

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	7 148 865	57 045 772
Balanserade vinstmedel	28 702 524	581 782 728
Förlust innevarande räkenskapsår	-6 579 846	-
<u>Minoritetsintressen</u>	=	<u>40 600 353</u>
kärnprimärkapital före avdrag	31 271 543	684 702 013
Avdrag periodens negativa resultat		
<u>Avdrag immateriella tillgångar</u>	<u>-4 737 860</u>	<u>-142 236 059</u>
kärnprimärkapital efter avdrag	26 533 683	542 465 954

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>-2 150 137</u>	<u>-537 534</u>
Supplementärkapital efter avdrag	849 863	212 466

Kärnprimärkapital	26 533 683	542 465 954
Primärkapital	26 533 683	542 465 954
Totalt kapital	27 383 546	542 678 420

Riskvägt exponeringsbelopp

Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	27 487 978	718 888 658
<u>Riskvägt exponeringsbelopp för valutarisk</u>	=	<u>63 203 220</u>
Summan av riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisk och valutarisk	27 487 978	782 091 878
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på fasta omkostnader	255 945 847	317 921 875

Kapitalrelationer

Pelare I

Kärnprimärkapitalrelation	10,37%	69,36%
Primärkapitalrelation	10,37%	69,36%
Total kapitalrelation	10,70%	69,39%
Krav kärnprimärkapitalrelation	4,5%	4,5%
Krav Primärkapitalrelation	6,0%	6,0%
Krav Total Kapitalrelation	8,0%	8,0%
Överskott av kärnprimärkapital	15 016 120	507 271 819
Överskott av primärkapital	11 176 932	495 540 441
Överskott av totalt kapital	6 907 878	480 111 070
Krav kärnprimärkapitalrelation inklusive buffertkrav	7,0%	7,0%
Överskott av primärkapital mot buffertkrav	8 617 473	487 719 523

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	509 232	494 201 692

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**