

## **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 samt Finansinspektionens föreskrifter och allmänna råd (FFFS 2012:6) om krav på likviditetstäckningsgrad och rapportering av likvida tillgångar och kassaflöden ska följande information lämnas varje kvartal och finnas tillgänglig på [www.mangold.se](http://www.mangold.se).

Uppgifter redovisas för Mangold Fondkommission AB 556585-1267 och konsoliderad situation per 2017-12-31.

## **Risker och riskhantering**

Hantering av olika former av risk är en integrerad del av Mangolds verksamhet. I årsredovisning för 2016 under avsnitt ”Noter” framgår en utförligare beskrivning av bolagets risker och riskhantering. Bolaget bedömer att några väsentliga förändringar inte har skett sedan årsskiftet.

# MANGOLD™

SNABB, MODERN & TILLGÄNGLIG

<b>Kapitaltäckning</b>	<b>Mangold Fondkommission AB</b>	<b>Konsoliderad Situation</b>
Belopp i MKR		
<b>Kapitalbas</b>		
Eget kapital exkl. årets delårs- eller årsresultat	72,0	67,8
Immateriella anläggningstillgångar	-5,9	-35,7
Årets förväntad utdelning	0,0	0,0
<b>Total kärnprimärkapital innan reviderade siffror</b>	<b>66,1</b>	<b>32,0</b>
Årets vinst/förlust	12,0	11,8
(-) Icke godtagbar del av delårs eller årsresultat	-2,4	-2,4
<b>Total kärnprimärkapital</b>	<b>75,7</b>	<b>41,5</b>
Primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Avdrag för primärkapitaltillskott	0,0	0,0
<b>Totalt primärt kapital</b>	<b>75,7</b>	<b>41,5</b>
Supplementärkapitaltillskott	0,0	16,0
Avdrag för supplementärkapitaltillskott	0,0	0,0
<b>Totalt supplementärt kapital</b>	<b>0,0</b>	<b>16,0</b>
<b>Total kapitalbas</b>	<b>75,7</b>	<b>57,5</b>
<b>Kapitalkrav Pelare 1</b>		
Kapitalkrav för kreditrisk schablonmetoden	12,6	8,7
Kapitalkrav för marknadsrisker schablonmetoden	3,5	3,5
Kapitalkrav för operativ risk basmetoden	17,2	18,1
<b>Summa minimikapitalkrav</b>	<b>33,3</b>	<b>30,3</b>
Överskott av kapital	42,4	27,2
<b>Kapitaltäckningskvot</b>	<b>2,3</b>	<b>1,9</b>
<b>Riskvägt exponeringsbelopp</b>		
Riskvägt belopp kreditrisker	156,9	108,9
Riskvägt belopp marknadsrisker	43,3	43,3
Riskvägt belopp operativ risk	215,5	226,0
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>415,7</b>	<b>378,2</b>
<b>Kapitalrelationer</b>		
Kärnprimärkapitalrelation, %	18,2 %	11,0 %
Primärkapitalrelation, %	18,2 %	11,0 %
<b>Total kapitalrelation (kapitaltäckningsgrad) %</b>	<b>18,2 %</b>	<b>15,2 %</b>
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 %
<b>Institutspecifika buffertkrav %</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,5 %</b>
<b>Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert %</b>	<b>10,2 %</b>	<b>5,0 %</b>
<b>Institutspecifik buffert kapitalkrav</b>	<b>10,4</b>	<b>9,5</b>
<b>Pelare 2 baskrav</b>		
<b>Total Pelare 2 baskrav</b>	<b>1,9</b>	<b>1,3</b>
<b>Totalt bedömt internt kapitalkrav</b>	<b>45,5</b>	<b>41,0</b>
<b>Överskott av kapital efter buffertkrav och Pelare 2 baskrav</b>	<b>30,1</b>	<b>16,4</b>

