

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 2020.

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	2 819 295
Aktieägartillskott under året	0
Avgår immateriella tillgångar	0
Avgår periodens förlust	0
Kärnprimärkapital	4 819 295
Övrigt primärkapital	0
Supplementärkapital	0
Total kapitalbas	4 819 295

RISKVÄGDA EXPONERINGSBELOPP (SEK):

125 000 EUR + 0,02 procent av det belopp med vilket fondförmögenheten överstiger ett belopp motsvarande 250 MEUR.	1 255 000
Riskvägt exponeringsbelopp baserat på 25 % av fasta omkostnader	35 973 803
Riskvägt exponeringsbelopp (kreditrisk och marknadsrisk)	4 563 006
Högsta riskvägda exponeringsbelopp	35 973 803
Kärnprimärkapitalrelation	13,40%
Primärkapitalrelation	13,40%
Total kapitalrelation	13,40%

KRAV AVSEENDE KAPITALBUFFERTAR

Institutspecifikt krav på kärnprimärkapital (8%)	2 877 904
Kärnprimärkapitalkrav (4,5%)	1 618 821
Primärkapitalkrav (6%)	2 158 428
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5%)	899 345
Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav	3 777 249
Kapitalöverskott efter buffertkrav	1 042 046

RISKVÄGDA EXPONERINGAR FÖR KREDITRISKER PER EXPONERINGSKLASS

Riskvägd exponering mot stater och centralbanker	0
Riskvägd exponering mot institut	2 454 419
Riskvägd exponering mot företag	2 051 530
Riskvägd exponering mot fonder	0
Riskvägd exponering mot hushåll	0
Övriga poster	57 057
Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker	4 563 006

INTERNT BEDÖMT KAPITALBEHOV

Kreditrisk och motpartsrisk	365 041
Operativ risk	2 877 904
Intjäningsrisk	415 000
	3 657 945