

Offentliggörande av information  
om kapitaltäckning och likviditetsrisker  
MFEX (Konsoliderad situation)  
Q1 2017



## Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q1 2017

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 moderinstitut 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 på grundval av dess konsoliderade situation. Dessa beräknas enligt Förordning (EU) nr 575/2013.

### Kapitalbas

SEK (tkr)	
Kärnprimärkapital	179 436
Övrigt primärkapital	-
Supplementärkapital	-
Total kapitalbas	179 436

### Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	379 644
- Varav: exponering mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot företag	318 209
- Varav: exponering mot institut och företag med ett kortfristigt kreditbetyg	37 889
- Varav: aktieexponeringar	3 689
- Varav: övriga poster	19 857
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk	28 658
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	408 302

### Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	43,95 %
Primärkapital	43,95 %
Totalt kapital	43,95 %
Institutspecifika buffertkrav	3,36 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,86 %
- Varav: krav på systemriskbuffert	-
- Varav: buffert för globalt systemviktigt institut eller för annat systemviktigt institut	-
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	39,45 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2016 avseende 2016-09-30. IKLU har uppdaterats per 2017-03-31. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 53 392 tkr för MFEX konsoliderade situation. Kapitalbasen uppfyller

därmed både syftet att täcka det totala interna kapitalkravet med stor marginal samt att utgöra ett förtroendekapital gentemot kunder, aktieägare och andra intressenter.

## Offentliggörande av information om likviditetsrisker i enlighet med FFFS 2010:7 – Q1 2017

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	155 664
Checkräkningskredit SEK	15 000
Checkräkningskredit EUR (1 650 keur)	15 752
Likviditetsreserv	186 416

### Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Övriga skulder, upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	340 735
Eget kapital	226 306
Balansomslutning	567 041

### Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet <sup>1)</sup>	1,54
Likviditetsrisk <sup>2)</sup>	311 %

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

2) relationen mellan likviditetsreserven och minimum kravet på 60 mkr

MFEX, oberoende experter på global fonddistribution, erbjuder en komplett lösning för fondhandel, volymprovisioner och fondinformation. 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 750+ fondbolag och 50 000 fonder som MFEX samarbetar med. MFEX sköter även hantering av volymprovisioner med full transparens för både distributör och fondbolag. KBC Bank, Société Générale, Keytrade Bank, Handelsbanken, Nordea, Carnegie, Pictet, Danske Bank, Citibank, Groupe Edmond de Rothschild och Bank of Singapore är några av MFEX kunder. MFEX har sitt huvudkontor i Stockholm samt kontor i Umeå, Paris, Genève och Singapore.