

Pareto Securities AB

Offentliggörande av information om kapitaltäckning

I enlighet med Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2014:12) och allmänna råd, Europaparlamentets och rådets förordning nr 575/2013 (CRR) samt Kommissionens genomförande förordning (EU) nr 1423/2013 offentliggör Pareto Securities AB (556206-8956) periodisk information om kapitaltäckning.

Kapitalbas **2015-03-31**

Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	84 123
Reservfond	7 550
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	129 267
Ytterligare värdejusteringar	-4 218
Immateriella tillgångar	-805
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-5 023
Kärnprimärkapital och primärkapital	124 244
Supplementärkapital	24 750
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	148 994

Kapitalrelationer och buffertkrav

Totalt riskvägt exponeringsbelopp **794 115**

Kapitalrelationer (%)

Kärnprimärkapitalrelation	15,6
Primärkapitalrelation	15,6
Total kapitalrelation	18,8
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,0
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,5
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8

Riskvägt exponeringsbelopp

Kreditrisk	151 837
Marknadsrisk	83 571
Valutarisk	10 226
CVA risk	2 194
Defaultfond	80
Operativ risk	546 207
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	794 115

Kapitalbaskrav

Kreditrisk	12 147
Marknadsrisk	6 686
Valutarisk	818
CVA risk	175
Defaultfond	6
Operativ risk	43 697
Totalt minimikapitalbaskrav	63 529

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker

Institutsexponering	79 935
Företagsexponeringar	25 169
Hushållsexponeringar	14 660
Other items	32 073
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	151 837

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	16 000
Marknadsrisk	25 500
Operativ risk	44 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	85 500

Kvantitativ information om likviditetsrisk och likviditetspositioner Pareto Securities AB

Balansräkningen består på tillgångssidan till största del av likvida värdepapper och utlåning mot säkerhet i noterade värdepapper. En god likviditetsberedskap säkerställs genom hållande av en likviditetsreserv samt genom att Pareto Securities AB gentemot kunderna har en avtalsmässig möjlighet att rebelåna säkerheter för utlåningen.

Likviditetsreserv	MSEK
Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk	50
Utlåning	123
Inlåning	636
Kvot inlåning/utlåning	5,17
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,08
