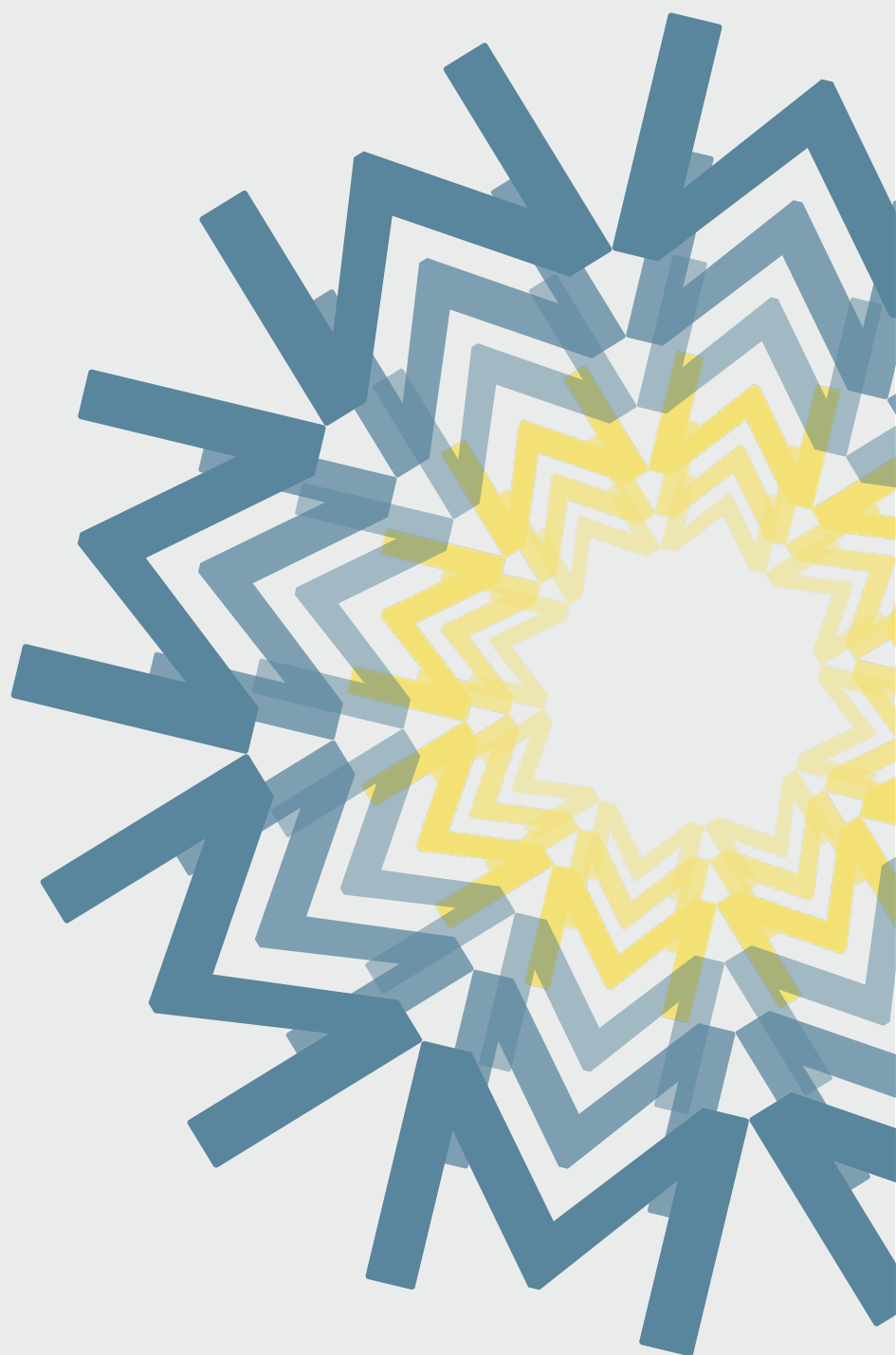


RAPPORT OM RISK OCH KAPITALTÄCKNING

Offentliggörande av information angående
risk och kapitaltäckning (pelare III)

Q1 2022



MANGOLD

Rapport om risk och kapitaltäckning

Offentliggörande av information angående risk och kapitaltäckning (pelare III)

I enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2013/575 (CRR) och Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2021:24 kap 8) om offentliggörande av information om kapitaltäckning och riskhantering ska följande information kvartalsvis lämnas och finnas tillgänglig på www.mangold.se. Uppgifter redovisas för Mangold Fondkommission AB och konsoliderad situation.

Organisation

I Mangold-koncernen ingår Mangold AB (org.nr 556628-5408) och Mangold Fondkommission AB (org.nr 556585-1267). Mangold Fondkommission AB är en fondkommissionär som erbjuder finansiella tjänster till företag, institutioner och privatpersoner genom de två segmenten Investment Banking och Private Banking. Moderbolaget Mangold AB fungerar som ett holdingbolag.

