marknadsrisk	0
Kärnprimärkapitalrelation	32,68%
Total kapitalrelation	32,68%
Lagstadgade krav	
Kärnprimärkapitalrelation	4,50%
Primärkapitalrelation	6,00%
Total kapitalrelation	8,00%

Kapitalkonserveringsbuffert	2,50%
Lagstadgad kärnprimärkapitalrelation inkl buffertkrav	7,00%
Kärnprimärkapital tillgängligt som buffert	3 419 934
Kärnprimärkapital tillgängligt som buffert (inkl kapitalkonserveringsbuffert)	3 237 924
Totalt kapital tillgängligt som buffert (inkl kapitalkonserveringsbuffert)	2 995 244