

## Coeli Frontier Markets AB

### Information om kapitaltäckning och likviditet

Rapporten innehåller information om kapitaltäckning i enighet med finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd om offentliggörandet av information om kapitaltäckning och riskhantering (FFFS 2014:12) benämnt Pelare III. Rapporten innehåller även information om bolagets likviditet (FFFS 2014:21).

<b>Kapitalrelationer</b>	<b>2016-06-30</b>
Total kapitalrelation <sup>1</sup>	13,66%
Primärkapitalrelation <sup>2</sup>	13,66%
Kärnprimärkapitalgrad <sup>3</sup>	13,66%

### Kapitalbas <sup>4</sup>

Total Kapitalbas netto	1 909 787
Supplementärkapital	0
<b>Total kapitalbas netto</b>	<b>1 909 787</b>
Var av kärnprimärkapital	1 909 787
Totalt riskvägt exponeringsbelopp <sup>5</sup>	13 985 225

### Kapitalkrav

Totalt minimikapitalkrav 8%	1 118 818
Var av kärnprimärkapitalkrav 4,5%	629 335
Var av Primärkapitalkrav 6%	839 114
<b>Totalt kapitalkrav Pelare I (exkl buffertkrav) <sup>6</sup></b>	<b>1 118 818</b>

Kapitalkonserveringsbuffert 2,5% <sup>7</sup>	349 631
---	---------

<b>Totalt kapitalkrav Pelare I och II</b>	<b>1 468 449</b>
---	------------------

### Tillkommande kapitalkrav

Startkapital <sup>8</sup>	1 161 250
---------------------------	-----------

### Likviditet

#### Likviditetsreserv

Kassa och tillgodohavande i bank	3 264 272
----------------------------------	-----------

#### Finansiering

Eget Kapital	3 392 168
Balansomslutning	4 292 336

#### Nyckeltal

Eget kapital/balansomslutning	79%
Likviditetsreserv/balansomslutning	76%

## Coeli Frontier Markets AB

<b>Riskvägda exponeringar och kapitalkrav</b>	<b>2016-06-30</b>
<b>Totala exponeringar och kapitalbaskrav</b>	
<b>Belopp kr</b>	
Kapitalkrav fasta omkostnader	1 118 818
Exponeringsbelopp fasta omkostnader	13 985 225
Kapitalkonserveringsbuffert	349 631
<b>Totala exponeringar för kapitaltäckningsändamål</b>	<b>13 985 225</b>
Kapitalbaskrav (8 %)	1 118 818
<b>Exponeringar per exponeringsklass</b>	
<b>Kreditrisker</b>	
Exponeringar mot nationella regeringar och centralbanker	0
Exponeringar mot institut	3 264 272
Exponeringar mot företag	0
Exponeringar i form av säkerställda obligationer/fonder	0
Övriga poster	1 028 064
<b>Marknadsrisker</b>	<b>0</b>
<b>Summa exponeringar kreditrisk och marknadsrisk</b>	<b>4 292 336</b>

### Beskrivning av kvantitativ information

- 1 Total kapitalrelation  
Kapitalbas i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 10,5%.
- 2 Primärkapitalrelation  
Primärt kapital i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 6%
- 3 Kärnprimärkapitalrelation  
Kärnprimärkapital i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 4,5 % före buffertkrav
- 4 Kapitalbasen fördelas på primärkapital och supplementärkapital. Primärkapital består av kärnprimärkapital och övrigt primärkapital.  
Kärnprimärkapitalet består av eget kapital reducerat för poster som inte får medräknas i kapitalbasen som immateriella tillgångar, uppskjutna skattefordringar, orealiserade förluster avseende värdepapper klassificerade som finansiella tillgångar som kan säljas och prisjusteringar.
- 5 Beräknad på 25 % av fasta omkostnader.
- 6 Kapitalbaskrav Pelare I avser 8% av riskvägda exponeringar.
- 7 Kapitalkonserveringsbuffert  
Kärnprimärkapital i förhållande till riskvägt exponeringsbelopp vilket skall uppgå till minst 2,5%.
- 8 I enlighet med Lag (2007:528) om värdepappersmarknaden ska ett värdepappersbolag som ska driva verksamhet som avses i 2 kap 1 § 3, 6 och 9, inneha ett startkapital uppgående till 730 tusen euro vid tidpunkt för erhållet tillstånd, övriga värdepappersbolag skall inneha ett