

EXCALIBUR ASSET MANAGEMENT AB

OFFENTLIGGÖRANDE AV INFORMATION OM KAPITALTÄCKNING

Bakgrund

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12), Europaparlamentets och rådets förordning nr 575/2013 (CRR) samt Kommissionens genomförandeförordning (EU) nr 1423/2013 offentliggör Excalibur Asset Management AB (556677-7396) härmed information om kapitaltäckning.

Kapitalkrav

Det regulatoriska minimikapitalkravet är det högsta av följande:

- 125 000 EUR (startkapital) + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 miljoner EUR.
- 25 procent av bolagets fasta kostnader för det föregående året.
- Summan av kapitalkrav för kreditrisk och marknadsrisk.

I tillägg till ovanstående har Bolaget enligt Lagen om alternativa investeringsfonder (LAIF) valt att täcka sina skadeståndsansvarsrisker med extra medel i kapitalbasen. Kravet är 0,1% av värdet av de fonder bolaget förvaltar och uppgår per sista juni 2016 till 1 840 TSEK.

Sedan augusti 2014 finns också krav att upprätthålla en kapitalkonserveringsbuffert på 2,5 procent.

Kapitalbas

Kapitalbasen består enbart av kärnprimärkapital. I bolagets kärnprimärkapital ingår aktiekapital, balanserat resultat samt kapitalandelen av bolagets obeskattade reserver.

Beräkningsmetod

Bolaget tillämpar schablonmetoden vid beräkning av kreditrisk. Detta innebär att det finns sjutton exponeringsklasser med ett flertal olika riskvikter inom riskvikter inom respektive klass. Kreditrisk beräknas på alla tillgångsposter i och utanför balansräkningen som inte dras av från kapitalbasen.

Kravet på lägsta kapitalrelation är 8 procent plus en kapitalkonserveringsbuffert på 2,5 procent. Det vill säga totalt 10,5 procent. Bolaget har en total kapitalrelation på 29,57 procent.

EXCALIBUR ASSET MANAGEMENT AB

Information om kapitalbasen (TSEK)	2016-09-30
Aktiekapital	1 250
Balanserat resultat	1 882
Kapitalandel av obeskattade reserver	17 914
Kärnprimärkapital	21 046
Primärkapital	-
Supplementärkapital	-
Total kapitalbas	21 046

Det regulatoriska minimikravet är det högsta av följande:

Riskvägda exponeringsbelopp (TSEK) 2016-09-30

Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta kostnader 67 363

Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisk, schablonmetoden 24 543

Riskvägda exponeringar för kreditrisk per exponeringsklass

- Exponering mot institut 1 566
- Exponering mot företag 2 866
- Exponering mot hushåll 0
- Exponering mot fonder 19 627
- Övriga poster 484

Summa riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisker 24 543

Totalt riskvägt belopp 67 363

Kärnprimärkapitalrelation 31,24 %

Primärkapitalrelation 31,24 %

Totalkapitalrelation 32,24 %

Krav avseende kapitalbuffert

Kapitalkonserveringsbuffert 2,5 %