



COELI GRUPP – KVARTAL 3 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).

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.

	2017-09-30	Krav
BELOPP I KSEK		
<u>Kapitalrelationer och buffert</u>		
Total kapitalrelation	18,02%	8,00%
Kärnkapitalrelation	18,02%	4,50%
Primärkapitalrelation	18,02%	6,00%
Kapitalkonserveringsbuffert 2,5%	2,50%	2,50%
<u>Startkapital och kapitalbas</u>		
Startkapital	4 783	
<u>Kapitalbas</u>		
Aktiekapital	120	
Reservfond		
Balanserade vinstmedel	73 870	
Periodens resultat	15 637	
Avdrag ej reviderat resultat	-15 637	
Avdrag goodwill	-12 800	
Övriga avdrag	-5 375	
Total Kapitalbas netto	55 816	
Kärnkapital	55 816	
Primärkapital	55 816	
<u>Exponeringar och kapitalkrav</u>		
Alternativ metod fasta omkostnader	Exponeringsbelopp	Kapitalkrav
Baserad på 25 % av fasta omkostnader	309 745	24 780
Kapitalkonserveringsbuffert		7 744
Totalt krav inklusive buffertkrav		32 523
<u>Exponeringsbelopp och kapitalkrav</u>		
Staten	10 581	0
Kreditinstitut	38 997	624
Företag	30 972	2 478
Aktier		
Övriga	60 356	4 828
Summa kreditrisker (schablonmetod)	140 906	7 930
Marknadsrisker	4 929	394
Summa kredit- och marknadsrisker	145 836	8 325

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 KSEK 37 915.

Coeli Asset Management AB har som AIF-förvaltare krav att likviditeten ska överstiga kraven i pelare 1. Likviditeten var vid periodens utgång KSEK 10 202 och kravet i pelare 1 var KSEK 9 500.