

Kvartalsvis offentliggörande av information
om kapitaltäckning och likviditet
MFEX (Konsoliderad situation)
Q3 2018



Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q3 2018

Informationen i detta dokument offentliggörs av MFEX Mutual Funds Exchange AB (org.nr. 556559-0634) på grundval av dess konsoliderade situation.

Offentliggörandet görs i enlighet med 8 kap. 3-10 §§ Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) om tillsynskrav och kapitalbuffertar.

Ett moderinstitut ska vid varje tidpunkt uppfylla en kärnprimärkapitalrelation på minst 4,5 %, en primärkapitalrelation på minst 6 %, en total kapitalrelation på minst 8 % samt de institutsspecifika buffertkraven på grundval av dess konsoliderade situation. Dessa beräknas enligt Förordning (EU) nr 575/2013.

Kapitalbas

SEK (tkr)	
Kärnprimärkapital	622 357
Övrigt primärkapital	3 577
Supplementärkapital	4 769
Total kapitalbas	630 703

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	782 031
- Varav: exponeringar mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot institut	161 535
- Varav: exponeringar mot företag	555 112
- Varav: exponering mot institut och företag med ett kortfristigt kreditbetyg	-
- Varav: aktieexponeringar	21 320
- Varav: övriga poster	44 064
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	172 896
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	954 927

Kapitalkrav

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) och SEK (tkr)		
Totalt Pelare I krav	8,00 %	76 394
Internt bedömt kapitalkrav enligt Pelare II	3,98 %	37 989
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	23 873
Kontracykliskbuffert	1,30 %	12 443
Totalt Pelare I och II samt regulatoriskt buffertkrav	15,78 %	150 699

Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	65,17 %
Primärkapital	65,55 %
Totalt kapital	66,05 %
Institutsspecifika buffertkrav	3,80 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	1,30 %
- Varav: krav på systemriskbuffert	-
- Varav: buffert för globalt systemviktigt institut eller för annat systemviktigt institut	-
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	57,17 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2017 avseende 2017-09-30. IKLU har uppdaterats per 2018-09-30. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 114 383 tkr för MFEX konsoliderade situation. Kapitalbasen uppfyller därmed både syftet att täcka det totala interna kapitalkravet med god marginal samt att utgöra ett förtroendekapital gentemot kunder, aktieägare och andra intressenter.

Offentliggörande av information om likviditetsrisker i enlighet med FFFS 2010:7 – Q3 2018

Informationen i detta dokument offentliggörs av MFEX Mutual Funds Exchange AB (org.nr. 556559-0634) på grundval av dess konsoliderade situation.

Offentliggörandet görs i enlighet med FFFS 2014:21 5 kap. 2 § Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2010:7) om hantering av likviditetsrisker för kreditinstitut och värdepappersbolag.

Likviditetsreserv

SEK (tkr)	
Utlåning till kreditinstitut	783 036
Checkräkningskredit	30 000
Likviditetsreserv	813 036

Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Skulder och avsättningar	635 749
Eget kapital	2 318 865
Balansomslutning	2 954 614

Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet ¹⁾	2,48
Likviditetsrisk ²⁾	753 036

1) kvoten av summa utlåning till kreditinstitut och övriga tillgångar genom övriga skulder

2) differensen mellan likviditetsreserven och minimum kravet på 60 mkr

MFEX, är en global handelsplattform för fonder, som erbjuder en komplett lösning för fondhandel, volymprovisioner, fondinformation och regulatoriska tjänster. Banker och andra distributörer av fonder använder MFEX för att enkelt och kostnadseffektivt handla fonder globalt. Via MFEX får man tillgång till världens största fondutbud med handel och fondinformation från de mer än 820 fondbolag och över 60 000 fonder som MFEX samarbetar med. MFEX sköter även hantering av volymprovisioner med full transparens för både distributörer och fondbolag. MFEX har sitt huvudkontor i Stockholm samt kontor i Umeå, Paris, Genève, Madrid, Milano och Singapore.