

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	31.03.2017
	TSEK
Aktiekapital	37.594
Balanserade vinstmedel	122.013
Reservfond	7.550
Fond för utvecklingsavgifter	2.610
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	169.767
Ytterligare värdejusteringar	-736
Immateriella tillgångar	-2.610
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-3.346
Kärnprimärkapital och primärkapital	166.420
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	166.420
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	973.843
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	17,09
Primärkapitalrelation	17,09
Total kapitalrelation	17,09
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	9,09
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	222.062
Marknadsrisk	88.571
Valutarisk	24.870
CVA risk	1.357
Defaultfond	77
Operativ risk	636.907
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	973.843
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	17.765
Marknadsrisk	7.086
Valutarisk	1.990
CVA risk	109
Defaultfond	6
Operativ risk	50.953
Totalt minimikapitalbaskrav	77.907
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	54.165
Företagsexponeringar	25.578
Hushållsexponeringar	62.676
Other items	79.643
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	222.062

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	24.000
Marknadsrisk	25.500
Operativ risk	51.000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	100.500

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	222
Inlåning	785
Kvot inlåning/utlåning	3,54
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,08
