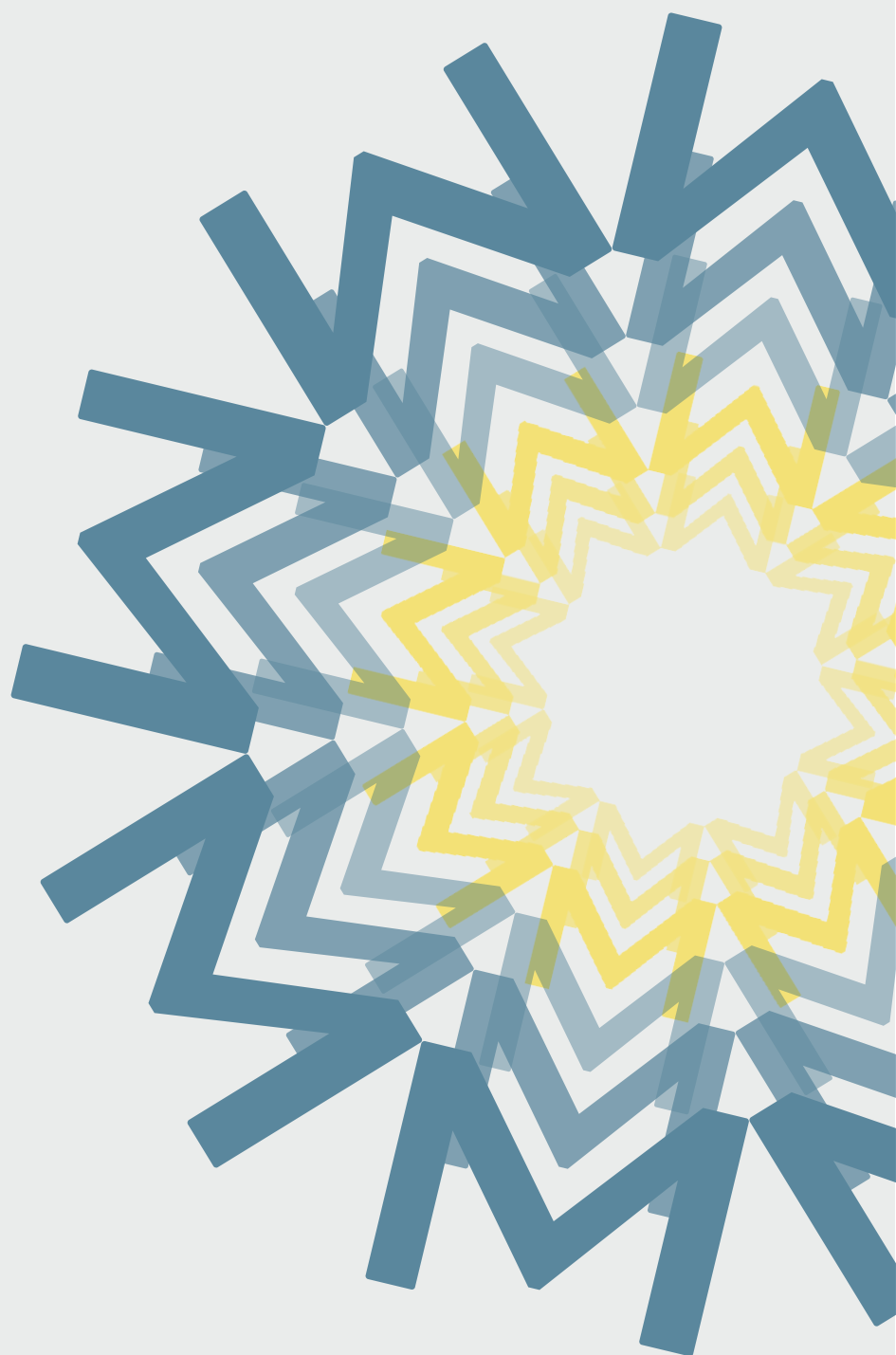


RAPPORT OM RISK OCH KAPITALTÄCKNING

Offentliggörande av information enligt pelare III

Q3 2023



MANGOLD

Offentliggörande av information om risk och kapitaltäckning

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

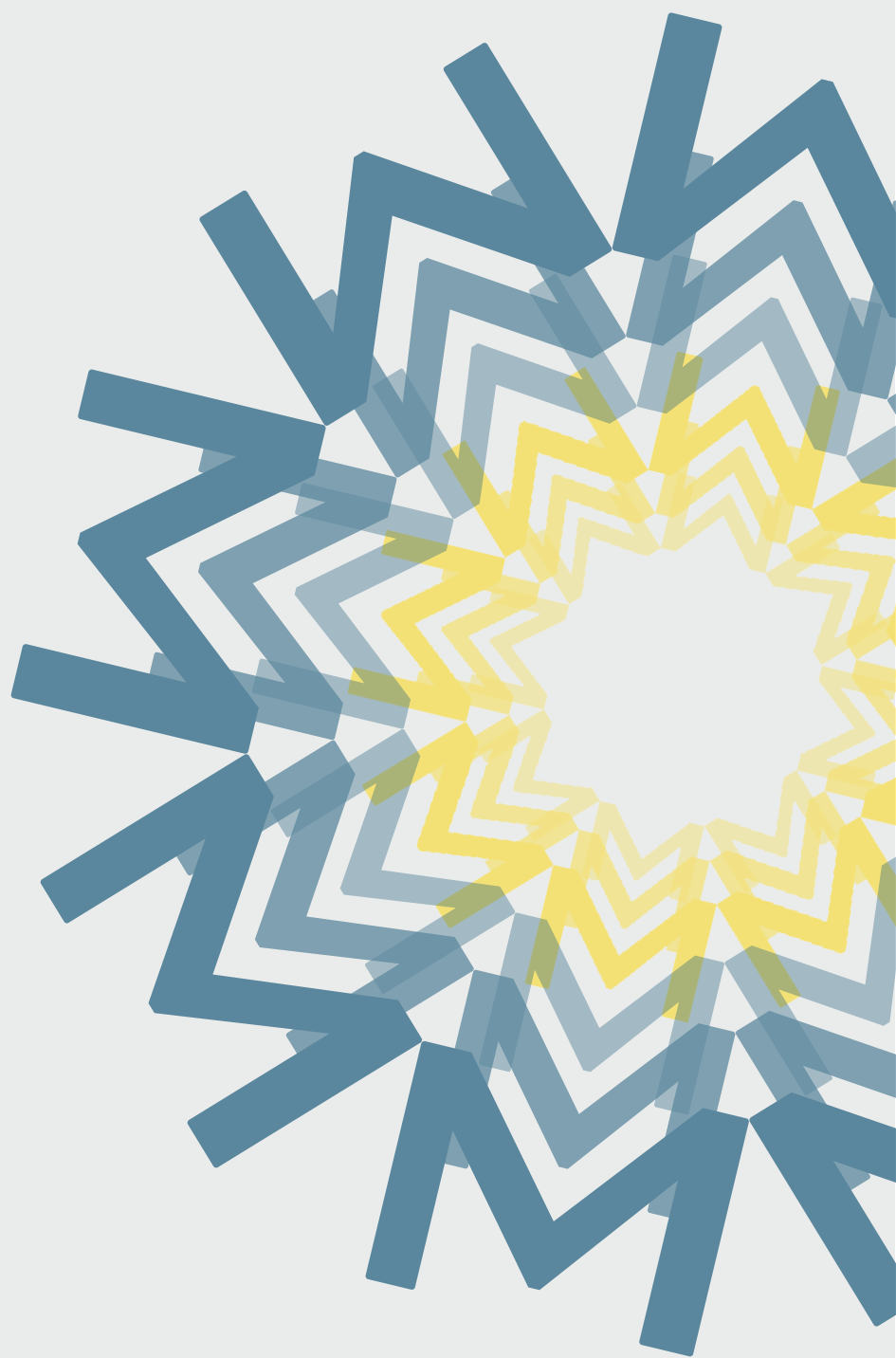
Mangold har en riskhanteringsfunktion som är fristående från den affärsdrivande verksamheten och som utgör en oberoende funktion för kontroll av bolagets risker. Riskhanteringsfunktionen rapporterar till styrelsen samt till VD i den löpande verksamheten. I den senast publicerade årsredovisningen finns 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			
		Q3 2023	Q2 2023	Q1 2023	Q4 2022	Q3 2023	Q2 2023	Q1 2023	Q4 2022
TILLGÄNGLIG KAPITALBAS (belopp)									
1	Kärnprimärkapital	157 611	176 403	169 777	179 687	154 322	161 524	165 658	168 582
2	Primärkapital	157 611	176 403	169 777	179 687	154 322	161 524	165 658	168 582
3	Totalt kapital	157 611	176 403	169 777	179 687	154 322	161 524	165 658	168 582
RISKVÄGDA EXPONERINGSBELOPP									
4	Totalt riskvägt exponeringsbelopp	891 272	948 324	955 281	998 588	712 199	761 138	750 608	741 198
KAPITALRELATIONER (som en procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)									
5	Kärnprimärkapitalrelation (i %)	17,7%	18,6%	17,8%	18,0%	21,7%	21,2%	22,1%	22,7%
