

Offentliggörande av information
om kapitaltäckning och likviditetsrisker
MFEX (Konsoliderad situation)
Q3 2017



Offentliggörande av information om kapitaltäckning i enlighet med FFFS 2014:12 – Q3 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	180 017
Övrigt primärkapital	-
Supplementärkapital	-
Total kapitalbas	180 017

Totalt riskvägt exponeringsbelopp

SEK (tkr)	
Riskvägt exponeringsbelopp för kreditrisk enligt schablonmetoden	509 007
- Varav: exponering mot nationella regeringar eller centralbanker	0
- Varav: exponeringar mot företag	426 274
- Varav: exponering mot institut och företag med ett kortfristigt kreditbetyg	40 873
- Varav: aktieexponeringar	14 535
- Varav: övriga poster	27 325
Riskvägt exponeringsbelopp för marknadsrisk	42 285
Ytterligare riskexponeringsbelopp på grund av fasta kostnader	-
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	551 292

Kapitalrelationer och kapitalbuffertar

(procentandel av totalt riskvägt exponeringsbelopp)	
Kärnprimärkapital	32,65 %
Primärkapital	32,65 %
Totalt kapital	32,65 %
Institutspecifika buffertkrav	3,40 %
- Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %
- Varav: krav på kontracyklisk kapitalbuffert	0,90 %
- Varav: krav på systemriskbuffert	-
- Varav: buffert för globalt systemviktigt institut eller för annat systemviktigt institut	-
Kärnprimärkapital tillgängligt att användas som buffert	28,15 %

Den senaste Interna Kapital- och Likviditetsutvärderingen (IKLU) för MFEX upprättades under fjärde kvartalet 2016 avseende 2016-09-30. IKLU har uppdaterats per 2017-09-30. Uppdaterade totala internt bedömda kapitalkravet uppgick till 66 595 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 – Q3 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	191 226
Checkräkningskredit SEK	15 000
Checkräkningskredit EUR	15 000
Likviditetsreserv	221 226

Finansieringskällor

SEK (tkr)	
Övriga skulder, upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	470 439
Eget kapital	237 625
Balansomslutning	708 064

Riskmått och nyckeltal

Balanslikviditet ¹⁾	1,37
Likviditetsrisk ²⁾	369 %

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.