Dotterbolaget är i den konsoliderade situationen fullständigt konsoliderat. Konsolideringen av juridiska personer enligt redovisningen skiljer sig inte åt mot konsolideringen enligt tillsynskraven.

Risker och riskhantering

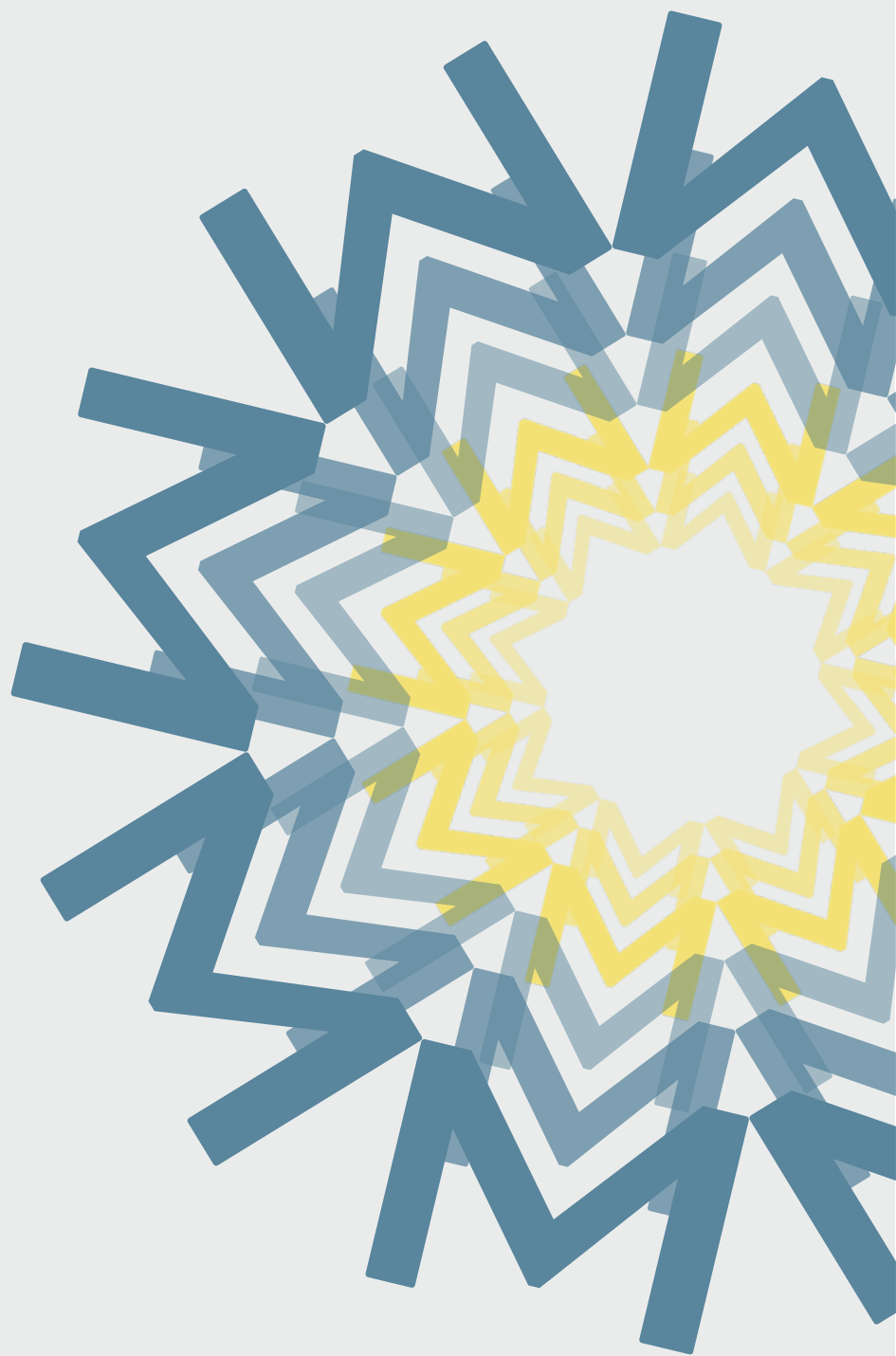
Mangold har en riskhanteringsfunktion som är fristående från den affärsdrivande verksamheten och som utgör en oberoende funktion för kontroll av bolagets risker. riskhanteringsfunktionen rapporterar till styrelsen samt till VD i den löpande verksamheten. I den senast publicerade årsredovisningen finns i not 3 en utförlig beskrivning av bolagets risker.

Internt bedömt kapital- och likviditetsbehov

I enlighet med gällande kapitaltäckningsregler upprättar Mangold en årlig intern kapital- och likviditetsutvärdering (IKLU). Arbetet med IKLU syftar till att analysera, bedöma samt säkerställa att Mangold är tillräckligt kapitaliserat i förhållande till de risker som bolaget exponeras för genom den verksamhet som bedrivs, samt att Mangold har tillräcklig likviditet för att täcka utflöden under stressade förhållanden. IKLU innehåller också en bedömning av att kapital och likviditet är tillräckliga i förhållande till den framtida utvecklingen. Processen och en sammanfattning av resultatet ska årligen rapporteras till styrelsen.