6	Primärkapitalrelation (i %)	17,7%	18,6%	17,8%	18,0%	21,7%	21,2%	22,1%	22,7%
7	Total kapitalrelation (i %)	17,7%	18,6%	17,8%	18,0%	21,7%	21,2%	22,1%	22,7%
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 procentenheter)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 7c	varav: ska utgöras av primärkapital (i procentenheter)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 7d	Totala kapitalbaskrav för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%
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 kontracyklisk kapitalbuffert (i %)	2%	2%	1%	1%	2%	2%	1%	1%
EU 9a	Systemrisikbuffert (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
10	Buffert för globalt systemviktigt institut (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 10a	Buffert för andra systemviktiga institut (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
11	Kombinerat buffertkrav (i %)	4,5%	4,5%	3,5%	3,5%	4,5%	4,5%	3,5%	3,5%
EU 11a	Samlade kapitalkrav (i %)	12,5%	12,5%	11,5%	11,5%	12,5%	12,5%	11,5%	11,5%
12	Tillgängligt kärnprimärkapital efter uppfyllande av de totala kapitalbas-kraven för översyns- och utvärderingsprocessen (i %)	5,2%	6,1%	6,3%	6,5%	9,2%	8,7%	10,6%	11,2%
BRUTTOSOLIDITETSGRAD									
13	Totalt exponeringsmått	858 442	779 082	899 431	832 634	793 220	702 716	820 175	743 640
