

## 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** **2016-03-31**

---

Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	84 123
Reservfond	7 550
<b>Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar</b>	<b>129 267</b>
Ytterligare värdejusteringar	-432
Immateriella tillgångar	0
<b>Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital</b>	<b>-432</b>
<b>Kärnprimärkapital och primärkapital</b>	<b>128 835</b>
Supplementärkapital	18 082
<b>Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)</b>	<b>146 917</b>

#### **Kapitalrelationer och buffertkrav**

---

**Totalt riskvägt exponeringsbelopp** **886 757**

#### **Kapitalrelationer (%)**

Kärnprimärkapitalrelation	14,53
Primärkapitalrelation	14,53
Total kapitalrelation	16,57
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	6,53

#### **Riskvägt exponeringsbelopp**

Kreditrisk	189 903
Marknadsrisk	105 328
Valutarisk	13 977
CVA risk	405
Defaultfond	69
Operativ risk	577 075
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>886 757</b>

#### **Kapitalbaskrav**

Kreditrisk	15 192
Marknadsrisk	8 426
Valutarisk	1 118
CVA risk	32
Defaultfond	6
Operativ risk	46 166
<b>Totalt minimikapitalbaskrav</b>	<b>70 940</b>

#### **Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker**

Institutsexponering	81 467
Företagsexponeringar	32 102
Hushållsexponeringar	27 153
Other items	49 181
<b>Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker</b>	<b>189 903</b>

**Internt bedömt kapitalbehov**

Kreditrisk	16 000
Marknadsrisk	25 500
Operativ risk	52 000
<b>Totalt internt bedömt kapitalbehov</b>	<b>93 500</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>	184
<b>Inlåning</b>	759
<b>Kvot inlåning/utlåning</b>	4,13
<b>Kvot likviditetsreserv/inlåning</b>	0,09

\*\*\*\*\*