

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 omkostnader 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 IKUn.

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

Kapitalbas

Startkapital

Kärnprimärkapital

Aktiekapital	2 000 000	5 273 160
Bundna reserver	6 380 949	57 045 772
Balanserade vinstmedel	29 025 704	586 420 770
Förlust innevarande räkenskapsår	-	-
<u>Minoritetsintressen</u>	-	73 254 238
kärnprimärkapital före avdrag	37 406 653	721 993 940
Avdrag periodens negativa resultat	-615 754	
<u>Avdrag immateriella tillgångar</u>	<u>-3 925 858</u>	<u>-119 557 200</u>
kärnprimärkapital efter avdrag	32 865 041	602 436 740

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>-1 550 137</u>	<u>-387 534</u>
Supplementärkapital efter avdrag	1 449 863	362 466

Kärnprimärkapital	32 865 041	602 436 740
Primärkapital	32 865 041	602 436 740
Totalt kapital	34 314 904	602 799 206

Riskvägt exponeringsbelopp

Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	22 257 248	811 445 058
<u>Riskvägt exponeringsbelopp för valutarisk</u>	=	<u>59 260 017</u>
Summan av riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisk och valutarisk	22 257 248	870 705 075
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på fasta omkostnader	251 108 959	-

Kapitalrelationer

Pelare I

Kärnprimärkapitalrelation	13,09%	69,19%
Primärkapitalrelation	13,09%	69,19%
Total kapitalrelation	13,67%	69,23%
Krav kärnprimärkapitalrelation	4,5%	4,5%
Krav Primärkapitalrelation	6,0%	6,0%
Krav Total Kapitalrelation	8,0%	8,0%
Överskott av kärnprimärkapital	21 565 138	563 255 012
Överskott av primärkapital	17 798 503	550 194 435
Överskott av totalt kapital	14 226 187	533 142 800
Krav kärnprimärkapitalrelation inklusive buffertkrav	7,0%	7,0%
Överskott av primärkapital mot buffertkrav	15 287 414	541 487 385

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	30 528 030	469 671 630