

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 2020-12-31.

Risker och riskhantering

Hantering av olika former av risk är en integrerad del av Mangolds verksamhet. I årsredovisning för 2019 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	85,7	99,0
Immateriella anläggningstillgångar	-0,1	-29,2
Årets förväntad utdelning	-0	-0
Total kärnprimärkapital innan reviderade siffror	85,6	69,9
Årets vinst/förlust	21,5	26,4
(-) Icke godtagbar del av delårs eller årsresultat	-6,4	-7,9
Total kärnprimärkapital	100,6	88,4
Primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Avdrag för primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt primärt kapital	100,6	88,4
Supplementärkapitaltillskott	0,0	13,4
Avdrag för supplementärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt supplementärt kapital	0,0	13,4
Total kapitalbas	100,6	101,8
Kapitalkrav Pelare 1		
Kapitalkrav för kreditrisk schablonmetoden	17,4	20,2
Kapitalkrav för marknadsrisk schablonmetoden	4,1	4,3
Kapitalkrav för operativ risk basmetoden	20,7	21,3
Summa minimikapitalkrav	42,2	45,8
Överskott av kapital	58,5	55,9
Kapitaltäckningskvot	2,4	2,2
Riskvägt exponeringsbelopp		
Riskvägt belopp kreditrisker	217,1	253,0
Riskvägt belopp marknadsrisker	51,3	53,8
Riskvägt belopp operativ risk	258,5	265,9
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	526,9	572,7
Kapitalrelationer		
Kärnprimärkapitalrelation, %	19,1 %	15,4 %
Primärkapitalrelation, %	19,1 %	15,4 %
Total kapitalrelation (kapitaltäckningsgrad) %	19,1 %	17,7 %
Krav på kapitalplaneringsbuffert %	3,4 %	3,4 %
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 %	3,4 %	3,4 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert %	11,1 %	9,4 %
Institutspecifik buffert kapitalkrav	17,9	19,5
Pelare 2 baskrav		
Total Pelare 2 baskrav	7,0	6,2
Totalt bedömt internt kapitalkrav	67,1	71,4
Överskott av kapital efter buffertkrav och Pelare 2 baskrav	33,6	30,3

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	196,31	196,1
- varav delstatliga självstyrelseorgan, enligt CRR artikel 115	6,0	6,0
- varav lokala självstyrelseorgan enligt CRR artikel 115	190,1	190,1
Summa likvida tillgångar	196,1	196,1
Kassautflöden (Mkr)		
Inlåning från allmänheten	29,8	29,8
Övriga utflöden	91,4	91,5
Summa kassautflöden	121,2	121,3
Kassainflöden (Mkr)		
Övriga inflöden	3,7	3,7
Summa kassainflöden	3,7	3,7
Likviditetstäckningsgrad (%)	166,8 %	166,8 %

Bruttosoliditetsgrad	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Primärkapital (Mkr)	100,6	88,4
Totala exponering (Mkr)	584,7	576,2
Bruttosoliditetsgrad (%)	17,2 %	15,3 %

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 2 – Marknadsrisk

Marknadsrisk		
	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad situation
Positionsrisk i aktieknutna instrument (Mkr)	4,1	4,3
Positionsrisk i ränteknutna instrument (Mkr)	0,0	0,0
Valutarisk (Mkr)	0,0	0,0
Råvarurisk (Mkr)	0,0	0,0
Avvecklingsrisk (Mkr)	0,0	0,0
Summa kapitalkrav marknadsrisk	4,1	4,3

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 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	234,8	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	91,2	20,0 %	18,2	18,2	1,5
Företagsexponering (små och medelstora)	20,4	75,0 %	15,3	11,6	0,9
Företagsexponering	104,1	100,0 %	104,1	104,1	8,3
Hushållsexponering	55,9	75,0 %	41,9	41,9	3,4
Myndighetsexponering	0,8	100,0 %	0,8	0,8	0,1
Fondexponering	8,0	100,0 %	8,0	8,0	0,6
Obeståndsfond	3,6	8,5 %	1,0	1,0	0,1
Övrig exponering	26,0	100,0 %	26,0	26,0	2,1
Exponering utanför BR	53,6		8,0	6,1	0,5
Total	598,3		223,4	217,8	17,4

Kreditrisk

Konsoliderad situation

Typ	Bruttoexponering	Riskvikt	Riskexponering	Riskexponering (efter konverteringsfaktor)	Kapitalkrav
Statsexponering	0,0	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Kommunexponering	234,8	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	42,0	20,0 %	8,4	8,4	0,7
Företagsexponering (små och medelstora)	20,4	75,0 %	15,3	11,6	0,9
Företagsexponering	104,1	100,0 %	104,1	104,1	8,3
Hushållsexponering	55,8	75,0 %	41,8	41,8	3,3
Myndighetsexponering	0,8	100,0 %	0,8	0,8	0,1
Fondexponering	8,0	100,0 %	8,0	8,0	0,6
Obeståndsfond	3,6	8,5 %	1,0	1,0	0,1
Övrig exponering	71,8	100,0 %	71,8	71,8	5,7
Exponering utanför BR	53,6		8,0	6,1	0,5
Total	594,8		259,3	253,7	20,2

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