

MANGOLD

Offentliggörande av information angående om kapitaltäckning

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2014:12 kap 8) om offentliggörandet av information om kapitaltäckning och riskhantering ska följande information lämnas varje kvartal och finnas tillgänglig på www.mangold.se.

Uppgifter redovisas för Mangold Fondkommission AB 556585-1267 och konsoliderad situation per 2020-06-30.

Risker och riskhantering

Hantering av olika former av risk är en integrerad del av Mangolds verksamhet. I årsredovisning för 2018 under avsnitt "Noter" framgår en utförligare beskrivning av bolagets risker och riskhantering. Bolaget bedömer att några väsentliga förändringar inte har skett sedan årsskiftet.

MANGOLD FONDKOMMISSION AB
STOCKHOLM | MALMÖ

POSTADRESS: BOX 55691, 102 15 STOCKHOLM | BESÖKSADRESS: ENGELBREKTSPLAN 2, 114 34 STOCKHOLM | HAMNGATAN 4, 211 22
MALMÖ TELEFON: 08-503 01 550 | FAX: 08-503 01 551 | E-POST: INFO@MANGOLD.SE | HEMSIDA: WWW.MANGOLD.SE
ORGANISATIONSNUMMER: 556585-1267

MANGOLD

Kapitaltäckning	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Belopp i MKR		
Kapitalbas		
Eget kapital exkl. årets delårs- eller årsresultat	165,7	102,4
Immateriella anläggningstillgångar	-3,7	-32,9
Årets förväntad utdelning	-0	-3,3
Total kärnprimärkapital innan reviderade siffror	161,9	66,1
Årets vinst/förlust	9,7	9,9
(-) Icke godtagbar del av delårs eller årsresultat	-1,9	-1,9
Total kärnprimärkapital	169,7	74,0
Primärkapitaltillskott	-80,0	0,0
Avdrag för primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt primärt kapital	89,7	74,0
Supplementärkapitaltillskott	0,0	18,4
Avdrag för supplementärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt supplementärt kapital	0,0	18,4
Total kapitalbas	89,7	92,4
Kapitalkrav Pelare 1		
Kapitalkrav för kreditrisk schablonmetoden	13,2	15,6
Kapitalkrav för marknadsrisk schablonmetoden	2,7	2,8
Kapitalkrav för operativ risk basmetoden	20,7	21,3
Summa minimikapitalkrav	36,5	39,7
Överskott av kapital	53,2	52,7
Kapitaltäckningskvot	2,5	2,3
Riskvägt exponeringsbelopp		
Riskvägt belopp kreditrisker	164,7	195,1
Riskvägt belopp marknadsrisker	33,5	35,2
Riskvägt belopp operativ risk	258,5	265,9
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	456,6	496,2
Kapitalrelationer		
Kärnprimärkapitalrelation, %	19,7 %	14,9 %
Primärkapitalrelation, %	19,7 %	14,9 %
Total kapitalrelation (kapitaltäckningsgrad) %	19,7 %	18,6 %
Krav på kapitalkonserveringsbuffert %	2,5 %	2,5 %
Krav på kontracyklisk kapitalbuffert %	0,0 %	0,0 %
Krav på systemriskbuffert%	0,0 %	0,0 %
Krav på globalt systemviktiga institut %	0,0 %	0,0 %
Institutspecifika buffertkrav %	2,5 %	2,5 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert %	11,7 %	8,9 %
Institutspecifik buffert kapitalkrav	11,4	12,4
Pelare 2 baskrav		
Total Pelare 2 baskrav	6,4	6,0
Totalt bedömt internt kapitalkrav	54,4	58,1
Överskott av kapital efter buffertkrav och Pelare 2 baskrav	35,4	34,3

MANGOLD FONDKOMMISSION AB
STOCKHOLM | MALMÖ

POSTADRESS: BOX 55691, 102 15 STOCKHOLM | BESÖKSADRESS: ENGELBREKTSPLAN 2, 114 34 STOCKHOLM | HAMNGATAN 4, 211 22
MALMÖ TELEFON: 08-503 01 550 | FAX: 08-503 01 551 | E-POST: INFO@MANGOLD.SE | HEMSIDA: WWW.MANGOLD.SE

