

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 **2015-06-30**

Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	84 123
Reservfond	7 550
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	129 267
Ytterligare värdejusteringar	-4 640
Immateriella tillgångar	0
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-4 640

Kärnprimärkapital och primärkapital **124 627**

Supplementärkapital 23 100

Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital) **147 727**

Kapitalrelationer och buffertkrav

Totalt riskvägt exponeringsbelopp **902 823**

Kapitalrelationer (%)

Kärnprimärkapitalrelation	13,80
Primärkapitalrelation	13,80
Total kapitalrelation	16,36
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	5,80

Riskvägt exponeringsbelopp

Kreditrisk	227 074
Marknadsrisk	74 945
Valutarisk	53 760
CVA risk	801
Defaultfond	36
Operativ risk	546 207
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	902 823

Kapitalbaskrav

Kreditrisk	18 166
Marknadsrisk	5 996
Valutarisk	4 300
CVA risk	64
Defaultfond	3
Operativ risk	43 697
Totalt minimikapitalbaskrav	72 225

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker

Institutsexponering	111 282
Företagsexponeringar	5 986
Hushållsexponeringar	13 092
Other items	96 714
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	227 074

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	18 166
Marknadsrisk	25 500
Operativ risk	52 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	95 666

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	65
Utlåning	136
Inlåning	738
Kvot inlåning/utlåning	5,43
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,09
