



Finansinspektionen
Box 7821
SE-103 97 Stockholm
[Brunnsgatan 3]
Tel +46 8 787 80 00
Fax +46 8 24 13 35
finansinspektionen@fi.se
www.fi.se

Anvisning 5 – Derivatrapportering för bolag som driver fondverksamhet

Bolag som driver fondverksamhet ska lämna fullständig information om derivatanvändningen i de värdepappersfonder som bolaget förvaltar. Uppgifterna som avser föregående kalenderår och ska ha kommit in till Finansinspektionen senast den 15 februari.

Bolaget ska rapportera in dessa uppgifter via Finansinspektionens webbtjänst, Periodisk rapportering, i den blankett som heter **Årsrapport derivat för bolag som driver fondverksamhet**. Kontakta rapporteringsenheten på Finansinspektionen för att få tillgång till webbtjänsten.

Blankettanvisningar

Typ av derivat A1:A7

Ange med ett kryss i cellen som motsvarar den eller de derivatinstrument bolaget som bedriver fondverksamhet använt under perioden. I kolumnerna för Termin ska både futures och forwards anges. Vad gäller produkter som innefattar derivat, bland andra konvertibler, garantier och strukturerade produkter, ska derivatkomponenten anges.

A8 Övrigt

Om bolaget satt minst ett kryss i kolumn 7–8 på raderna A1:A7 ska en utförlig fritext, beskriva vilken typ av derivatinstrument som använts och som klassificerats som övrigt.

A9 Kvalitativ bedömning av de risker som hänförs till derivatinstrument

Beskriv i fritext vilka underliggande risker som är förknippade med derivatinstrumenten som bolaget använt. Beskrivningen ska göras av varje typ av derivatinstrument.

A10 Kvalitativ beskrivning av fondbolagets metoder för riskbedömning av derivatinstrument

Beskriv i fritext vilka metoder för riskbedömning och kontroll som används för varje typ av derivatinstrument.