EU KM1 – Nyckeltal

Belopp i tkr		Konsoliderad Situation				Mangold Fondkommission			
		Q1 2022	Q4 2021	Q3 2021	Q2 2021	Q1 2022	Q4 2021	Q3 2021	Q2 2021
TILLGÄNGLIG KAPITALBAS (belopp)									
1	Kärnprimärkapital	161 953	177 120	165 819	118 397	156 672	156 672	149 970	133 175
2	Primärkapital	161 953	177 120	165 819	118 397	156 672	156 672	149 970	133 175
3	Totalt kapital	161 953	180 566	178 338	131 591	156 672	156 672	149 970	133 175
RISKVÄGDA EXPONERINGSBELOPP									
4	Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 076 080	1 117 242	1 103 206	732 604	799 565	720 567	697 414	690 155
KAPITALRELATIONER (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)									
5	Kärnprimärkapitalrelation (i %)	15,1%	15,9%	15,0%	16,2%	19,6%	21,7%	21,5%	19,3%
6	Primärkapitalrelation (i %)	15,1%	15,9%	15,0%	16,2%	19,6%	21,7%	21,5%	19,3%
7	Total kapitalrelation (i %)	15,1%	16,2%	16,2%	18,0%	19,6%	21,7%	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 %)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 7b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procenten-heter)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 7c	varav: ska utgöras av primärkapital (i procentenhet-er)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 7d	Totala kapitalbaskrav för översyns- och utvärderingspro-cessen (i %)	8%	8%	8%	8%	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%	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%
EU 8a	Konserveringsbuffert på grund av makrotillsynsrisiker eller systemrisiker identifierade på medlemsstatsnivå (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
9	Institutspecifik kontryckisk kapitalbuffert (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 9a	Systemriskbuffert (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
10	Buffert för globalt systemviktigt institut (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 10a	Buffert för andra systemviktiga institut (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
11	Kombinerat buffertkrav (i %)	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%	2,5%
EU 11a	Samlade kapitalkrav (i %)	10,5%	10,5%	10,5%	10,5%	10,5%	10,5%	10,5%	10,5%
12	Tillgängligt kärnprimärkapital efter uppfyllande av de totala kapitalbas-kraven för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	4,6%	5,4%	4,5%	5,7%	9,1%	11,2%	11,0%	8,8%
BRUTTOSOLIDITETSGRAD									
13	Totalt exponeringsmått	901 547	1 040 449	1 059 157	942 972	901 452	987 460	995 189	953 163
14	Bruttosoliditetsgrad (i %)	18,0%	17,0%	15,7%	12,6%	17,4%	15,9%	15,1%	14,0%
YTTERLIGARE KAPITALBASKRAV FÖR ATT HANTERA RISKEN FÖR ALLTFÖR LÅG BRUTTOSOLIDITET (som en procentandel av det totala exponeringsmåtten)									
EU 14a	Ytterligare kapitalbaskrav för att hantera risken för alltför låg brutto-soliditet (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 14b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procenten-heter)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 14c	Totala krav avseende bruttosoliditetsgrad för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRUTTOSOLIDITETSBUFFERT OCH SAMLAT BRUTTOSOLIDITETSKRAV (som en procentandel av det totala exponeringsmåtten)									
EU 14d	Krav på bruttosoliditetsbuffert (i %)	3%	3%	3%	3%	3%	3%	3%	3%
EU 14e	Samlat bruttosoliditetskrav (i %)	3%	3%	3%	3%	3%	3%	3%	3%
LIKVIDITETSTÄCKNINGSKVOT									
15	Totala högkvalitativa likvida tillgångar (genomsnitt)	241 464	233 452	210 194	203 366	241 464	233 452	210 194	203 366
EU 16a	Likviditetsutflöden – genomsnitt	121 446	122 751	120 802	108 422	121 355	122 765	120 817	108 243
EU 16b	Likviditetsinflöden – genomsnitt	7 078	6 574	6 236	5 538	6 820	6 408	6 185	5 389
16	Totala nettolikviditetsutflöden (justerat värde)	114 368	116 177	114 566	102 884	114 535	116 357	114 631	102 854
17	Likviditetstäckningskvot (i %)	213,7%	208,9%	183,5%	197,7%	213,4%	208,6%	183,4%	197,7%
STABIL NETTOFINANSIERINGSKVOT									
18	Total tillgänglig stabil finansiering	773 358	835 707	874 408	816 734	785 583	825 671	848 592	820 611
19	Totalt behov av stabil finansiering	417 672	457 940	486 105	450 869	449 033	466 064	482 282	465 934
20	Stabil nettofinansieringskvot (i %)	185,2%	182,5%	179,9%	181,1%	175,0%	177,2%	176,0%	176,1%



Q1 2022
