

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 2017-03-31.

Risker och riskhantering

Hantering av olika former av risk är en integrerad del av Mangold 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

Kapitaltäckning	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Belopp i MKR		
Kapitalbas		
Eget kapital exkl. årets delårs- eller årsresultat	73,1	68,9
Immateriella anläggningstillgångar	-3,7	-34,1
Årets förväntad utdelning	-1,1	-1,1
Total kärnprimärkapital innan reviderade siffror	68,3	33,7
Årets vinst/förlust	3,3	3,2
(-) Icke godtagbar del av delårs eller årsresultat	-3,3	-3,2
Total kärnprimärkapital	68,3	33,7
Primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Avdrag för primärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt primärt kapital	68,3	33,7
Supplementärkapitaltillskott	0,0	16,0
Avdrag för supplementärkapitaltillskott	0,0	0,0
Totalt supplementärt kapital	0,0	16,0
Total kapitalbas	68,3	49,7
Kapitalkrav Pelare 1		
Kapitalkrav för kreditrisk schablonmetoden	11,8	8,1
Kapitalkrav för marknadsrisker schablonmetoden	2,6	2,6
Kapitalkrav för operativ risk basmetoden	14,9	15,6
Summa minimikapitalkrav	29,3	26,4
Överskott av kapital	39,0	23,3
Kapitaltäckningskvot	2,3	1,9
Riskvägt exponeringsbelopp		
Riskvägt belopp kreditrisker	147,5	101,1
Riskvägt belopp marknadsrisker	32,8	32,8
Riskvägt belopp operativ risk	186,2	195,5
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	366,5	329,4
Kapitalrelationer		
Kärnprimärkapitalrelation, %	18,6 %	10,2 %
Primärkapitalrelation, %	18,6 %	10,2 %
Total kapitalrelation (kapitaltäckningsgrad) %	18,6 %	15,1 %
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 %	10,6 %	4,2 %
Institutspecifik buffert kapitalkrav	9,2	8,2
Pelare 2 baskrav		
Pensionsrisk	0,0	0,0
Ränterisk	0,7	0,7
Affärsrisk	1,0	1,0
Koncentrationsrisk	1,7	1,1
Övrig risk	0,9	0,4
Total Pelare 2 baskrav	4,2	3,2
Överskott av kapital efter buffertkrav och Pelare 2 baskrav	25,6	11,9

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

Bilaga 1 - Likviditetsrisk

Likviditetstäckningsgrad	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Likvida tillgångar (Mkr)		
Tillgångar med 100 % riskvikt	168,9	168,9
Summa likvida tillgångar	168,9	168,9
Kassautflöden (Mkr)		
Inlåning från allmänheten	26,0	26,0
Övriga utflöden	30,9	31,0
Summa kassautflöden	56,9	57,0
Kassainflöden (Mkr)		
Övriga inflöden	6,6	6,6
Summa kassainflöden	6,6	6,6
Likviditetstäckningsgrad (%)	335,7 %	335,3 %

Bruttosoliditetsgrad	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad Situation
Primärkapital (Mkr)	68,3	33,7
Totala exponering (Mkr)	448,2	375,2
Bruttosoliditetsgrad (%)	15,2 %	9,0 %

Bilaga 2 – Marknadsrisk

Marknadsrisk

	Mangold Fondkommission AB	Konsoliderad situation
Positionsrisk i aktieknutna instrument (Mkr)	2,6	2,6
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	2,6	2,6

Bilaga 3 - Kreditrisk

Kreditrisk

Konsoliderad situation

Typ	Bruttoexponering	Riskvikt	Riskexponering	Riskexponering (efter konverteringsfaktor)	Kapitalkrav
Statsexponering	0,0	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Kommunexponering	184,1	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	44,7	20,0 %	8,9	8,9	0,7
Företagsexponering (små och medelstora företag)	42,0	75,0 %	32,0	24,0	1,9
Företagsexponering	10,0	100,0 %	10,0	10,0	0,8
Hushållsexponering	38,7	75,0 %	29,0	29,0	2,3
Myndighetsexponering	0,5	100,0 %	0,5	0,5	0,0
Fondexponering	5,1	100,0 %	5,1	5,1	0,4
Obeståndsfond	2,5	38,6 %	1,0	1,0	0,1
Övrig exponering	16,7	100,0 %	16,7	16,7	1,3
Exponering utanför BR	50,5		7,6	5,8	0,5
Total	394,8		110,8	101,0	8,1

Kreditrisk

Mangold Fondkommission AB

Typ	Bruttoexponering	Riskvikt	Riskexponering	Riskexponering (efter konverteringsfaktor)	Kapitalkrav
Statsexponering	0,0	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Kommunexponering	184,1	0,0 %	0,0	0,0	0,0
Insitutionsexponering	44,4	20,0 %	8,9	8,9	0,7
Företagsexponering (små och medelstora företag)	42,0	75,0 %	32,0	24,0	1,9
Företagsexponering	10,0	100,0 %	10,0	10,0	0,8
Hushållsexponering	38,7	75,0 %	29,0	29,0	2,3
Myndighetsexponering	0,0	100,0 %	0,0	0,0	0,0
Fondexponering	5,1	100,0 %	5,1	5,1	0,4
Obeståndsfond	2,5	38,6 %	1,0	1,0	0,1
Övrig exponering	63,6	100,0 %	63,6	63,6	5,1
Exponering utanför BR	50,5		7,6	5,8	0,5
Total	440,9		157,2	147,4	11,8