

Offentliggörande av information om kapitaltäckning

Kraven på offentliggörande av information omfattar den konsoliderade situationen där E. Öhman J:or AB är moderföretag och E. Öhman J:or Fonder AB är ansvarigt institut. Övriga institut i den konsoliderade situationen är E. Öhman J:or Wealth Management AB och Banque Öhman S.A.. Samtliga av ovannämnda institut konsolideras fullständigt. I gruppen finns dessutom innehav i Nordnet AB (intresseföretag) som konsolideras enligt kapitalandelsmetoden, och andra finansiella institut. Den organisatoriska och rättsliga strukturen mellan dessa företag och moderbolaget framgår av koncernårsredovisningen. I tabellerna nedan har beräkningar av kapitalkrav och kapitaltäckningsrelation per 2016-06-30 utförts enligt Kapitaltäckningsförordningen (EU) nr 575/2013 (CRR), direktivet 2013/36/EU (CRD IV) samt FFFS 2014:12. Den information som skall offentliggöras enligt FFFS 2014:12 återfinns på bolagets hemsida www.ohman.se.

Kapitalbas

Kapitalbasen består endast av kärnprimärkapital och gruppen tillämpar inga filter vid beräkningen. Avdrag görs för immateriella tillgångar.

Kapitalbaskategorier, tkr	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
	2016-06-30	2016-06-30
Aktiekapital	4 200	2 000
Balanserade vinstmedel	35 631	929 398
Summa kärnprimärkapitalposter	39 831	931 398
Förluster för innevarande räkenskapsår		
Immateriella tillgångar	-9 551	-99 213
Uppskjutna skattefordringar	-	-15 478
Summa avdrag från kärnprimärkapital	-9 551	-114 691
Kapitalbas	30 280	816 707

Kapitalkrav

Den konsoliderade situationen och samtliga institut som ingår i gruppen har under året uppfyllt de krav som anges i artikel 92 i kapitaltäckningsförordningen.

Riskvägt exponeringsbelopp	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	59 768	1 931 133
varav <i>Institutexponering</i>	12 258	219 450
varav <i>Övriga poster</i>	47 510	108 930
varav <i>Centralbanker</i>	-	-
varav <i>Fondexponering</i>	-	41 296
varav <i>Aktieexponering</i>	-	1 439 360
varav <i>Hushållsexponering</i>	-	122 096
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk	n/a	-
Riskvägt exponeringsbelopp för operativ risk enligt basmetoden	n/a	525 351
Riskvägt exponeringsbelopp för fondförmögenhet	161 110	n/a
Riskvägt exponeringsbelopp för kostnadsrisk	190 184	n/a
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	190 184	2 456 484

Totalt minimikapitalkrav	15 215	196 519
---------------------------------	---------------	----------------

Överskott av kapital	15 065	620 189
----------------------	--------	---------

Kapitalbasrelationer	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Kärnprimärkapitalrelation	15,92%	33,25%
Primärkapitalrelation	15,92%	33,25%
Total kapitalrelation	15,92%	33,25%

Institutspecifikt buffertkrav	2,50%	4,00%
varav krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50%	2,50%
varav krav på kontracyklisk buffert	n/a	1,50%
Lagstadgad minimikapitalrelation inklusive buffertkrav	10,50%	12,00%
Kärnprimärkapital tillgänglig utöver buffert	5,42%	21,25%

Samlat kapitalbehov	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Minimikapitalkrav	15 215	196 519
Institutspecifikt buffertkrav	4 755	85 977
Kapitalbehov Pelare 2	1 000	6 000
Totalt kapitalbehov	20 969	288 496

Internt bedömt kapitalbehov

Utöver det lagstadgade kravet på kapital enligt pelare 1 skall den konsoliderade situationen avsätta ytterligare kapital för de risker som ingår i pelare 2. Dessa risker hanteras i koncernens interna kapitalutvärdering, IKU. Den konsoliderade situationen har beräknat att utöver pelare 1 krävs ytterligare 6 Mkr för att gruppens risker skall vara täckta.