

RAPPORT OM RISK OCH KAPITALTÄCKNING

OFFENTLIGGÖRANDE AV INFORMATION ANGÅENDE
RISK OCH KAPITALTÄCKNING (PELARE III)



Rapport om risk och kapitaltäckning

Offentliggörande av information angående risk och kapitaltäckning (pelare III)

I enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2019/876 (CRR2) och Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2021:24 kap 8) om offentliggörande av information om kapitaltäckning och riskhantering ska följande information halvårsvis lämnas och finnas tillgänglig på www.mangold.se. Uppgifter redovisas för Mangold Fondkommission AB 556585-1267 och konsoliderad situation.

Belopp i tkr	Konsoliderad Situation 2021-09-30	Konsoliderad Situation 2021-06-30	Mangold Fondkommission 2021-09-30	Mangold Fondkommission 2021-06-30	
Tillgänglig kapitalbas (belopp)					
1	Kärnprimärkapital	165 819	118 397	149 970	133 175
2	Primärkapital	165 819	118 397	149 970	133 175
3	Totalt kapital	178 338	131 591	149 970	133 175

RISKVÄGDA EXPONERINGSBELOPP

4	Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 103 206	732 604	697 414	690 155
---	-----------------------------------	-----------	---------	---------	---------

KAPITALRELATIONER (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)

5	Kärnprimärkapitalrelation (i %)	15,0%	16,2%	21,5%	19,3%
6	Primärkapitalrelation (i %)	15,0%	16,2%	21,5%	19,3%
7	Total kapitalrelation (i %)	16,2%	18,0%	21,5%	19,3%

YTTERLIGARE KAPITALBASKRAV FÖR ATT HANTERA ANDRA RISKER ÄN RISKEN FÖR ALLTFÖR LÅG BRUTTOSOLIDITET (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)

EU 7a	Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera andra risker än risken för alltför låg bruttosoliditet (i %)	0%	0%	0%	0%
EU 7b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procenten-heter)	0%	0%	0%	0%
EU 7c	varav: ska utgöras av primärkapital (i procentenhet-er)	0%	0%	0%	0%
EU 7d	Totala kapitalbaskrav för översyns- och utvärderingspro-cessen (i %)	8%	8%	8%	8%

KOMBINERAT BUFFERTKRAV OCH SAMLAT KAPITALKRAV (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)

8	Kapitalkonserveringsbuffert (i %)	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%
EU 8a	Konserveringsbuffert på grund av makrotillsynsrisiker eller systemrisiker identifierade på medlemsstatsnivå (i %)	0%	0%	0%	0%
9	Institutspecifik kontracyklisk kapitalbuffert (i %)	0%	0%	0%	0%
EU 9a	Systemriskbuffert (i %)	0%	0%	0%	0%
10	Buffert för globalt systemviktigt institut (i %)	0%	0%	0%	0%
EU 10a	Buffert för andra systemviktiga institut (i %)	0%	0%	0%	0%

	Konsoliderad Situation	Konsoliderad Situation	Mangold Fondkommission	Mangold Fondkommission
Belopp i tkr	2021-09-30	2021-06-30	2021-09-30	2021-06-30

KOMBINERAT BUFFERTKRAV OCH SAMLAT KAPITALKRAV (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet) fortsättning

11	Kombinerat buffertkrav (i %)	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%
EU 11a	Samlade kapitalkrav (i %)	10,5%	10,5%	10,5%	10,5%
12	Tillgängligt kärnprimärkapital efter uppfyllande av de totala kapitalbaskraven för översyns- och utvärderings-processen (i %)	4,5%	5,7%	11,0%	8,8%

BRUTTOSOLIDITETSGRAD

13	Totalt exponeringsmått	1 059 157	942 972	995 189	953 163
14	Bruttosoliditetsgrad (i %)	15,7%	12,6%	15,1%	14,0%

YTTERLIGARE KAPITALBASKRAV FÖR ATT HANTERA RISKEN FÖR ALLTFÖR LÅG BRUTTOSOLIDITET (som en procentandel av det totala exponeringsmättet)

EU 14a	Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera risken för alltför låg bruttosoliditet (i %)	0%	0%	0%	0%
EU 14b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procenten-heter)	0%	0%	0%	0%
EU 14c	Totala krav avseende bruttosoliditetsgrad för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	0%	0%	0%	0%

BRUTTOSOLIDITETSBUFFERT OCH SAMLAT BRUTTOSOLIDITETSKRAV (som en procentandel av det totala exponeringsmättet)

