



Safe Return

Offentliggörande av information om kapitaltäckning och riskhantering

Uppgifter per kvartal 2, 2016-06-30

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar presenterar Safe Return Asset Management AB ("SRAMN", org. nr. 556726-4626) kvartalsvis följande information på hemsidan (www.safereturn.se).

Kapitalbas	2016-06-30
Kärnprimärkapital	2 034 293
Övrigt primärt kapital	0
Supplementärt kapital	0
Total kapitalbas	2 034 293

Riskvägda exponeringsbelopp

Riskvägt exponeringsbelopp: kreditrisker	676 070
<i>Exponeringar mot stater och centralbanker</i>	0
<i>Institutsexponeringar</i>	649 707
<i>Företagsexponeringar</i>	26 363
<i>Hushållsexponeringar</i>	0
<i>Övriga poster</i>	0
Riskvägt exponeringsbelopp: marknadsrisker	0
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	676 070
25% av fasta kostnader (kostnadsrisk)	1 113 970
Exponeringsbelopp för fasta kostnader (*12,5)	13 924 629
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	13 924 629
Kapitalbaskrav (8% av riskvägd exponering)	1 113 970

Pelare 1 - kapitaltäckningsmått och kapitalbuffert

Kärnprimärkapitalrelation, %	14,61%
Primärkapitalrelation, %	14,61%
Total kapitalrelation, %	14,61%
Kapitalkonserveringsbuffert, 2,5% av tot. exp. belopp	348 116
Total kapitalrel. efter just. för kapitalkonserveringsbuffert	12,11%
Kapitaltäckningskvot (> 1,0)	1,74

Pelare 2 - Internt bedömt kapitalbehov

Kapitalbehov utöver minimikrav	147 294
--------------------------------	---------

Information om likviditet och riskhantering:

Bolaget tillhandahåller ej in- och utlåning och är helt självfinansierat utan externt kapital. Bolaget har disponibel likviditet placerad på konton i svenska kreditinstitut uppgående till 2 211 643 tkr. Styrelsen fastställer minst årligen SRAMN:s likviditetsrisker. Kontroll och uppföljning av likviditetsriskerna sker löpande av Risk. SRAMN strävar efter att en god riskmedvetenhet ska genomsyra hela verksamheten. Bolaget har ett interna riktlinjer och rutiner för att identifiera, mäta, hantera och följa upp samtliga verksamhetens väsentliga risker. Risk är direkt underställd styrelsen och deltar inte i den dagliga affärsverksamheten.