

Finansinspektionens författningssamling



Utgivare: Finansinspektionen, Sverige, www.fi.se
ISSN 1102-7460

Föreskrifter om ändring i Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2013:9) om värdepappersfonder;

FFFS 2017:XX

Utkom från trycket
Ange datum

beslutade den xx månad 2017.

BOKFÖRINGSNÄMNDEN

Finansinspektionen föreskriver med stöd av 18 § 33 förordningen (2013:588) om värdepappersfonder att 33 kap. 9 § och rubriken närmast före 33 kap. 9 § Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2013:9) om värdepappersfonder ska ha följande lydelse.

Ink. 2017 -09- 13

33 kap.

Rapportering av innehav, avgifter och risker

9 § Ett fondbolag ska vid varje tidpunkt kunna visa en sammanställning av respektive värdepappersfonds innehav av sådana tillgångar som anges i lagen (2004:46) om värdepappersfonder, fondförmögenhet, övriga tillgångar och skulder som ingår i fonden, fondandelsvärde samt avgifter som tagits ur fonden.

Sammanställningen ska även innehålla information om hävstång, beräknad som summan av derivatinstrumentens underliggande exponerade värden, standardavvikelse och likviditetsprofil på fondens tillgångar. Om fondbolaget beräknar sammanlagd exponering med hjälp av en Value at Risk-modell ska även Value at Risk anges.

Sammanställningen ska upprättas på det sätt som närmare anges på Finansinspektionens webbplats.

Dessa föreskrifter träder i kraft den 1 januari 2018

ERIK THEDÉEN

Charlotte Jeppsson