

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 fyra 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	10 424 931	1 121 247	3 296 229
Aktieägartillskott under året	0	0	0
Avgår imateriella tillgångar	0	0	0
Avgår periodens förlust	-696 516	-987 242	-932 690
Kärnprimärkapital	9 782 765	2 134 005	4 363 539
Övrigt primärkapital	0	0	0
Supplementärkapital	0	0	0
Total kapitalbas	9 782 765	2 134 005	4 363 539
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	60 537 791	25 513 378	33 709 069
Riskvägt exponeringsbelopp (kreditrisk och marknadsrisk)	8 378 886	1 483 166	3 894 399
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	60 537 791	25 513 378	33 709 069
Kärnprimärkapitalrelation	16,16%	8,36%	12,94%
Primärkapitalrelation	16,16%	8,36%	12,94%
Total kapitalrelation	16,16%	8,36%	12,94%

KRAV AVSEENDE KAPITALBUFFERTAR

Institutspecifikt krav på kärnprimärkapital (8%)	4 843 023	2 041 070	2 696 726
Kärnprimärkapitalkrav (4,5%)	2 724 201	1 148 102	1 516 908
Primärkapitalkrav (6%)	3 632 267	1 530 803	2 022 544
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5%)	1 513 445	-	842 727
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	6 356 468	2 041 070	3 539 452
Kapitalöverskott efter buffertkrav	3 426 297	92 935	824 087

RISKVÄGDA EXPONERINGAR FÖR
KREDITRISKER PER EXPONERINGSKLASS

Riskvägd exponering mot stater och centralbanker	0	0	0
Riskvägd exponering mot institut	785 637	392 551	378 227
Riskvägd exponering mot företag	6 758 023	1 090 614	2 680 946
Riskvägd exponering mot fonder	0	0	0
Riskvägd exponering mot hushåll	0	0	0
Övriga poster	835 226	0	835 226
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker	8 378 886	1 483 166	3 894 399

INTERNT BEDÖMT KAPITALBEHOV

Kreditrisk och motpartsrisk	670 311	-	526 028
Operativ risk	4 843 023	-	2 696 726
Intjäningsrisk	599 825	-	301 482
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker	6 113 159	-	3 524 235