14	Bruttosoliditetsgrad (i %)	18,3%	22,6%	18,9%	21,6%	19,6%	23,1%	20,3%	22,7%
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 bruttosoliditet (i %)	-	-	-	-	-	-	-	-
EU 14b	varav: ska utgöras av kärnprimärkapital (i procentenheter)	-	-	-	-	-	-	-	-
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 %)	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%
EU 14e	Samlat bruttosoliditetskrav (i %)	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%	3,0%
LIKVIDITETSTÄCKNINGSKVOT									
15	Totala högkvalitativa likvida tillgångar (genomsnitt)	173 611	185 969	202 469	224 747	173 611	185 969	202 469	224 747
EU 16a	Likviditetsutflöden – genomsnitt	99 538	105 101	114 946	125 998	100 020	105 266	114 919	125 855
EU 16b	Likviditetsinflöden – genomsnitt	6 618	7 151	6 962	7 090	6 450	6 966	6 717	6 790
16	Totala nettolikviditetsutflöden (justerat värde)	92 920	101 463	107 984	118 908	93 570	101 739	108 202	119 065
17	Likviditetstäckningskvot (i %)	186,2%	187,0%	188,6%	189,2%	185,0%	186,5%	188,3%	188,9%
STABIL NETTOFINANSIERINGSKVOT									
18	Total tillgänglig stabil finansiering	773 880	674 953	796 843	747 029	714 885	604 378	737 184	678 944
19	Totalt behov av stabil finansiering	461 888	436 732	490 848	458 706	430 030	396 573	446 057	400 462
20	Stabil nettofinansieringskvot (i %)	167,5%	154,5%	162,3%	162,9%	166,2%	152,4%	165,3%	169,5%



Q3 2023
