

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 **2015-09-30**

Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	84 123
Reservfond	7 550
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	129 267
Ytterligare värdejusteringar	-3 935
Immateriella tillgångar	0
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-3 935
Kärnprimärkapital och primärkapital	125 332
Supplementärkapital	21 427
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	146 759

Kapitalrelationer och buffertkrav

Totalt riskvägt exponeringsbelopp **799 420**

Kapitalrelationer (%)

Kärnprimärkapitalrelation	15,68
Primärkapitalrelation	15,68
Total kapitalrelation	18,36
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	7,68

Riskvägt exponeringsbelopp

Kreditrisk	170 543
Marknadsrisk	75 518
Valutarisk	6 560
CVA risk	521
Defaultfond	71
Operativ risk	546 207
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	799 420

Kapitalbaskrav

Kreditrisk	13 643
Marknadsrisk	6 041
Valutarisk	525
CVA risk	42
Defaultfond	6
Operativ risk	43 697
Totalt minimikapitalbaskrav	63 954

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker

Institutsexponering	99 788
Företagsexponeringar	8 920
Hushållsexponeringar	24 947
Other items	36 888
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	170 543

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	16 000
Marknadsrisk	25 500
Operativ risk	52 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	93 500

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	65
Utlåning	130
Inlåning	642
Kvot inlåning/utlåning	4,94
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,10
