

## Kapitaltäckning

2018-12-31

Periodisk rapportering

Informationen om Bolagets kapitaltäckning nedan avser sådan periodisk information som ska lämnas enligt Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar.

### Kapitalbas

Kapitalbasen består enbart av kärnprimärkapital. I bolagets kärnprimärkapital ingår eget kapital samt balanserat resultat.

### Kapitalkrav

Beräkning av kapitalkrav är utförd i enlighet med Europaparlamentets och Rådets förordning (EU) 575/2013 och Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar. Utfall avser beräkning i enlighet med lagstadgat minimikrav på kapital, benämnt Pelare I, för kreditrisk, marknadsrisk och operativ risk samt kapitalbehov för att hålla en kapitalkonserveringsbuffert på 2,5 % av totalt riskvägt belopp.

<b>Kapitalbas</b>	<b>31 december 2018</b>
Kärnprimärkapital	33 664 392
Varav: aktiekapital	2 000 000
balanserad vinst	26 897 188
kapitalandel av obeskattade reserver	4 767 204
Övrigt primärkapital	-
Supplementärkapital	-
<b>Total Kapitalbas</b>	<b>33 664 392</b>
<b>Riskvägt belopp</b>	<b>31 december 2018</b>
Riskvägt belopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	9 195 659
Varav: exponering mot institut	7 050 400
exponering mot företag	662 589
exponering mot fonder	1 482 670
övriga exponeringar	0
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk	-
Riskvägt belopp för operativ risk, överstigande kreditrisk och marknadsrisk	52 623 754
<b>Summa riskvägt belopp</b>	<b>61 819 413</b>
<b>Kapitalrelationer</b>	<b>31 december 2018</b>
Kärnprimärkapitalrelation	54,46 %
Primärkapitalrelation	54,46 %
Kapitaltäckningsgrad	54,46 %
<b>Kapitalbuffert</b>	<b>31 december 2018</b>
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	43,96 %

## Internt bedömt kapitalbehov

Bolaget har en intern process, Intern Kapital- och likviditetsutvärdering (IKLU) för att bedöma om det interna kapitalet är tillräckligt för att ligga till grund för både aktuell och framtida verksamhet. Processen är ett verktyg för att säkerställa att Bolaget identifierar, värderar och hanterar alla de risker Bolaget är exponerat för samt gör en bedömning av det interna kapitalbehovet i relation till detta. I detta ingår även att Bolaget ska ha ändamålsenliga styr- och kontrollfunktioner och riskhanteringssystem.

<b>Kreditrisk</b>	<b>Belopp SEK</b>	<b>Riskvikt %</b>	<b>Riskvägt belopp</b>
Exponering mot institut	35 251 999	20 %	7 050 400
Exponering mot företag	662 589	100 %	662 589
Exponering mot fonder	1 482 670	100 %	1 482 670
Övriga exponeringar	0	100 %	0
Totalt belopp för kreditrisk			9 195 659
Kapitalkrav, 8 %			735 653
<b>Marknadsrisk</b>			
Valutarisk			0
Totalt belopp för marknadsrisk			0
Kapitalkrav, 8 %			0
<b>Kostnadsrisk</b>			
25 % av Bolagets kostnader år 2017			4 945 553
<b>Kapitalkrav</b>			
Kreditrisk + marknadsrisk			735 653
Kostnadsrisk			4 945 553
Bolagets kapitalkrav motsvaras av det högsta av kredit- plus marknadsrisk respektive kostnadsrisk.			<b>4 945 553</b>
<b>Kapitaltäckningskvot, pelare 1</b>			<b>7,21</b>

<b>Ytterligare kapital allokerat i enlighet med pelare 2</b>	
Operationell risk	2 472 777
Strategisk risk	2 472 777
Kreditrisk	0
Likviditetsrisk	0
Marknadsrisk	0
Totalt ytterligare kapital enligt pelare 2	4 945 553
<b>Kapitaltäckningskvot, pelare 2</b>	
	<b>3,40</b>

## **Riskprocess och organisation**

Bolagets riskansvarige rapporterar direkt till styrelsen i Bolaget. Den riskansvarige är helt funktionellt oberoende från portföljförvaltningens funktion. Detta för att redovisning och information om risk ska kunna ges direkt till styrelsen.

Bolaget har antagit en riskpolicy för Bolaget och för fonden. Bolagets riskansvarige ansvarar för mätning, övervakning och kontroll av risker och åtgärder, i enlighet med Bolagets riskpolicy, i fondens prospekt, samt enligt gällande lagstiftning som tillämpas för fonden och för Bolaget.

Kapitaltäckningsprocessen analyseras kvartalsvis och eventuella överträdelser och åtgärder som vidtagits rapporteras till styrelsen. Dessutom ska en årlig riskrapport lämnas till styrelsen där det bedöms huruvida Bolaget har en godkänd kontroll över de risker som uppstår i verksamheten, samt beskriver de åtgärder som vidtagits för att avhjälpa eventuella brister.

Madrague Capital Partners AB