

OFFENTLIGGÖRANDE AV INFORMATION PEAK AM SECURITIES AB

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 avser kvartal fyra 2019.

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):

Aktiekapital	2 000 000
Balanserat resultat	2 363 539
Aktieägartillskott under året	0
Avgår immateriella tillgångar	0
Avgår periodens förlust	0
Kärnprimärkapital	4 363 539
Övrigt primärkapital	0
Supplementärkapital	0
Total kapitalbas	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
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta omkostnader	39 807 844
Riskvägt exponeringsbelopp (kreditrisk och marknadsrisk)	6 536 920
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	39 807 844
Kärnprimärkapitalrelation	10,96%
Primärkapitalrelation	10,96%
Total kapitalrelation	10,96%

KRAV AVSEENDE KAPITALBUFFERTAR

Institutspecifikt krav på kärnprimärkapital (8%)	3 184 628
Kärnprimärkapitalkrav (4,5%)	1 791 353
Primärkapitalkrav (6%)	2 388 471
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5%)	995 196
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	4 179 824
Kapitalöverskott efter buffertkrav	183 716

RISKVÄGDA EXPONERINGAR FÖR KREDITRISKER PER EXPONERINGSKLASS

Riskvägd exponering mot stater och centralbanker	0
Riskvägd exponering mot institut	740 079
Riskvägd exponering mot företag	3 194 570
Riskvägd exponering mot fonder	0
Riskvägd exponering mot hushåll	2 102 272
Övriga poster	500 000
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker	6 536 920

INTERNT BEDÖMT KAPITALBEHOV

Kreditrisk och motpartsrisk	522 954
Operativ risk	3 184 628
Intjäningsrisk	320 000
	4 027 581