

COELI ASSET MANAGEMENT AB - KVARTAL 2 2017

Information om kapitaltäckning och likviditet

Rapporten innehåller information om kapitaltäckning och likviditet enligt Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2010:7 om hantering och offentliggörande av likviditetsreserver för kreditinstitut och värdepappersbolag samt FFFS 2014:12 om tillsyn och kapitalbuffertar, EU Förordning 575/2013 om tillsyn för kreditinstitut och värdepappersföretag. Lag (2007:528) om värdepappersmarknaden samt Lag 2013:561 om förvaltare av alternativa investeringsfonder (LAIF).

Bolaget har en intern kapital- och likviditetsutvärderingsprocess för att säkerställa att Bolagets kapital täcker alla identifierade risker samt att likviditeten är tillräcklig för att säkra Bolagets kortsiktiga betalningsförmåga.

	2017-06-30	Krav
BELOPP I KSEK		
Kapitalrelationer och buffert		
Total kapitalrelation	14,49%	8,00%
Kärnkapsitalrelation	14,49%	4,50%
Primärkapitalrelation	14,49%	6,00%
Kapitalkonserveringsbuffert 2,5%		2,50%
Startkapital och kapitalbas		
Startkapital	1 209	
Kapitalbas		
Aktiekapital	1 750	
Reservfond		
Balanserade vinstmedel	12 663	
Periodens resultat	1 103	
Avdrag ej reviderat resultat	-1 103	
Avdrag uppskjuten skattefordran	-21	
Total Kapitalbas netto	14 392	
Kärnkapsital	14 392	
Primärkapital	14 392	
Exponeringar och kapitalkrav		
Alternativ metod fasta omkostnader	Exponeringsbelopp	Kapitalkrav
Baserad på 25 % av fasta omkostnader	99 306	7 945
Kapitalkonserveringsbuffert 2,5%		2 483
Totalt krav inklusive buffertkrav		10 427
Exponeringsbelopp och kapitalkrav		
Staten	1 664	0
Kreditinstitut	11 988	192
Företag	25 927	2 074
Aktier	0	0
Övriga	6 700	536
Summa kreditrisker (schablonmetod)	46 279	2 802
Marknadsrisker	4 467	357
Summa kredit- och marknadsrisker	50 746	3 159

Uppgifter om kapitalkrav enligt LAIF

125 000 EUR + 0,2 % av fondförmögenhet som överstiger 250 MEUR. Ger kapitalkrav KSEK 2 008.

Likviditet

Likvida tillgångar utgörs av medel på kreditinstitut och beviljade outnyttjade kreditlimiter. Likvidreserven ska uppgå till två månaders normala utbetalningar. Likviditeten hanteras gemensamt för hela gruppen. Likvida tillgångar för Bolaget var vid periodens utgång KSEK 11 988.

Coeli Asset Management AB har som AIF-förvaltare krav att likviditeten ska överstiga kraven i pelare 1. Likviditeten var vid periodens utgång KSEK 11 988 och kravet i pelare 1 var KSEK 7 945.