

COELI GRUPP - 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).

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

	2016-12-31	Krav
BELOPP I KSEK		
Kapitalrelationer och buffert		
Total kapitalrelation	19,68%	8,00%
Kärnkapsitalrelation	19,68%	4,50%
Primärkapitalrelation	19,68%	6,00%
Kapitalkonserveringsbuffert 2,5%	6 751	2,50%
Totalt krav inklusive buffertkrav	28 354	
Kapitalöverskott	24 791	
Startkapital och kapitalbas		
Startkapital	8 607	
Kapitalbas		
Aktiekapital	115	
Reservfond		
Balanserade vinstmedel	59 623	
Periodens resultat	13 542	
Avdrag ej reviderat resultat	-13 542	
Övriga avdrag	-6 593	
Total Kapitalbas netto	53 145	
Kärnkapsital	53 145	
Primärkapital	53 145	
Exponeringar och kapitalkrav		
Alternativ metod fasta omkostnader	Exponeringsbelopp	Kapitalkrav
Baserad på 25 % av fasta omkostnader	270 040	21 603
Exponeringsbelopp och kapitalkrav		
Staten	8 222	0
Kreditinstitut	38 773	620
Företag	30 098	2 408
Aktier	16 507	1 321
Övriga	30 271	2 422
Summa kreditrisker (schablonmetod)	123 871	6 770
Marknadsrisker	10 811	865
Summa kredit- och marknadsrisker	134 682	7 635

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 i gruppen var vid periodens utgång 43 064.

Coeli Asset Management AB har som AIF-förvaltare krav att likviditeten ska överstiga kraven i pelare 1. Likviditeten var vid periodens utgång 12 851 och kravet i pelare 1 var 9 500.