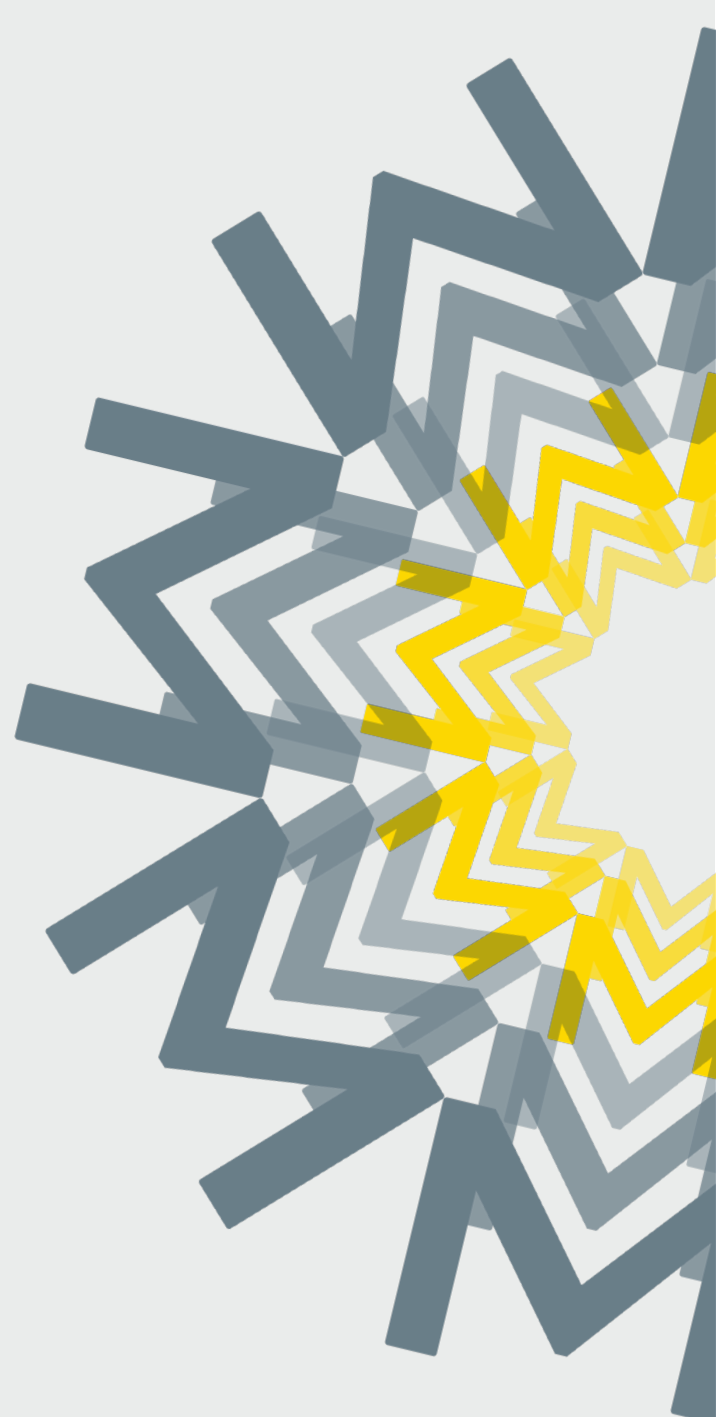
EU 14d	Krav på bruttosoliditetsbuffert (i %)	3%	3%	3%	3%
EU 14e	Samlat bruttosoliditetskrav (i %)	3%	3%	3%	3%

LIKVIDITETSTÄCKNINGSKVOT

15	Totala högkvalitativa likvida tillgångar (viktat värde - genomsnitt)	210 194	203 366	210 194	203 366
EU 16a	Likviditetsutflöden - totalt viktat värde	120 802	108 422	120 817	108 243
EU 16b	Likviditetsinflöden - totalt viktat värde	6 236	5 538	6 185	5 389
16	Totala nettolikviditetsutflöden (justerat värde)	114 566	102 884	114 631	102 854
17	Likviditetstäckningskvot (i %)	183,5%	197,7%	183,4%	197,7%

STABIL NETTOFINANSIERINGSKVOT

18	Total tillgänglig stabil finansiering	874 408	816 734	848 592	820 611
19	Totalt behov av stabil finansiering	486 105	450 869	482 282	465 934
20	Stabil nettofinansieringskvot (i %)	179,9%	181,1%	176,0%	176,1%



Q3 2021
