

Offentliggörande av information
om kapitaltäckning och likviditetsrisker
MFEX (Konsoliderad situation)
Q2 2017



Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q2 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 institutspecifika buffertkraven på grundval av dess konsoliderade situation. Dessa beräknas enligt Förordning (EU) nr 575/2013.

Kapitalbas

| SEK (tkr) | |
|----------------------|---------|
| Kärnprimärkapital | 179 681 |
| Övrigt primärkapital | - |
| Supplementärkapital | - |
| Total kapitalbas | 179 681 |

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

| SEK (tkr) | |
|---|---------|
| Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden | 421 289 |
| - Varav: exponering mot nationella regeringar eller centralbanker | 0 |
| - Varav: exponeringar mot företag | 349 293 |
| - Varav: exponering mot institut och företag med ett kortfristigt kreditbetyg | 42 033 |
| - Varav: aktieexponeringar | 3 689 |
| - Varav: övriga poster | 26 274 |
| Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk | 57 258 |
| Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader | - |
| Totalt riskvägt exponeringsbelopp | 478 547 |

Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

| (procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp) | |
|--|---------|
| Kärnprimärkapital | 37,55 % |
| Primärkapital | 37,55 % |
| Totalt kapital | 37,55 % |
| Institutspecifika buffertkrav | 3,48 % |
| - Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert | 2,50 % |
| - Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert | 0,98 % |
| - Varav: krav på systemriskbuffert | - |
| - Varav: buffert för globalt systemviktigt institut eller för annat systemviktigt institut | - |
| Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert | 33,05 % |

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2016 avseende 2016-09-30. IKLU har uppdaterats per 2017-06-30. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 59 557 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 – Q2 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 | 200 692 |
| Checkräkningskredit SEK | 15 000 |
| Checkräkningskredit EUR (1 650 keur) | 15 961 |
| Likviditetsreserv | 231 653 |

Finansieringskällor

| | |
|--|---------|
| SEK (tkr) | |
| Övriga skulder, upplupna kostnader och förutbetalda intäkter | 395 351 |
| Eget kapital | 229 965 |
| Balansomslutning | 625 316 |

Riskmått och nyckeltal

| | |
|--------------------------------|-------|
| Balanslikviditet ¹⁾ | 1,46 |
| Likviditetsrisk ²⁾ | 386 % |

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. MFEX har sitt huvudkontor i Stockholm samt kontor i Umeå, Paris, Genève och Singapore.