

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 **2016-06-30**

Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	91 623
Reservfond	7 550
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	136 767
Ytterligare värdejusteringar	-511
Immateriella tillgångar	0
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-511
Kärnprimärkapital och primärkapital	136 256
Supplementärkapital	16 455
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	152 711

Kapitalrelationer och buffertkrav

Totalt riskvägt exponeringsbelopp **922 072**

Kapitalrelationer (%)

Kärnprimärkapitalrelation	14,78
Primärkapitalrelation	14,78
Total kapitalrelation	16,56
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	6,78

Riskvägt exponeringsbelopp

Kreditrisk	210 832
Marknadsrisk	124 471
Valutarisk	8 968
CVA risk	657
Defaultfond	69
Operativ risk	577 075
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	922 072

Kapitalbaskrav

Kreditrisk	16 867
Marknadsrisk	9 958
Valutarisk	717
CVA risk	53
Defaultfond	6
Operativ risk	46 166
Totalt minimikapitalbaskrav	73 766

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker

Institutsexponering	80 759
Företagsexponeringar	27 801
Hushållsexponeringar	43 948
Other items	58 324
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	210 832

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	24 000
Marknadsrisk	25 500
Operativ risk	50 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	99 500

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	148
Inlåning	847
Kvot inlåning/utlåning	5,72
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,08
