

Kvartalsvis offentliggörande av information  
om kapitaltäckning och likviditet  
MFEX (Konsoliderad situation)  
Q2 2019



## Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q2 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	257 182
Övrigt primärkapital	11 006
Supplementärkapital	14 674
Total kapitalbas	282 862

### Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	1 363 585
- Varav: exponeringar mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot institut	125 143
- Varav: exponeringar mot företag	1 117 627
- Varav: aktieexponeringar	35 554
- Varav: övriga poster	85 261
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	238 689
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditvärderingsjustering enligt schablonmetoden	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 602 273

### Kapitalkrav

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) och SEK (tkr)		
Totalt Pelare I krav	8,00 %	128 182
Internt bedömt kapitalkrav enligt Pelare II	3,28 %	52 609
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	40 057
Kontracykliskbuffert	0,35 %	5 599
Totalt Pelare I och II samt regulatoriskt buffertkrav	14,13 %	226 447

**Kapitalrelationer och kapitalbuffertar**

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	16,05 %
Primärkapital	16,74 %
Totalt kapital	17,65 %
Institutsspecifika buffertkrav	2,85 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,35 %
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 2019-06-30. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 180 791 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 – Q2 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	572 477
Checkräkningskrediter	50 000
Likviditetsreserv	622 477

### Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Skulder och avsättningar	1 665 069
Eget kapital	2 346 606
Balansomslutning	4 011 675

### Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet <sup>1)</sup>	1,06
Likviditetsrisk (utnyttjande av checkräkningskrediter i tkr) <sup>2)</sup>	0

- 1) Kvoten av summa utlåning till kreditinstitut och övriga tillgångar genom övriga skulder
- 2) Checkräkningskrediterna får inte utnyttjas mer än maximalt 90% eller i genomsnitt inte mer än 75% under de senaste tre kalender månaderna. Per 2019-06-30 understiger likviditetsrisken dessa risk limiter.

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.