

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisker 2015-09-30 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 tillsyns krav 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 före lagstiftningsjusteringar | 424 786 |
| Uppskjuten skattefordran | -5 508 |
| Immateriella tillgångar | -5 002 |
| Värdering valutaterminer | -718 |
| Kärnprimärkapital | 413 558 |
| Primärkapitaltillskott | - |
| Primärkapital | 413 558 |
| Supplementärkapital | - |
| Total kapitalbas | 413 558 |

Kapitalrelationer

| | Kapitalrelation | Överskott/ underskott |
|-------------------|-----------------|--------------------------|
| Kärnprimärkapital | 17,54 % | 307 452 |
| Primärkapital | 17,54 % | 272 084 |
| Totalt kapital | 17,54 % | 224 926 |

Kapitalbuffertar

| | Buffertvärde | Buffert |
|------------------------------|--------------|---------|
| Kapitalkonserveringsbuffert | 2,5 % | 60 290 |
| Kontracyklisk kapitalbuffert | 0,76 % | 18 331 |
| Systemriskbuffert | - | - |

Riskvägt exponeringsbelopp och kapitalbaskrav

| | Riskvägt exponerings- belopp | Kapital- baskrav |
|---------------|------------------------------------|---------------------|
| Kreditrisk | 1 931 083 | 154 486 |
| Operativ risk | 426 829 | 34 146 |
| Marknadsrisk | 53 707 | * |
| Totalt | 2 411 619 | 188 632 |

*Då kapitalbaskravet för marknadsrisken (4 297) understiger 2 % av kapitalbasen tas den inte upp i kapitalbasrapporten.

Riskvägt exponeringsbelopp och kapitalbaskrav för kreditrisk per exponeringsklass

| Exponeringsklasser | Exponering | Riskvägt exponerings- belopp | Kapital- baskrav |
|----------------------|------------------|------------------------------------|---------------------|
| Stat | 596 829 | 763 | 61 |
| Kommun och Landsting | 360 933 | - | - |
| Trossamfund | 6 826 | 6 826 | 546 |
| Institutexponeringar | 29 343 | 5 869 | 470 |
| Företagsexponeringar | 433 738 | 386 979 | 30 958 |
| Hushållsexponeringar | 1 516 041 | 1 137 031 | 90 962 |
| Oreglerade poster | 6 754 | 10 131 | 810 |
| Övriga poster | 578 147 | 383 484 | 30 679 |
| Totalt | 3 528 611 | 1 931 083 | 154 486 |

Likviditetsrisk och finansiering

Finansieringskällor

Bolagets finansieras genom en beviljad checkräkningskredit från moderbolaget TeliaSonera AB.

| Checkkredit | |
|-------------|-----------|
| KSEK | 1 210 000 |
| KUSD | 1 000 |
| KEUR | 81 500 |
| KDKK | 5 000 |
| KNOK | 5 000 |

Likviditetsreserv

Likviditetsreserven består av tillgångar som står till TeliaSonera Finance AB:s förfogande. Tillgångarna är belåningsbara i centralbanker och är inte ianspråkta 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 | 370 357 | - | - | - | 370 357 |
| 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) | 370 357 | | | | 370 357 |

Likviditetsriskmått och nyckeltal

| | |
|--------------------------------|---------|
| Likviditetstäckningsgrad (LCR) | 72,26 % |
| Bruttosoliditet | 11,18 % |