

Offentliggörande av information om kapitaltäckning

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2014:12 och allmänna råd, Europaparlamentets och rådets förordning nr 575/2013 (CRR) samt kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1423/2013 offentliggör Quesada Kapitalförvaltning AB periodisk information om kapitaltäckning. Information lämnas även för den konsoliderade situationen med moderbolaget Varenne AB och dess dotterbolag som uppfyller CRRs definition av finansiellt institut.

Kapitalbas

Kapitalbasen består av:

- Kärnprimärkapital vilket utgörs av eget kapital med avdrag för immateriella tillgångar och
- Supplementärkapital vilket utgörs av ett förlagslån från befintliga aktieägare

Lagstadgade kapitalkrav (Pelare I)

Det lagstadgade minimikapitalkravet är det högsta av följande:

- Summan av kapitalkraven för kreditrisker samt marknadsrisk
- 25% av bolagets fasta omskostnader

Minimikapitalkravet motsvarar en kapitalrelation om 8%, utöver detta tillkommer krav på kapitalkonserveringsbuffert om ytterligare 2,5% dvs totalt 10,5%.

Kapitalkraven/relationerna uttrycks som procent av riskexponeringsbelopp. Riskexponeringsbeloppet är det högsta av antingen den riskvägda exponeringen för kreditrisker och valutarisker eller 25% av bolagets fasta omskostnader multiplicerat med 12,5.

Tillkommande internt kapitalkrav (Pelare II)

Utöver det lagstadgade minimikravet ska Quesada även kapitaltäcka eventuellt kapitalbehov som tillkommer som ett resultat av den interna kapitalutvärderingen (IKU). Inget kapitalbehov tillkommer enligt IKU.

| Alla belopp i kr | Quesada Kapitalförvaltning AB | Konsoliderad situation |
|------------------|----------------------------------|---------------------------|
|------------------|----------------------------------|---------------------------|

Kapitalbas

Startkapital

Kärnprimärkapital

| | | |
|---------------------------------------|-------------------|---------------------|
| Aktiekapital | 2 000 000 | 5 273 160 |
| Bundna reserver | 4 000 000 | 46 596 030 |
| Balanserade vinstmedel | 30 917 689 | 494 468 025 |
| Förlust innevarande räkenskapsår | - | - |
| <u>Minoritetsintressen</u> | - | 70 625 160 |
| kärnprimärkapital före avdrag | 36 917 689 | 616 962 375 |
| Avdrag periodens negativa resultat | | |
| <u>Avdrag immateriella tillgångar</u> | <u>-3 606 648</u> | <u>-119 237 989</u> |
| kärnprimärkapital efter avdrag | 33 311 041 | 497 724 386 |

Supplementärkapital

| | | |
|--|-------------------|-----------------|
| <u>Förlagslån</u> | <u>3 000 000</u> | <u>750 000</u> |
| Supplementärkapital före avdrag | 3 000 000 | 750 000 |
| <u>Avdrag för återstående löptid <5år</u> | <u>-1 252 603</u> | <u>-313 151</u> |
| Supplementärkapital efter avdrag | 1 747 397 | 436 849 |

| | | |
|-------------------|------------|-------------|
| Kärnprimärkapital | 33 311 041 | 497 724 386 |
| Primärkapital | 33 311 041 | 497 724 386 |
| Totalt kapital | 35 058 438 | 498 161 235 |

Riskvägt exponeringsbelopp

| | | |
|---|-------------|-------------------|
| Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden | 36 437 279 | 829 093 514 |
| <u>Riskvägt exponeringsbelopp för valutarisk</u> | = | <u>73 296 997</u> |
| Summan av riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisk och valutarisk | 36 437 279 | 902 390 511 |
| | | |
| Riskvägt exponeringsbelopp baserat på fasta omkostnader | 244 503 125 | - |

Kapitalrelationer

Pelare I

| | | |
|--|------------|-------------|
| Kärnprimärkapitalrelation | 13,62% | 55,16% |
| Primärkapitalrelation | 13,62% | 55,16% |
| Total kapitalrelation | 14,34% | 55,20% |
| | | |
| Krav kärnprimärkapitalrelation | 4,5% | 4,5% |
| Krav Primärkapitalrelation | 6,0% | 6,0% |
| Krav Total Kapitalrelation | 8,0% | 8,0% |
| | | |
| Överskott av kärnprimärkapital | 22 308 400 | 457 116 813 |
| Överskott av primärkapital | 18 640 854 | 443 580 955 |
| Överskott av totalt kapital | 15 498 188 | 425 969 994 |
| | | |
| Krav kärnprimärkapitalrelation inklusive buffertkrav | 7,0% | 7,0% |
| Överskott av primärkapital mot buffertkrav | 16 195 822 | 434 557 050 |

Pelare II

| | | |
|---|------------|-------------|
| Tillkommande kapitalkrav för enligt pelare II | - | 4,75% |
| Totalt kapitalkrav inklusive pelare II | 10,5% | 15,25% |
| Överskott av kapital enligt pelare II | 29 485 127 | 360 127 881 |