

Kvartalsvis offentliggörande av information
om kapitaltäckning och likviditet
MFEX (Konsoliderad situation)
Q1 2021



Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q1 2021

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.

MFEX Mutual Funds Exchange AB, finansiella moder holding företaget och de andra finansiella holding företagen ändrade sina redovisningsvalutor från SEK till EUR den 1 januari 2020. Samtidigt ändrade MFEX konsoliderade situation sin presentations valuta till EUR. I enlighet med Finansinspektionens direktiv sker dock fortfarande rapporteringen till myndigheten i SEK, därmed presenteras nedan information fortfarande i SEK. Omräkningen från EUR till SEK per 2021-03-31 har skett till valutakursen 10,2376.

Kapitalbas

SEK (tkr)	
Kärnprimärkapital	303 322
Övrigt primärkapital	11 581
Supplementärkapital	15 442
Total kapitalbas	330 345

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	1 626 289
- Varav: exponeringar mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot institut	389 632
- Varav: exponeringar mot företag	1 077 546
- Varav: aktieexponeringar	22 067
- Varav: övriga poster	137 044
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	137 703
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 763 992

Kapitalkrav

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) och SEK (tkr)		
Totalt Pelare I krav	8,00 %	141 119
Internt bedömt kapitalkrav enligt Pelare II	4,12 %	72 722
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	44 100
Kontracykliskbuffert	0,13 %	2 205
Totalt Pelare I och II samt regulatoriskt buffertkrav	14,75 %	260 146

Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	17,20 %
Primärkapital	17,85 %
Totalt kapital	18,73 %
Institutsspecifika buffertkrav	2,63 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,13 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	9,20 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2020 avseende 2020-09-30. IKLU:n har uppdaterats per 2021-03-31. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 213 841 ksek 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 – Q1 2021

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.

MFEX Mutual Funds Exchange AB, finansiella moder holding företaget och de andra finansiella holding företagen ändrade sina redovisningsvalutor från SEK till EUR den 1 januari 2020. Samtidigt ändrade MFEX konsoliderade situation sin presentations valuta till EUR. I enlighet med Finansinspektionens direktiv sker dock fortfarande rapporteringen till myndigheten i SEK, därmed presenteras nedan information fortfarande i SEK. Omräkningen från EUR till SEK per 2021-03-31 har skett till valutakursen 10,2376.

Likviditetsreserv

SEK (tkr)	
Utlåning till kreditinstitut	1 382 390
Checkräkningskrediter (outnyttjade)	4 760
Likviditetsreserv	1 387 150

Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Skulder och avsättningar	2 922 521
Eget kapital	2 532 661
Balansomslutning	5 455 182

Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet ¹⁾	1,09
Likviditetsrisk ²⁾	1 259 150

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

2) skillnaden mellan total likviditetsreserv och minimum likviditetsreserv inklusive checkräkningskrediter på 128 MSEK

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 950 fondbolag och över 80 000 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, Kuala Lumpur och Hong Kong.