

Offentliggörande av information angående kapitaltäckning och likviditetsrisker

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om Tillsynskrav och kapitalbuffertar samt (FFFS 2010:7) om Hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut m.fl. lämnas följande periodiska information:

Uppgifterna redovisas för Placerum Kapitalförvaltning AB (556707-4306) samt för den konsoliderade situationen tillsammans med Placerum AB (556898-1236)

Beräkning av kapitalbas (kk)

| | Placerum Kapitalförvaltning AB 2016-09-30 | Konsoliderad situation 2016-09-30 |
|---|--|--------------------------------------|
| Kärnprimärkapital | 8 268 | 29 472 |
| Primärkapitaltillskott | 0 | 0 |
| Primärkapital | 8 268 | 29 472 |
| Supplementärkapital | 0 | 0 |
| Totalt kapital | 8 268 | 29 472 |
| Riskvägt exponeringsbelopp | | |
| <i>Kapitalkrav för kreditrisker</i> | 11 931 | 15 623 |
| Stater o centralbank | 133 | 133 |
| Exponeringar mot institut | 2 937 | 6 625 |
| Exponeringar mot hushåll | 1 402 | 1 406 |
| Exponeringar i form av andelar eller aktier i företag för kollektiva investeringar | 7 404 | 7 404 |
| Övriga poster | 55 | 55 |
| | 11 931 | 15 623 |
| <i>Kapitalbas baserad på fasta omkostnader</i> | 3 654 | 3 687 |
| Totalt riskvägt exponeringsbelopp enligt artikel 95.2 Tillsynsförordningen (575/2013/EU) | 45 674 | 46 087 |
| Kapitalrelationer och buffertar | | |
| Kärnprimärkapital | 18,10% | 63,95% |
| Primärkapital | 18,10% | 63,95% |
| Totalt kapital | 18,10% | 63,95% |
| Institutsspecifika buffertkrav | 2,50% | 2,50% |
| Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert | 2,50% | 2,50% |
| Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert | 10,10% | 55,95% |
| Internt bedömt kapitalbehov | 4 796 | 4 839 |

Information om likviditetsrisk

Hantering av likviditetsrisker

Placerum Kapitalförvaltning AB har skrivit instruktioner som syftar till att säkerställa att bolaget bevakar och tillgodoser framtida likviditetsbehov vid normal daglig hantering som vid temporära utdragna krissituationer. Styrelsen skall årligen granska och godkänna strategier om hantering av likviditetsrisk och företagets riktlinjer för hantering av likviditetsrisk. Styrelsen skall även försäkra sig om att företagets VD hanterar likviditetsrisker i enlighet med företagets risktolerans.

Den centrala funktionen för likviditetskontroll är företagets riskansvarig. Funktionen är direkt underställd styrelsen.

Placerum Kapitalförvaltning AB:s verksamhet är självfinansierad och bolaget definierar sin likviditetsrisk som risken att inte kunna infria sina betalningsförpliktelser vid förfallotidpunkten utan att detta medför avsevärda kostnader för anskaffning av likviditet. Med betalningsförpliktelser avses skulder och löpande kostnader som skall betalas inom 90 dagar. Placerums risktolerans är att de kontant likvida bankmedel som bolaget disponerar vid varje förfalldag inte får understiga de betalningsförpliktelser som förfaller till betalning (kassalikviditet). Kassalikviditeten skall inte understiga 1 och följs löpande upp mot företagets kassaflödesprognoser och rapporteras till bolagets styrelse.

Bolagets finansieringsstrategi är att säkerställa sin framtida finansiering för likviditetsrisker genom egenfinansiering. Detta förutsätter att bolaget följer budget och genererar positiva kassaflöden. Bolaget skall hålla tillräckligt med kontanta medel på bankkonto - likviditetsreserv, för att säkra företagets betalningsförmåga vid bortfall eller försämrad tillgång till företagets normala finansieringskällor. Likviditetsreserven skall uppgå till 150 procent av företagets under föregående räkenskapsår genomsnittliga belopp för kortfristiga skulder.

Bolagets beredskapsplan för hantering av likviditetsrisker är bolagets budget. Budgets skall regelbundet följas upp och vid behov revideras. Bolaget skall därför förutom att ha kontroll på sin kassalikviditet en gång per år genomföra stresstest för att identifiera och mäta likviditetsrisker under olika scenarion.

Uppgifter per 2016-09-30:

| | |
|-------------------------|--------|
| Likviditetsreserv (tkr) | 14 684 |
| Likviditetsreserv (%) | 308 |
| Kassalikviditet | 3,63 |