

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	30.06.2017
	TSEK
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	122 289
Reservfond	7 550
Fond för utvecklingsavgifter	2 334
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	169 767
Ytterligare värdejusteringar	-225
Immateriella tillgångar	-2 334
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2 559
Kärnprimärkapital och primärkapital	167 208
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	167 208
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 117 516
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	14,96
Primärkapitalrelation	14,96
Total kapitalrelation	14,96
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	6,96
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	367 838
Marknadsrisk	75 757
Valutarisk	35 211
CVA risk	1 766
Defaultfond	37
Operativ risk	636 907
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 117 516
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	29 427
Marknadsrisk	6 061
Valutarisk	2 817
CVA risk	141
Defaultfond	3
Operativ risk	50 953
Totalt minimikapitalbaskrav	89 401
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	230 636
Företagsexponeringar	13 189
Hushållsexponeringar	62 972
Other items	61 041
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	367 838

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	30 000
Marknadsrisk	25 000
Operativ risk	52 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	107 000

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	240
Inlåning	1 422
Kvot inlåning/utlåning	5,93
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,05
