

## 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 kapitaltäckta 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	6 380 949	57 045 772
Balanserade vinstmedel	29 025 704	586 420 771
Förlust innevarande räkenskapsår	0	-
<u>Minoritetsintressen</u>	-	<u>69 972 471</u>
kärnprimärkapital före avdrag	37 406 653	718 712 174
Avdrag periodens negativa resultat	-3 508 442	
<u>Avdrag immateriella tillgångar</u>	<u>-4 063 021</u>	<u>-119 694 363</u>
kärnprimärkapital efter avdrag	29 835 190	599 017 811

#### 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 &lt;5år</u>	<u>-1 701 370</u>	<u>-425 343</u>
Supplementärkapital efter avdrag	1 298 630	324 658

Kärnprimärkapital	29 835 190	599 017 811
Primärkapital	29 835 190	599 017 811
Totalt kapital	31 133 820	599 342 469

## Riskvägt exponeringsbelopp

Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	29 941 465	827 238 703
<u>Riskvägt exponeringsbelopp för valutarisk</u>	-	<u>109 398 347</u>
Summan av riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisk och valutarisk	29 941 465	936 637 050
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på fasta omkostnader	251 108 959	317 921 875

## Kapitalrelationer

### Pelare I

Kärnprimärkapitalrelation	11,88%	63,95%
Primärkapitalrelation	11,88%	63,95%
Total kapitalrelation	12,40%	63,99%
Krav kärnprimärkapitalrelation	4,5%	4,5%
Krav Primärkapitalrelation	6,0%	6,0%
Krav Total Kapitalrelation	8,0%	8,0%
Överskott av kärnprimärkapital	18 535 287	556 869 144
Överskott av primärkapital	14 768 652	542 819 588
Överskott av totalt kapital	11 045 103	524 411 505
Krav kärnprimärkapitalrelation inklusive buffertkrav	7,0%	7,0%
Överskott av primärkapital mot buffertkrav	12 257 563	533 453 218

### Pelare II

Tillkommande kapitalkrav för enligt pelare II	-	4,8%
Totalt kapitalkrav inklusive pelare II	10,5%	15,2%
Överskott av kapital enligt pelare II	4 767 379	368 610 225

## Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass

Exponering mot stat och centralbank	-	-
Exponering mot institut	1 861 027	12 383 226
<u>Övriga poster</u>	<u>28 080 439</u>	<u>708 378 833</u>
Summa riskvägt exponeringsbelopp	29 941 466	720 762 059