

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	30.09.2016
	TSEK
Aktiekapital	70,594
Balanserade vinstmedel	91,623
Reservfond	7,550
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	169,767
Ytterligare värdejusteringar	-627
Immateriella tillgångar	-1,660
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2,287
Kärnprimärkapital och primärkapital	167,480
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	167,480
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	885,297
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	18.92
Primärkapitalrelation	18.92
Total kapitalrelation	18.92
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7.00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2.50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	10.92
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	169,610
Marknadsrisk	126,406
Valutarisk	11,954
CVA risk	225
Defaultfond	27
Operativ risk	577,075
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	885,297
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	13,569
Marknadsrisk	10,112
Valutarisk	956
CVA risk	18
Defaultfond	2
Operativ risk	46,166
Totalt minimikapitalbaskrav	70,824
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	87,562
Företagsexponeringar	12,534
Hushållsexponeringar	23,392
Other items	46,122
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	169,610

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	209
Inlåning	1,024
Kvot inlåning/utlåning	4.91
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0.06
