

**Periodisk information
om kapitaltäckning och likviditetsrisker
– Pelare 3**

31 december 2020

Quesada Kapitalförvaltning AB – Konsoliderad situation

Periodisk information om kapitaltäckning och likviditetsrisk

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:12) om offentliggörande av kapitaltäckning offentliggör Quesada Kapitalförvaltning AB, 556608-7994, dess konsoliderade situation, ("Quesada") periodisk information om kapitaltäckning. Uppgifterna offentliggörs i samband med kvartalsinrapportering och finns tillgänglig på Bolagets hemsida <https://www.quesada.se/>

Kapitalkrav beräknas i enlighet med Europaparlamentets och Rådets förordning (EU) 575/2013 ("CRR"), lagen om kapitalbuffertar (2014:966), lagen om införande av lagen om kapitalbuffertar (2014:967) och Finansinspektionens föreskrifter om tillsynskrav och kapitalbuffertar (FFFS 2014:12).

Beräkning av kapitalkravet nedan ska bestå av lagstadgat minimikapitalkrav för kreditrisker, marknadsrisker och operativa risker. Kapitalbehovet för kapitalbuffertar redogörs även för nedan under kapitalrelationer och kapitalbuffertar. Det kombinerade buffertkravet för Quesada utgörs av en kapitalkonserveringsbuffert som uppgår till 2,5 procent av riskvägda tillgångar.

Vid beräkning av kapitalkravet för operativ risk använder sig Quesada av fasta omkostnader. I metoden fasta omkostnader beräknas det totala riskvägda exponeringsbeloppet genom att multiplicera föregående års fasta omkostnader med 25% samt 12,5. Det totala riskvägda exponeringsbeloppet för fasta omkostnader jämförs sedan med det riskvägda exponeringsbeloppet för kredit- och marknadsrisk. Det högsta riskvägda beloppet av dessa multipliceras sedan med 8 procent för att få fram minimikapitalkravet för Quesada.

Kapitaltäckningsanalys

Kapitalbas	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Kärnprimärkapital: instrument och reserver			
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	5 273 865 kr	5 273 865 kr	5 273 865 kr
Aktiekapital	5 273 865 kr	5 273 865 kr	5 273 865 kr
Överkursfond	- kr	- kr	- kr
Ej utdelade vinstmedel	360 155 984 kr	359 607 296 kr	360 155 322 kr
Akkumulerat annat totalt resultat (och andra reserver)	58 840 031 kr	58 840 031 kr	58 840 031 kr
Delårsresultat som har verifierats av personer som har en oberoende ställning	- kr	- kr	- kr
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	424 269 880 kr	423 721 192 kr	424 269 218 kr
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar			
(-) Goodwill	- 36 852 627 kr	- 58 389 327 kr	- 57 242 015 kr
(-) Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder) (negativt belopp)	- 4 518 152 kr	- 4 878 838 kr	- 5 203 886 kr
Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet			- kr
Förluster för innevarande räkenskapsår	- 44 466 851 kr	- 63 697 660 kr	-61 566 262 kr
(-) Kvalificerande innehav utanför den finansiella sektorn			- kr
Minoritetsintressen (tillåtet belopp i konsoliderat kärnprimärkapital)	19 368 280 kr	21 997 017 kr	25 237 801 kr
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	357 800 530 kr	318 752 384 kr	-99 921 674 kr
Kärnprimärkapital	357 800 530 kr	318 752 384 kr	324 347 544 kr
Övrigt Primärkapital	- kr	- kr	- kr
Primärkapital	357 800 530 kr	318 752 384 kr	324 347 544 kr
Supplementärkapital: instrument och avsättningar			
Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	- kr	- kr	- kr
Supplementärkapital	- kr	- kr	- kr
Totalt kapital (totalt kapital= primärkapital + supplementärkapital)	357 800 530 kr	318 752 384 kr	324 347 544 kr
Totala riskvägda tillgångar	577 262 572 kr	586 945 216 kr	324 347 544 kr

