

Finansinspektionens författningssamling

Utgivare: Gent Jansson, Finansinspektionen, Box 6750, 113 85 Stockholm.
Beställningsadress: Thomson Fakta AB, Box 6430, 113 82 Stockholm. Tfn 08-587 671 00, Fax 08-587 671 71.
Prenumerera också via e-post på www.fi.se.
ISSN 1102-7460

FFFS 2006:3

Utkom från trycket
den 5 maj 2006

Föreskrifter om ändring i Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2004:2) om investeringsfonder;

beslutade den 28 april 2006.

Finansinspektionen föreskriver med stöd av 1 § förordningen (2004:75) om investeringsfonder i fråga om Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2004:2) om investeringsfonder

dels att 17 kap. 1 och 3–6 §§ samt rubriken på kapitlet ska ha följande lydelse,

dels att det i föreskriften ska införas två nya paragrafer, 17 kap. 7 och 8 §§, närmast före 17 kap. 3, 4 och 6 §§ nya rubriker, samt en ny bilaga 15 av följande lydelse.

17 kap. Rapportering av investeringsfonders innehav av fondpapper m.m. och riskmått

Tillämpningsområde

1 § Detta kapitel gäller för följande företag

- bolag som erhållit tillstånd att bedriva fondverksamhet enligt 1 kap. 4 § lagen (2004:46) om investeringsfonder,
- annat institut under Finansinspektionens tillsyn som erhållit tillstånd att bedriva fondverksamhet som avser specialfonder enligt 1 kap. 5 § lagen (2004:46) om investeringsfonder,
- fondbolag som erhållit tillstånd att bedriva fondverksamhet enligt 11 § lagen (1990:1114) om värdepappersfonder eller tillstånd att bedriva annan näringsverksamhet enligt 3 § lagen om värdepappersfonder, och
- annat institut under Finansinspektionens tillsyn som erhållit tillstånd att bedriva annan näringsverksamhet enligt 3 § lagen (1990:1114) om värdepappersfonder.

2 § Företag enligt 1 § ska vid varje tidpunkt kunna visa en sammanställning över respektive fonds innehav av de tillgångar som anges i lagen (2004:46) om investeringsfonder (i detta kapitel finansiella instrument). Vid en sådan sammanställning ska *bilaga 9* användas.

Värdepappersfonder

3 § Företag enligt 1 § ska per sista bankdagen i varje kvartal upprätta en sammanställning över respektive värdepappersfonds innehav av finansiella instrument enligt *bilaga 10*.

Specialfonder

4 § Företag enligt 1 § ska per det datum Finansinspektionen anvisar, upprätta en sammanställning över respektive specialfonds eller nationell fonds innehav av finansiella instrument enligt bilaga 10.

5 § Företag enligt 1 § som förvaltar specialfonder eller nationella fonder, ska per den sista dagen varje månad beräkna och till Finansinspektionen redovisa fondens risknivå enligt följande:

1. standardavvikelse,
2. avkastningen senaste månaden, samt
3. koncentrationsrisk.

Uppgifterna ska rapporteras enligt *bilaga 15*.

Uppgifter till Finansinspektionen

6 § Uppgifterna som ska rapporteras enligt 3 § ska ha kommit in till Finansinspektionen senast den tionde dagen i efterföljande månad.

Rapporteringen enligt 5 § ska ha kommit in till myndigheten senast den tjugoförsta dagen i efterföljande månad.

7 § Uppgifterna ska avse varje enskild fond.

8 § Finansinspektionen beslutar om undantag från dessa föreskrifter om det finns särskilda skäl.

Dessa föreskrifter träder i kraft den 1 juli 2006. Första rapporteringstillfället avser uppgifter per den 30 juni 2006. Rapportering enligt 5 § ska för rapportdagen den 30 juni 2006 ske senast den 21 augusti 2006.

INGRID BONDE

Joakim Schaaf

RISKMÅTT INVESTERINGSFONDER

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

E-POSTADRESS

Rapporten ska skickas till Finansinspektionen

Belopp anges i tkr utan decimaler

A. RISKMÅTT

A1 Startdatum för fond

A2 Standardavvikelse 36 månader

A3 Standardavvikelse 12 månader

A4 Månadsavkastning

A5 Koncentration (5 största innehaven), summa % =

A6 Koncentration (5 största innehaven), specifikation %

Emittent	Procent
1	<input type="text"/>
2	<input type="text"/>
3	<input type="text"/>
4	<input type="text"/>
5	<input type="text"/>

Övriga riskmått

Dessa poster fylls i endast i de fall FI har meddelat särskild instruktion

Riskmått i procent

A7 Riskmått 1 %

A8 Riskmått 2 %

A9 Riskmått 3 %

A10 Riskmått 4 %

A11 Riskmått 5 %

A12 Riskmått 6 %

Riskmått i tkr

A13 Riskmått 7 tkr

A14 Riskmått 8 tkr

A15 Riskmått 9 tkr

A16 Riskmått 10 tkr

A17 Riskmått 11 tkr

A18 Riskmått 12 tkr