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

## Bilaga 1 - Likviditetsrisk

<b>Likviditetstäckningsgrad</b>	<b>Mangold Fondkommission AB</b>	<b>Konsoliderad Situation</b>
<b>Likvida tillgångar (Mkr)</b>		
Tillgångar med 100 % riskvikt	224,7	224,7
<b>Summa likvida tillgångar</b>	<b>224,7</b>	<b>224,7</b>
<b>Kassautflöden (Mkr)</b>		
Inlåning från allmänheten	29,2	29,2
Övriga utflöden	37,0	37,1
<b>Summa kassautflöden</b>	<b>66,2</b>	<b>66,2</b>
<b>Kassainflöden (Mkr)</b>		
Övriga inflöden	8,5	8,5
<b>Summa kassainflöden</b>	<b>8,5</b>	<b>8,5</b>
<b>Likviditetstäckningsgrad (%)</b>	<b>389,4 %</b>	<b>389,3 %</b>

<b>Bruttosoliditetsgrad</b>	<b>Mangold Fondkommission AB</b>	<b>Konsoliderad Situation</b>
<b>Primärkapital (Mkr)</b>	<b>75,7</b>	<b>41,5</b>
<b>Totala exponering (Mkr)</b>	<b>515,0</b>	<b>442,9</b>
<b>Bruttosoliditetsgrad (%)</b>	<b>14,7 %</b>	<b>9,4 %</b>

## Bilaga 2 – Marknadsrisk

**Marknadsrisk**

	<b>Mangold Fondkommission AB</b>	<b>Konsoliderad situation</b>
Positionsrisk i aktieknutna instrument (Mkr)	2,8	2,8
Positionsrisk i ränteknutna instrument (Mkr)	0,6	0,6
Valutarisk (Mkr)	0,0	0,0
Råvarurisk (Mkr)	0,0	0,0
Avvecklingsrisk (Mkr)	0,0	0,0
<b>Summa kapitalkrav marknadsrisk</b>	<b>3,5</b>	<b>3,5</b>

## 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	239,9	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	43,0	20,0 %	8,6	8,6	0,7
Företagsexponering (små och medelstora företag)	22,3	75,0 %	16,7	12,7	1,0
Företagsexponering	1,0	100,0 %	1,0	1,0	0,1
Hushållsexponering	76,3	75,0 %	57,3	57,3	4,6
Myndighetsexponering	0,6	100,0 %	0,6	0,6	0,0
Fondexponering	6,4	100,0 %	6,4	6,4	0,5
Obeståndsfond	2,4	28,9 %	0,7	0,7	0,1
Övrig exponering	62,7	100,0 %	62,7	62,7	5,0
Exponering utanför BR	66,4		10,0	7,6	0,6
<b>Total</b>	<b>521,0</b>		<b>163,9</b>	<b>157,5</b>	<b>12,6</b>

### Kreditrisk

#### Konsoliderad situation

Typ	Bruttoexponering	Riskvikt	Riskexponering	Riskexponering (efter konverteringsfaktor)	Kapitalkrav
Statsexponering	0,0	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Kommunexponering	239,9	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	44,1	20,0 %	8,8	8,8	0,7
Företagsexponering (små och medelstora företag)	22,3	75,0 %	16,7	12,7	1,0
Företagsexponering	1,0	100,0 %	1,0	1,0	0,1
Hushållsexponering	77,9	75,0 %	58,4	58,4	4,7
Myndighetsexponering	1,2	100,0 %	1,2	1,2	0,1
Fondexponering	6,4	100,0 %	6,4	6,4	0,5
Obeståndsfond	2,4	28,9 %	0,7	0,7	0,1
Övrig exponering	12,7	100,0 %	12,7	12,7	1,0
Exponering utanför BR	66,4		10,0	7,6	0,6
<b>Total</b>	<b>474,2</b>		<b>115,9</b>	<b>109,5</b>	<b>8,8</b>