

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	2017-09-30
	TSEK
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	122 565
Reservfond	7 550
Fond för utvecklingsavgifter	2 058
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	169 767
Ytterligare värdejusteringar	-650
Immateriella tillgångar	-2 058
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2 708
Kärnprimärkapital och primärkapital	167 059
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	167 059
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 086 676
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	15,37
Primärkapitalrelation	15,37
Total kapitalrelation	15,37
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	7,37
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	258 250
Marknadsrisk	150 185
Valutarisk	41 307
CVA risk	0
Defaultfond	27
Operativ risk	636 907
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 086 676
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	20 660
Marknadsrisk	12 015
Valutarisk	3 305
CVA risk	0
Defaultfond	2
Operativ risk	50 953
Totalt minimikapitalbaskrav	86 934
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	75 052
Företagsexponeringar	17 343
Hushållsexponeringar	95 065
Other items	70 790
Summa Riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	258 250

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	24 000
Marknadsrisk	25 000
Operativ risk	52 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	101 000

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	424
Inlåning	1 050
Kvot inlåning/utlåning	2,48
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,06