ORGANISATIONSNUMMER: 556585-1267

MANGOLD

Bilaga 1 - Likviditetsrisk

Likviditetstäckningsgrad	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Likvida tillgångar (Mkr)		
Exponeringar där motparten har 0 % riskvikt enligt CRR	178,1	178,1
- varav delstatliga självstyrelseorgan, enligt CRR artikel 115	14,1	14,1
- varav lokala självstyrelseorgan enligt CRR artikel 115	164,0	164,0
Summa likvida tillgångar	178,1	178,1
Kassautflöden (Mkr)		
Inlåning från allmänheten	33,0	33,0
Övriga utflöden	24,5	24,6
Summa kassautflöden	57,5	57,6
Kassainflöden (Mkr)		
Övriga inflöden	9,8	9,8
Summa kassainflöden	9,8	9,8
Likviditetstäckningsgrad (%)	373,0 %	372,7 %

Bruttosoliditetsgrad	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Primärkapital (Mkr)	87,5	74,0
Totala exponering (Mkr)	530,5	530,3
Bruttosoliditetsgrad (%)	16,5 %	13,96%

MANGOLD

Bilaga 2 – Marknadsrisk

Marknadsrisk		
	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad situation
Positionsrisk i aktieknutna instrument (Mkr)	2,3	2,5
Positionsrisk i ränteknutna instrument (Mkr)	0,1	0,1
Valutarisk (Mkr)	0,2	0,2
Råvarurisk (Mkr)	0,0	0,0
Avvecklingsrisk (Mkr)	0,0	0,0
Summa kapitalkrav marknadsrisk	2,7	2,8

MANGOLD FONDKOMMISSION AB
STOCKHOLM | MALMÖ

POSTADRESS: BOX 55691, 102 15 STOCKHOLM | BESÖKSADRESS: ENGELBREKTSPLAN 2, 114 34 STOCKHOLM | HAMNGATAN 4, 211 22

MALMÖ TELEFON: 08-503 01 550 | FAX: 08-503 01 551 | E-POST: INFO@MANGOLD.SE | HEMSIDA: WWW.MANGOLD.SE

ORGANISATIONSNUMMER: 556585-1267

MANGOLD

Bilaga 3 - Kreditrisk

Kreditrisk

Mangold Fondkommission AB

Typ	Bruttoexponering	Riskvikt	Riskexponering	Riskexponering (efter konverteringsfaktor)	Kapitalkrav
Statsexponering	0,0	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Kommunexponering	215,9	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	129,6	20,0 %	25,9	25,9	2,1
Företagsexponering (små och medelstora företag)	45,6	75,0 %	34,2	26,0	2,1
Företagsexponering	58,1	100,0 %	58,1	58,1	4,6
Hushållsexponering	24,7	75,0 %	18,5	18,5	1,5
Myndighetsexponering	0,7	100,0 %	0,7	0,7	0,1
Fondexponering	1,6	100,0 %	1,6	1,6	0,1
Obeståndsfond	3,6	6,1 %	0,2	0,2	0,0
Övrig exponering	27,8	100,0 %	27,8	27,8	2,2
Exponering utanför BR	50,5		7,6	5,7	0,5
Total	558,1		174,6	164,5	13,2

Kreditrisk

Konsoliderad situation

Typ	Bruttoexponering	Riskvikt	Riskexponering	Riskexponering (efter konverteringsfaktor)	Kapitalkrav
Statsexponering	0,0	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Kommunexponering	215,9	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	91,3	20,0 %	18,3	18,3	1,5
Företagsexponering (små och medelstora företag)	45,6	75,0 %	34,2	26,0	2,1
Företagsexponering	58,1	100,0 %	58,1	58,1	4,6
Hushållsexponering	24,5	75,0 %	18,4	18,4	1,5
Myndighetsexponering	0,8	100,0 %	0,8	0,8	0,1
Fondexponering	1,6	100,0 %	1,6	1,6	0,1
Obeståndsfond	3,6	6,1 %	0,2	0,2	0,0
Övrig exponering	65,9	100,0 %	65,9	65,9	5,3
Exponering utanför BR	50,5		7,6	5,7	0,5
Total	557,8		205,1	195,0	15,6

MANGOLD FONDKOMMISSION AB
STOCKHOLM | MALMÖ

POSTADRESS: BOX 55691, 102 15 STOCKHOLM | BESÖKSADRESS: ENGELBREKTSPLAN 2, 114 34 STOCKHOLM | HAMNGATAN 4, 211 22
MALMÖ TELEFON: 08-503 01 550 | FAX: 08-503 01 551 | E-POST: INFO@MANGOLD.SE | HEMSIDA: WWW.MANGOLD.SE

ORGANISATIONSNUMMER: 556585-1267