

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).

Kapitalrelationer	2016-09-30
Total kapitalrelation ¹	13,66%
Primärkapitalrelation ²	13,66%
Kärnprimärkapitalgrad ³	13,66%

Kapitalbas ⁴

Total Kapitalbas netto	1 909 787
Supplementärkapital	0
Total kapitalbas netto	1 909 787
Var av kärnprimärkapital	1 909 787
Totalt riskvägt exponeringsbelopp ⁵	13 985 225

Kapitalkrav

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

Kapitalkonserveringsbuffert 2,5% ⁷ 349 631

Totalt kapitalkrav Pelare I och II 1 468 449

Tillkommande kapitalkrav

Startkapital ⁸ 1 161 250

Likviditet

Likviditetsreserv

Kassa och tillgodohavande i bank 671 465

Finansiering

Eget Kapital 2 942 555

Balansomslutning 5 100 725

Nyckeltal

Eget kapital/balansomslutning 58%

Likviditetsreserv/balansomslutning 13%

Coeli Frontier Markets AB

Riskvägda exponeringar och kapitalkrav 2016-09-30

Totala exponeringar och kapitalbaskrav	Belopp kr
Kapitalkrav fasta omkostnader	1 118 818
Exponeringsbelopp fasta omkostnader	13 985 225
Kapitalkonserveringsbuffert	349 631
Totala exponeringar för kapitaltäckningsändamål	13 985 225

Kapitalbaskrav (8 %) 1 118 818

Exponeringar per exponeringsklass

Kreditrisker	
Exponeringar mot nationella regeringar och centralbanker	23
Exponeringar mot institut	671 465
Exponeringar mot företag	4 344 609
Exponeringar i form av säkerställda obligationer/fonder	0
Övriga poster	84 627
Marknadsrisker	0
Summa exponeringar kreditrisk och marknadsrisk	5 100 725

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