

OFFENTLIGGÖRANDE AV INFORMATION

Enligt Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar, Europaparlamentets och rådets förordning nr 575/2013 (CRR) samt Kommissionens genomförande förordning (EU) nr 1423/2013 ska följande information om kapitaltäckning och riskhantering lämnas varje kvartal och finnas tillgänglig på www.peakam.se. Uppgifterna nedan avser kvartal två 2018 och omfattar Peak AM Alternative Investments AB (556863-2375), Peak AM Securities AB (556863-2367), samt bolagens konsoliderade situation. Den konsoliderade situationen består av Peak AM Alternative Investments AB, Peak AM Securities AB samt Peak Asset Management AB.

KAPITALBAS

Kapitalbasen består enbart av kärnprimärkapital. I kärnprimärkapital ingår aktiekapital, aktieägartillskott under året, balanserat resultat och årets förlust.

KAPITALKRAV

Det regulatoriska minimikapitalkraven är det högsta av följande:

- 125 000 EUR (startkapital) + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 miljoner euro, samt
- Summan av riskvägda exponeringsbelopp för kreditrisker och marknadsrisker
- Exponeringsbeloppet beräknat utifrån 25 procent av fasta omkostnader under föregående år.

Vidare gäller kravet på att upprätthålla en kapitalkonserveringsbuffert på 2,5 % sedan den 2 augusti 2014.

BERÄKNINGSMETOD

Schablonmetoden tillämpas vid beräkning av kreditrisk, vilket 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.

UPPGIFTER OM KAPITALBAS (SEK):	Gruppen	Peak AM Alt. Inv. AB	Peak AM Securities AB
Aktiekapital	54 350	2 000 000	2 000 000
Balanserat resultat	8 904 923	1 121 247	3 296 229
Aktieägartillskott under året	0	0	0
Avgår imateriella tillgångar	0		
Avgår periodens förlust	-497 069	-614 401	0
Kärnprimärkapital	8 462 204	2 506 846	5 296 229
Övrigt primärkapital	0	0	0
Supplementärkapital	0	0	0
Total kapitalbas	8 462 204	2 506 846	5 296 229
RISKVÄGDA EXPONERINGSBELOPP (SEK):			
125 000 EUR+0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 MEUR.	1 286 250	1 286 250	1 286 250
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta omkostnader	80 254 997	25 513 378	46 606 697
Riskvägt exponeringsbelopp (kreditrisk och marknadsrisk)	9 050 587	2 476 058	5 679 343
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	80 254 997	25 513 378	46 606 697
Kärnprimärkapitalrelation	10,54%	9,83%	11,36%
Primärkapitalrelation	10,54%	9,83%	11,36%
Total kapitalrelation	10,54%	9,83%	11,36%

KRAV AVSEENDE KAPITALBUFFERTAR

Institutspecifikt krav på kärnprimärkapital (8%)	6 420 400	2 041 070	3 728 536
Kärnprimärkapitalkrav (4,5%)	3 611 475	1 148 102	2 097 301
Primärkapitalkrav (6%)	4 815 300	1 530 803	2 796 402
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5%)	2 006 375	-	1 165 167
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	8 426 775	2 041 070	4 893 703
Kapitalöverskott efter buffertkrav	35 429	465 776	402 526

RISKVÄGDA EXPONERINGAR FÖR
KREDITRISKER PER EXPONERINGSKLASS

Riskvägd exponering mot stater och centralbanker	0	0	0
Riskvägd exponering mot institut	360 889	263 054	230 938
Riskvägd exponering mot företag	7 693 494	2 191 349	4 514 623
Riskvägd exponering mot fonder	0	0	0
Riskvägd exponering mot hushåll	0	0	0
Övriga poster	996 204	21 655	933 782
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker	9 050 587	2 476 058	5 679 343

INTERNT BEDÖMT KAPITALBEHOV

Kreditrisk och motpartsrisk	724 047	-	815 517
Operativ risk	6 420 400	-	3 728 536
Intjäningsrisk	599 825	-	301 482
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker	7 744 272	-	4 845 535