

# Kvartalsvis offentliggörande av information om kapitaltäckning och likviditet MFEX (Konsoliderad situation) Q3 2020



## Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q3 2020

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, MFEX finansiella holding bolag och MFEX finansiella moder holding bolag 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 (valutakurs EUR/SEK 10,541).

### Kapitalbas

SEK (tkr)	
Kärnprimärkapital	245 472
Övrigt primärkapital	8 359
Supplementärkapital	11 146
Total kapitalbas	264 977

### Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	1 342 045
- Varav: exponeringar mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot institut	280 625
- Varav: exponeringar mot företag	912 074
- Varav: aktieexponeringar	23 723
- Varav: övriga poster	125 623
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	134 994
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditvärderingsjustering enligt schablonmetoden	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 477 039

### Kapitalkrav

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) och SEK (tkr)		
Totalt Pelare I krav	8,00 %	118 163
Internt bedömt kapitalkrav enligt Pelare II	4,67 %	68 915
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	36 926
Kontracykliskbuffert	0,07 %	1 041
Totalt Pelare I och II samt regulatoriskt buffertkrav	15,24 %	225 045

**Kapitalrelationer och kapitalbuffertar**

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	16,62 %
Primärkapital	17,19 %
Totalt kapital	17,94 %
Institutsspecifika buffertkrav	2,57 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,07 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	8,62 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2019 avseende 2019-09-30. IKLU:n har uppdaterats per 2020-09-30. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 187 078 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 2020

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, MFEX finansiella holding bolag och MFEX finansiella moder holding bolag 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 (valutakurs EUR/SEK 10,541).

### Likviditetsreserv

SEK (tkr)	
Utlåning till kreditinstitut	833 041
Checkräkningskrediter (outnyttjade)	0
Likviditetsreserv	833 041

### Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Skulder och avsättningar	2 270 020
Eget kapital	2 492 289
Balansomslutning	4 762 309

### Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet <sup>1)</sup>	1,09
Likviditetsrisk <sup>2)</sup>	705 041

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 och Kuala Lumpur.