

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 2017-06-30 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 samt uppskjutna skattefordringar.

Kapitalbaskategorier, tkr	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
	2017-06-30	2017-06-30
Aktiekapital	4 200	2 000
Balanserade vinstmedel	43 804	1 005 720
Summa kärnprimärkapitalposter	48 004	1 007 720
Förluster för innevarande räkenskapsår		
Immateriella tillgångar	-12 046	-100 415
Uppskjutna skattefordringar	-	-15 478
Summa avdrag från kärnprimärkapital	-12 046	-115 893
Kapitalbas	35 958	891 827

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	63 986	2 183 938
varav <i>Institutexponering</i>	12 493	230 232
varav <i>Övriga poster</i>	51 493	97 492
varav <i>Centralbanker</i>	-	-
varav <i>Fondexponering</i>	-	64 283
varav <i>Aktieexponering</i>	-	1 650 948
varav <i>Hushållsexponering</i>	-	140 983
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	n/a	5 921
varav <i>valutakursrisk</i>	-	-
varav <i>kreditvärdighetsjusteringsrisk</i>	-	5 921
Riskvägt exponeringsbelopp för operativ risk enligt basmetoden	n/a	633 067
Riskvägt exponeringsbelopp för fondförmögenhet	183 314	n/a
Riskvägt exponeringsbelopp för kostnadsrisk	315 017	n/a
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	315 017	2 822 926
Totalt minimikapitalkrav	25 201	225 834
Överskott av kapital	10 757	665 993
Kapitalbasrelationer	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Kärnprimärkapitalrelation	11,41%	31,59%
Primärkapitalrelation	11,41%	31,59%
Total kapitalrelation	11,41%	31,59%
Institutspecifikt buffertkrav	2,50%	4,24%
varav krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50%	2,50%
varav krav på kontracyklisk buffert	n/a	1,74%
Lagstadgad minimikapitalrelation inklusive buffertkrav	10,50%	12,24%
Kärnprimärkapital tillgänglig utöver buffert	0,91%	19,36%
Samlat kapitalbehov	E. Öhman J:or Fonder AB	Konsoliderad situation
Minimikapitalkrav	25 201	225 834
Institutspecifikt buffertkrav	7 875	119 594
Kapitalbehov Pelare 2	1 000	6 000
Totalt kapitalbehov	34 077	351 429

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.