

# 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](http://www.peakam.se). Uppgifterna avser kvartal tre 2021.

## 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 sjuutton 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	3 380 128
Aktieägartillskott under året	0
Avgår immateriella tillgångar	0
Avgår periodens förlust	0
<b>Kärnprimärkapital</b>	<b>5 380 128</b>
Övrigt primärkapital	0
Supplementärkapital	0
<b>Total kapitalbas</b>	<b>5 380 128</b>

### 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	33 044 678
Riskvägt exponeringsbelopp (kreditrisk och marknadsrisk)	1 887 963
<b>Högsta riskvägda exponeringsbelopp</b>	<b>33 044 678</b>
<b>Kärnprimärkapitalrelation</b>	<b>16,28%</b>
<b>Primärkapitalrelation</b>	<b>16,28%</b>
<b>Total kapitalrelation</b>	<b>16,28%</b>

**KRAV AVSEENDE KAPITALBUFFERTAR**

Institutspecifikt krav på kärnprimärkapital (8%)	2 643 574
Kärnprimärkapitalkrav (4,5%)	1 487 011
Primärkapitalkrav (6%)	1 982 681
Kapitalkonserveringsbuffert (2,5%)	826 117
<b>Totalt kapitalkrav inklusive buffertkrav</b>	<b>3 469 691</b>
<b>Kapitalöverskott efter buffertkrav</b>	<b>1 910 437</b>

**RISKVÄGDA EXPONERINGAR FÖR KREDITRISKER PER EXPONERINGSKLASS**

Riskvägd exponering mot stater och centralbanker	0
Riskvägd exponering mot institut	1 601 075
Riskvägd exponering mot företag	286 888
Riskvägd exponering mot fonder	0
Riskvägd exponering mot hushåll	0
Övriga poster	0
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisker</b>	<b>1 887 963</b>

**INTERNT BEDÖMT KAPITALBEHOV**

Kreditrisk och motpartsrisk	151 037
Operativ risk	2 643 574
Intjäningsrisk	530 000
	<b>3 324 611</b>