

Kvartalsvis offentliggörande av information
om kapitaltäckning och likviditet
MFEX (Konsoliderad situation)
Q1 2019



Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q1 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	245 434
Övrigt primärkapital	11 625
Supplementärkapital	15 500
Total kapitalbas	272 559

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	1 370 070
- Varav: exponeringar mot nationella regeringar eller centralbanker	-
- Varav: exponeringar mot institut	120 816
- Varav: exponeringar mot företag	1 148 551
- Varav: aktieexponeringar	31 854
- Varav: övriga poster	68 849
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk enligt schablonmetoden	255 594
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditvärderingsjustering enligt schablonmetoden	4
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 625 668

Kapitalkrav

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) och SEK (tkr)		
Totalt Pelare I krav	8,00 %	130 053
Internt bedömt kapitalkrav enligt Pelare II	3,32 %	53 980
Kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	40 642
Kontracykliskbuffert	0,29 %	4 773
Totalt Pelare I och II samt regulatoriskt buffertkrav	14,11 %	229 448

Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	15,10 %
Primärkapital	15,81 %
Totalt kapital	16,77 %
Institutsspecifika buffertkrav	2,79 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,29 %
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	7,10 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2018 avseende 2018-09-30. IKLU:n har uppdaterats per 2019-03-31. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 184 033 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 – Q1 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	553 356
Checkräkningskrediter	50 000
Likviditetsreserv	603 356

Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Skulder och avsättningar	1 669 599
Eget kapital	2 324 822
Balansomslutning	3 994 421

Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet ¹⁾	1,15
Likviditetsrisk (utnyttjande av checkräkningskrediter i tkr) ²⁾	14 619

- 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 2019-03-31 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 och Singapore.