

Kvartalsvis offentliggörande av information
om kapitaltäckning och likviditet
MFEX (Konsoliderad situation)
Q3 2019



Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q3 2019

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 institut och på grundval av dess konsoliderade situation 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. Dessa beräknas enligt förordning (EU) nr 575/2013.

Kapitalbas

SEK (tkr)	
Kärnprimärkapital	245 611
Övrigt primärkapital	10 412
Supplementärkapital	13 882
Total kapitalbas	269 905

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	1 315 957
- Varav: exponeringar mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot institut	134 807
- Varav: exponeringar mot företag	1 066 181
- Varav: aktieexponeringar	35 564
- Varav: övriga poster	79 405
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	214 762
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditvärderingsjustering enligt schablonmetoden	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 530 719

Kapitalkrav

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) och SEK (tkr)		
Totalt Pelare I krav	8,00 %	122 458
Internt bedömt kapitalkrav enligt Pelare II	3,29 %	50 359
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	38 268
Kontracykliskbuffert	0,72 %	11 077
Totalt Pelare I och II samt regulatoriskt buffertkrav	14,51 %	222 162

Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	16,05 %
Primärkapital	16,73 %
Totalt kapital	17,63 %
Institutsspecifika buffertkrav	3,22 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,72 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	8,05 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2018 avseende 2018-09-30. IKLU:n har uppdaterats per 2019-09-30. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 172 817 tkr för MFEX konsoliderade situation. Kapitalbasen täcker därmed det totala internt bedömda kapitalbehovet med marginal.

Offentliggörande av information om likviditetsrisker i enlighet med FFFS 2010:7 – Q3 2019

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	616 162
Checkräkningskrediter	50 000
Likviditetsreserv	666 162

Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Skulder och avsättningar	1 669 379
Eget kapital	2 341 584
Balansomslutning	4 010 963

Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet ¹⁾	1,07
Likviditetsrisk (utnyttjande av checkräkningskrediter i tkr) ²⁾	0

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

2) Likviditetsreserven får inte understiga 128 MSEK. Per 2019-09-30 överstiger likviditetsreserven likviditets risk limiten.

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 920 fondbolag och över 72 000 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, Madrid, Luxembourg, London, Milano, Genève, Singapore och Kuala Lumpur.