

COELI ASSET MANAGEMENT AB - KVARTAL 4 2016

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.

	2016-12-31	Krav
BELOPP I KSEK		
<u>Kapitalrelationer och buffert</u>		
Total kapitalrelation	15,61%	8,00%
Kärnkapsitalrelation	15,61%	4,50%
Primärkapitalrelation	15,61%	6,00%
Kapitalkonserveringsbuffert 2,5%	2 144	2,50%
Totalt krav inklusive buffertkrav	6 862	
Kapitalöverskott	6 530	
<u>Startkapital och kapitalbas</u>		
Startkapital	1 177	
<u>Kapitalbas</u>		
Aktiekapital	1 750	
Reservfond		
Balanserade vinstmedel	11 663	
Periodens resultat	2 000	
Avdrag ej reviderat resultat	-2 000	
Avdrag uppskjuten skattefordran	-21	
Total Kapitalbas netto	13 392	
Kärnkapsital	13 392	
Primärkapital	13 392	
<u>Exponeringar och kapitalkrav</u>		
Alternativ metod fasta omkostnader	Exponeringsbelopp	Kapitalkrav
Baserad på 25 % av fasta omkostnader	85 778	6 862
<u>Exponeringsbelopp och kapitalkrav</u>		
Staten	1 090	0
Kreditinstitut	12 851	206
Företag	19 711	1 577
Aktier	0	0
Övriga	5 943	475
Summa kreditrisker (schablonmetod)	39 595	2 258
Marknadsrisker	11 539	923
Summa kredit- och marknadsrisker	51 134	3 181

Uppgifter om kapitalkrav enligt LAIF

125 000 EUR + 0,2 % av fondförmögenhet som överstiger 250 MEUR. Ger kapitalkrav KSEK 1 823.

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 12 851.