

## 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 kapitaltäckta 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	7 148 865	57 045 772
Balanserade vinstmedel	28 702 524	595 617 965
Förlust innevarande räkenskapsår	-5 409 895	-
<u>Minoritetsintressen</u>	=	<u>67 843 497</u>
kärnprimärkapital före avdrag	32 441 494	725 780 394
Avdrag periodens negativa resultat		
<u>Avdrag immateriella tillgångar</u>	<u>-4 680 989</u>	<u>-120 312 331</u>
kärnprimärkapital efter avdrag	27 760 505	605 468 063

#### 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>-2 000 548</u>	<u>-500 137</u>
Supplementärkapital efter avdrag	999 452	249 863

Kärnprimärkapital	27 760 505	605 468 063
Primärkapital	27 760 505	605 468 063
Totalt kapital	28 759 957	605 717 926

## Riskvägt exponeringsbelopp

Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	27 487 978	756 132 175
<u>Riskvägt exponeringsbelopp för valutarisk</u>	=	<u>69 967 694</u>
Summan av riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisk och valutarisk	27 487 978	826 099 869
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på fasta omkostnader	255 945 847	317 921 875

## Kapitalrelationer

### Pelare I

Kärnprimärkapitalrelation	10,85%	73,29%
Primärkapitalrelation	10,85%	73,29%
Total kapitalrelation	11,24%	73,32%
Krav kärnprimärkapitalrelation	4,5%	4,5%
Krav Primärkapitalrelation	6,0%	6,0%
Krav Total Kapitalrelation	8,0%	8,0%
Överskott av kärnprimärkapital	16 242 942	568 293 569
Överskott av primärkapital	12 403 754	555 902 071
Överskott av totalt kapital	8 284 289	539 629 936
Krav kärnprimärkapitalrelation inklusive buffertkrav	7,0%	7,0%
Överskott av primärkapital mot buffertkrav	9 844 295	547 641 072

### 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	1 885 643	557 241 199

### Likviditet:

Likviditetsrisken är risken att inte kunna infria sina betalningsförpliktelser vid förfallotidpunkten utan att kostnad för att erhålla betalningsmedel ökar avsevärt. Risken begränsas

Quesada Kapitalförvaltning AB har en limit gällande Disponibel likviditet motsvarande 90 dagars fasta omkostnader.

Vid Balansdatumet överstiger Quesada Kapitalförvaltning AB limiten som uppgår till: **19 813 528**