



**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 4 – Derivatrapportering för värdepappersfonder**

Ett bolag som driver fondverksamhet ska lämna information om derivatanvändningen för varje värdepappersfond som bolaget förvaltar. Uppgifterna ska avse föregående kalenderår och ska ha kommit in till Finansinspektionen senast den 15 februari.

Uppgifterna ska rapporteras via Finansinspektionens webbtjänst Periodisk rapportering, i den blankett som heter **Årsrapport derivat för värdepappersfonder**. 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 fonden 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.

#### **Kvantitativa begränsningar**

**A8** Här ska det värde som är lägst av begränsningarna för maximal sammanlagd exponering som finns i interna regler, fondbestämmelser, lag eller föreskrift anges.

**A9** Ange det värde som är lägst av begränsningarna för maximal nettoexponering som finns för fonden i interna regler eller fondbestämmelser.

**A10** Ange det värde som är lägst av begränsningarna för minsta tillåtna nettoexponering som finns för fonden i interna regler eller fondbestämmelser.