

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 2017 till 1 203 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 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 38,15 procent.

EXCALIBUR ASSET MANAGEMENT AB

Information om kapitalbasen (TSEK)	2017-09-30
Aktiekapital	1 250
Balanserat resultat	2 212
Kapitalandel av obeskattade reserver	17 914
Kärnprimärkapital	21 376
Primärkapital	-
Supplementärkapital	-
Total kapitalbas	21 376

Det regulatoriska minimikravet är det högsta av följande:

Riskvägda exponeringsbelopp (TSEK) 2017-09-30

Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta kostnader 56 027

Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisk, schablonmetoden 26 466

Riskvägda exponeringar för kreditrisker per exponeringsklass

- Exponering mot institut 711
- Exponering mot företag 2 264
- Exponering mot hushåll 0
- Exponering mot fonder 23 206
- Övriga poster 286

Summa riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisker 26 466

Totalt riskvägt belopp 56 027

Kärnprimärkapitalrelation 38,15 %

Primärkapitalrelation 38,15 %

Totalkapitalrelation 38,15 %

Krav avseende kapitalbuffert

Kapitalkonserveringsbuffert 2,5 %