

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.

Uppgifter redovisas för Mangold Fondkommission AB 556585-1267 och konsoliderad situation per 2016-09-30.

Risker och riskhantering

Hantering av olika former av risk är en integrerad del av Mangold verksamhet. I årsredovisning för 2015 under avsnitt ”Noter” framgår en utförligare beskrivning av bolagets risker och riskhantering. Bolaget bedömer att några väsentliga förändringar inte har skett sedan årsskiftet.

Kapitaltäckning	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Belopp i MKR		
Kapitalbas		
Eget kapital exkl årets delårs- eller årsresultat	64,6	63,4
Immateriella anläggningstillgångar	-2,5	-33,2
Årets förväntad utdelning	0,0	0,0
Total kärnprimärkapital innan reviderade siffror	62,1	30,3
Årets vinst/förlust	1,4	5,0
(-) Icke godtagbar del av delårs eller årsresultat	-0,3	-1,0
Total kärnprimärkapital	63,3	34,3
Primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Avdrag för primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt primärt kapital	63,3	34,3
Supplementärkapitaltillskott	0,0	16,0
Avdrag för supplementärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt supplementärt kapital	0,0	16,0
Total kapitalbas	63,3	50,3
Kapitalkrav Pelare 1		
Kapitalkrav för kreditrisk schablonmetoden	12,2	9,2
Kapitalkrav för marknadsrisker schablonmetoden	2,4	2,4
-varav positionsrisk i aktieknutna instrument	2,0	2,0
-varav positionsrisk i ränteknutna instrument	0,1	0,1
-varav valutarisk	0,3	0,3
-varav råvarurisk	0,0	0,0
-varav avvecklingsrisk	0,0	0,0
Kapitalkrav för operativ risk basmetoden	14,0	14,6
Summa minimikapitalkrav	28,6	26,2
Överskott av kapital	34,7	24,1
Kapitaltäckningskvot	2,2	1,9
Riskvägt exponeringsbelopp		
Riskvägt belopp kreditrisker	152,4	115,2
Riskvägt belopp marknadsrisker	29,9	29,9
-varav positionsrisk i aktieknutna instrument	25,3	25,3
-varav positionsrisk i ränteknutna instrument	1,4	1,4
-varav valutarisk	3,2	3,2
-varav råvarurisk	0,0	0,0
-varav avvecklingsrisk	0,0	0,0
Riskvägt belopp operativ risk	174,8	182,3
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	357,1	327,4
Kapitalrelationer		
Kärnprimärkapitalrelation, %	17,7 %	10,5 %
Primärkapitalrelation, %	17,7 %	10,5 %
Total kapitalrelation (kapitaltäckningsgrad) %	17,7 %	15,4 %
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 %	9,7 %	4,5 %
Institutspecifik buffert kapitalkrav	8,9	8,2
Pelare 2 baskrav		
Pensionsrisk	0,0	0,0
Ränterisk	0,4	0,2
Koncentrationsrisk	2,6	1,9
Övrig risk	0,3	0,3
Total Pelare 2 baskrav	3,3	2,4
Överskott av kapital efter buffertkrav och Pelare 2 baskrav	22,5	13,5

MANGOLD™

SNABB, MODERN & TILLGÄNGLIG

Likviditetstäckningsgrad	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Likvida tillgångar (Mkr)		
Tillgångar med 100 % riskvikt	212,0	212,0
Summa likvida tillgångar	212,0	212,0
Kassautflöden (Mkr)		
Inlåning från allmänheten	26,5	26,5
Övriga utflöden	126,8	126,9
Summa kassautflöden	153,3	153,4
Kassainflöden (Mkr)		
Övriga inflöden	7,3	7,7
Summa kassainflöden	7,3	7,7
Likviditetstäckningsgrad (%)	145,2 %	145,6 %

Bruttosoliditetsgrad	
Mangold Fondkommission AB	September
Primärkapital (Mkr)	63,3
Totala exponering (Mkr)	551,6
Bruttosoliditetsgrad (medelvärde)	11,5 %

Bruttosoliditetsgrad	
Konsoliderad situation	September
Primärkapital (Mkr)	34,3
Totala exponering (Mkr)	498,0
Bruttosoliditetsgrad (medelvärde)	6,9 %

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