

## 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.

<b>Kapitalbas</b>	<b>2015-12-31</b>
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	84 123
Reservfond	7 550
<b>Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar</b>	<b>129 267</b>
Ytterligare värdejusteringar	-423
Immateriella tillgångar	0
<b>Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital</b>	<b>-423</b>
<b>Kärnprimärkapital och primärkapital</b>	<b>128 844</b>
Supplementärkapital	19 800
<b>Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)</b>	<b>148 644</b>
<b>Kapitalrelationer och buffertkrav</b>	
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>901 180</b>
<b>Kapitalrelationer (%)</b>	
Kärnprimärkapitalrelation	14,30
Primärkapitalrelation	14,30
Total kapitalrelation	16,49
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	6,30
<b>Riskvägt exponeringsbelopp</b>	
Kreditrisk	204 555
Marknadsrisk	118 074
Valutarisk	0
CVA risk	777
Defaultfond	32
Operativ risk	577 742
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>901 180</b>
<b>Kapitalbaskrav</b>	
Kreditrisk	16 364
Marknadsrisk	9 446
Valutarisk	0
CVA risk	62
Defaultfond	3
Operativ risk	46 219
<b>Totalt minimikapitalbaskrav</b>	<b>72 094</b>
<b>Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker</b>	
Stat och centralbank	14 805
Institutsexponering	580 629
Företagsexponeringar	17 680
Hushållsexponeringar	19 837
Other items	47 249
<b>Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker</b>	<b>680 200</b>

**Internt bedömt kapitalbehov**

Kreditrisk	16 367
Marknadsrisk	25 500
Operativ risk	52 000
<b>Totalt internt bedömt kapitalbehov</b>	<b>93 867</b>

\*\*\*\*\*

**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.

<b>Likviditetsreserv</b>	MSEK
Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk	65
<b>Utlåning</b>	145
<b>Inlåning</b>	867
<b>Kvot inlåning/utlåning</b>	5,98
<b>Kvot likviditetsreserv/inlåning</b>	0,07

\*\*\*\*\*