

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 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 2016-12-31 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 samt uppskjutna skattefordringar.

Kapitalbaskategorier, tkr	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
	2016-12-31	2016-12-31
Aktiekapital	4 200	2 000
Balanserade vinstmedel	43 966	935 573
Summa kärnprimärkapitalposter	48 166	937 573
Förluster för innevarande räkenskapsår		
Immateriella tillgångar	-8 872	-98 709
Uppskjutna skattefordringar	-	-15 478
Summa avdrag från kärnprimärkapital	-8 872	-114 188
Kapitalbas	39 294	823 386

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	68 262	2 046 165
varav <i>Institutexponering</i>	15 748	167 114
varav <i>Övriga poster</i>	52 514	109 970
varav <i>Centralbanker</i>	-	-
varav <i>Fondexponering</i>	-	91 818
varav <i>Aktieexponering</i>	-	1 551 636
varav <i>Hushållsexponering</i>	-	125 627
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk	n/a	-
Riskvägt exponeringsbelopp för operativ risk enligt basmetoden	n/a	525 351
Riskvägt exponeringsbelopp för fondförmögenhet	172 815	n/a
Riskvägt exponeringsbelopp för kostnadsrisk	190 184	n/a
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	190 184	2 571 516
Totalt minimikapitalkrav	15 215	205 721
Överskott av kapital	24 080	617 664
Kapitalbasrelationer	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Kärnprimärkapitalrelation	20,66%	32,02%
Primärkapitalrelation	20,66%	32,02%
Total kapitalrelation	20,66%	32,02%
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	10,16%	20,02%
Samlat kapitalbehov	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Minimikapitalkrav	15 215	205 721
Institutspecifikt buffertkrav	4 755	102 861
Kapitalbehov Pelare 2	1 000	6 000
Totalt kapitalbehov	20 969	314 582

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.