Exponeringsbelopp	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Kredit- och motpartsrisk	739 991 912 kr	547 321 886 kr	515 609 065 kr
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr
Internationella organisationer			- kr
Institut	203 411 675 kr	77 271 004 kr	38 634 204 kr
Företag	26 609 520 kr	27 648 960 kr	27 526 320 kr
Hushåll	- kr	- kr	- kr
Aktieexponeringar	483 690 943 kr	416 564 810 kr	418 565 258 kr
Kortfristiga fordringar på institut och företag	- kr	- kr	kr
Företag för kollektiva investeringar (fond)	- kr	188 kr	141 188 kr
Övrigt	26 279 774 kr	25 695 924 kr	30 742 094 kr
Marknadsrisk	79 885 189 kr	87 369 539 kr	85 361 470 kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr
Totala exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	819 877 101 kr	634 691 424 kr	600 970 534 kr
Riskvägda exponeringsbelopp	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Kredit- och motpartsrisk	577 262 572 kr	499 575 677 kr	498 772 295
Nationella Regeringar	- kr	- kr	- kr
Kommuner	- kr	- kr	- kr
Internationella organisationer	- kr	- kr	kr
Institut	40 682 335 kr	29 454 201 kr	21 726 841 kr
Företag	26 609 520 kr	27 648 960 kr	27 526 320 kr
Hushåll	- kr	- kr	- kr
Aktieexponeringar	483 690 943 kr	416 776 592 kr	418 565 258 kr
Kortfristiga fordringar på institut och företag	- kr	- kr	kr
Företag för kollektiva investeringar (fond)			211 782 kr
Övrigt	26 279 774 kr	25 695 924 kr	30 742 094 kr
Marknadsrisk	79 885 189 kr	87 369 539 kr	85 361 470 kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr
Totala riskvägda exponeringsbelopp - Kredit- & marknadsrisk	657 147 761 kr	586 945 216 kr	584 133 765 kr
Fasta omkostnader	94 904 532 kr	94 904 532 kr	94 904 532 kr
Kapitalkrav (25%) av fasta omkostnader	23 726 133 kr	23 726 133 kr	23 726 133 kr
Totalt riskvägt exponeringsbelopp - Fasta omkostnader	296 576 663 kr	296 576 663 kr	296 576 663 kr

Kapitalkrav (Pelare 1)	2020-12-31	2020-09-30	2020-03-31
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	657 147 761 kr	586 945 216 kr	584 133 765 kr
Kredit- och motpartsrisk	46 181 006 kr	39 966 054 kr	39 901 784 kr
Marknadsrisk	6 390 815 kr	6 989 563 kr	6 828 918 kr
Operativ risk	- kr	- kr	- kr
Övrigt	- kr	- kr	- kr
Totalt kapitalkrav	52 571 821 kr	46 955 617 kr	46 730 701 kr

Internt bedömt kapitalbehov	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Kreditrisk och motpartsrisk	46 181 006 kr	39 966 054 kr	39 901 784 kr
Marknadsrisk	6 390 815 kr	6 989 563 kr	6 828 918 kr
Operativ risk	15 560 350 kr	15 560 350 kr	15 560 350 kr
Övrigt	13 142 955 kr	11 738 904 kr	11 682 675 kr
Totalt	81 275 126 kr	74 254 871 kr	73 973 727 kr

Tillkommande Pelare 2-krav	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Totalt tillkommande Pelare 2-krav	28 703 305 kr	27 299 254 kr	27 243 025 kr

Kapitalrelationer och buffertar	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Kärnprimärkapitalrelation	54,45%	54,31%	55,53%
Primärkapitalrelation	54,45%	54,31%	55,53%
Total kapitalrelation	54,45%	54,31%	55,53%
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	49,95%	49,81%	51,03%
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5% aktuell period)	16 428 694 kr	14 673 630 kr	14 603 344 kr
Kontracyklisk buffert (2%)	- kr	- kr	- kr
Kombinerat buffertkrav	16 428 694 kr	14 673 630 kr	14 603 344 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	69 000 514 kr	61 629 248 kr	61 334 045 kr
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav och tillkommande Pelare 2 krav	97 703 819 kr	88 941 405 kr	88 577 071 kr
Överskottskapital (CET1)	328 228 881 kr	292 339 849 kr	298 061 520 kr
Överkottskapital (Totalt)	260 096 711 kr	229 810 979 kr	235 770 473 kr

Likviditetsrisk och finansiering

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:21) 5 kap. 9 § om hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag offentliggör Quesada Kapitalförvaltning AB ("Quesada") kvartalsvis periodisk information om sina likviditetspositioner. Uppgifterna offentliggörs i samband med kvartalsinrapportering och finns tillgänglig på Quesadas hemsida <https://www.quesada.se/>

Likviditet	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Likviditetsreserv	28 411 657 kr	59 771 004 kr	21 134 204 kr
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut	28 411 657 kr	57 771 004 kr	21 134 204 kr
Finansiering			
Eget kapital	399 171 309 kr	382 020 549 kr	387 940 757
Skulder	206 756 108 kr	210 993 912 kr	173 210 485
Balansomslutning	605 927 417 kr	593 014 491 kr	561 151 242
Nyckeltal	2020-12-31	2020-09-30	2020-06-30
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / Balansomslutning	4,69%	10,08 %	3,77 %
Eget kapital / Balansomslutning	65,88 %	64,42 %	69,13 %
Kassa och tillgodohavande hos kreditinstitut / kortfristiga skulder	57,64%	117,92 %	155,97 %