

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisker 2016-03-31 i TeliaSonera Finance AB

TeliaSonera Finance AB (org.nr. 556404-6661) är ett helägt dotterbolag till TeliaSonera AB publ. (org.nr 556103-4249) med säte i Stockholm. Bolaget startade sin verksamhet 1990. Bolaget har filialer i Danmark, Finland och Norge.

Vår huvudsakliga verksamhet är finansiering, paketering och fakturering av koncernens investeringar kopplat till specifika kundavtal. Vår roll som internt finansbolag är att stärka och utveckla TeliaSoneras affär med finansieringslösningar.

Inledning

Rapporten innehåller periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisker. Informationen lämnas på TeliaSonera Finance hemsida avseende den 31 mars, 30 juni, 30 september, 31 december, i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter om offentliggörande av information, FFFS 2014:12 om tillsynskrav och kapitalbuffertar samt FFFS 2010:7 om hantering och offentliggörande av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag. Termer och uttryck har anpassats till tillsynsförordningen (575/2013/EU) och genomförandeförordningen (1423/2013/EU). Samtliga belopp visas i tiotusentals svenskakronor (KSEK) om inte annat särskilt anges.

Kapitaltäckning

Kapitalbas

| | KSEK |
|---|----------------|
| Kärnprimärkapital | |
| Kapitalinstrument | 45 000 |
| - Varav: aktiekapital | 45 000 |
| Ej utdelade vinstmedel | 505 649 |
| Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar | 550 649 |
| Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar | |
| Uppskjuten skattefordran | -12 081 |
| Immateriella tillgångar | -9 113 |
| Värdering valutaterminer | 0 |
| Kärnprimärkapital efter lagstiftningsjusteringar | 529 455 |
| Primärkapitaltillskott | - |
| Primärkapital | 529 455 |
| Supplementärkapital | - |
| Total kapitalbas | 529 455 |

Kapitalrelationer

| | Kapitalrelation | Överskott/ underskott |
|-------------------|-----------------|--------------------------|
| Kärnprimärkapital | 18,47 % | 400 460 |
| Primärkapital | 18,47 % | 357 462 |
| Totalt kapital | 18,47 % | 300 131 |

Kapitalbuffertar

| | Buffertvärde | Buffert |
|--|--------------|---------|
| Institutspecifika buffertkrav | 7,79 % | 223 305 |
| Kapitalkonserveringsbuffert | 2,5 % | 71 664 |
| Kontracyklisk kapitalbuffert | 0,79 % | 22 593 |
| Kapitalplaneringsbuffert | 1 % | 28 666 |
| Kärnprimärkapital tillgängligt som buffert | 13,97 % | 400 458 |
| Systemriskbuffert | - | - |

Riskvägt exponeringsbelopp och kapitalbaskrav

| | Riskvägt exponerings- belopp | Kapital- baskrav |
|---------------|------------------------------------|---------------------|
| Kreditrisk | 2 384 909 | 190 793 |
| Operativ risk | 450 271 | 36 022 |
| Valutarisk | 31 374 | 2 510 |
| Totalt | 2 866 554 | 229 325 |

Riskvägt exponeringsbelopp och kapitalbaskrav för kreditrisk per exponeringsklass

| Exponeringsklasser | Exponering | Riskvägt exponerings- belopp | Kapital- baskrav |
|----------------------|------------------|------------------------------------|---------------------|
| Stat | 602 268 | 482 | 39 |
| Kommun och Landsting | 320 256 | - | - |
| Trossamfund | 7 411 | 7 411 | 593 |
| Institutexponeringar | 22 240 | 4 448 | 356 |
| Företagsexponeringar | 873 685 | 623 136 | 49 851 |
| Hushållsexponeringar | 2 077 822 | 1 555 290 | 124 423 |
| Oreglerade poster | 4 502 | 6 753 | 540 |
| Övriga poster | 187 389 | 187 389 | 14 991 |
| Totalt | 4 095 573 | 2 384 909 | 190 793 |

Likviditetsrisk och finansiering

Finansieringskällor

Bolagets finansieras genom en beviljad checkräkningskredit från moderbolaget TeliaSonera AB.

| Checkkredit | KSEK | KUSD | KEUR | KDKK | KNOK |
|-------------|-----------|-------|--------|-------|-------|
| | 1 360 160 | 1 000 | 81 500 | 5 000 | 5 000 |

Likviditetsreserv

Likviditetsreserven består av tillgångar som står till TeliaSonera Finance AB:s förfogande. Tillgångarna är belåningsbara i centralbanker och är inte ianspråktaga som säkerheter. Nuvarande likviditetsreserv består av likvida tillgångar i form av svenska statsobligationer och innehavet är upptaget till aktuellt marknadsvärde med en riskvikt om 0 %.

| Likviditetsreserv | KSEK | KDKK | KNOK | KEUR | Summa (KSEK) |
|---|----------------|------|------|------|----------------|
| Kassa och tillgodohavanden hos och utlåning till centralbanker och stater | - | - | - | - | - |
| Tillgodohavanden hos andra banker, dagslån | - | - | - | - | - |
| Värdepapper emitterade eller garanterade av stater, centralbanker eller multilaterala utvecklingsbanker | 419 421 | - | - | - | 419 421 |
| Värdepapper eller garanterade av kommuner | - | - | - | - | - |
| Säkerställda obligationer emitterade av andra institut | - | - | - | - | - |
| Egna emitterade säkerställda obligationer | - | - | - | - | - |
| Värdepapper emitterade av icke-finansiella företag | - | - | - | - | - |
| Värdepapper emitterade av finansiella företag, exkl säkerställda obligationer | - | - | - | - | - |
| Övriga värdepapper | - | - | - | - | - |
| Summa (KSEK) | 419 421 | | | | 419 421 |

Likviditetsriskmått och nyckeltal

| | |
|--------------------------------|---------|
| Likviditetstäckningsgrad (LCR) | 81,10 % |
| Bruttosoliditet | 11,59 % |