

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	31.12.2016
	TSEK
Aktiekapital	37.594
Balanserade vinstmedel	121.737
Reservfond	7.550
Fond för utvecklingsavgifter	2.886
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	169.767
Ytterligare värdejusteringar	-812
Immateriella tillgångar	-2.886
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-3.698
Kärnprimärkapital och primärkapital	166.069
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	166.069
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	803.058
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	20,68
Primärkapitalrelation	20,68
Total kapitalrelation	20,68
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	12,68
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	131.780
Marknadsrisk	83.846
Valutarisk	10.059
CVA risk	270
Defaultfond	28
Operativ risk	577.075
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	803.058
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	10.542
Marknadsrisk	6.708
Valutarisk	805
CVA risk	22
Defaultfond	2
Operativ risk	46.166
Totalt minimikapitalbaskrav	64.245
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	85.077
Företagsexponeringar	4.243
Hushållsexponeringar	22.358
Other items	20.102
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	131.780

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	130
Inlåning	1.055
Kvot inlåning/utlåning	8,12
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,06
