

## 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.

<b>Kapitalbas</b>	<b>31.12.2017</b>
	<b>TSEK</b>
Aktiekapital	37,594
Balanserade vinstmedel	122,841
Reservfond	7,550
Fond för utvecklingsavgifter	1,781
<b>Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar</b>	<b>169,766</b>
Ytterligare värdejusteringar	-590
Immateriella tillgångar	-1,781
<b>Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital</b>	<b>-2,371</b>
<b>Kärnprimärkapital och primärkapital</b>	<b>167,395</b>
Supplementärkapital	0
<b>Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)</b>	<b>167,395</b>
<b>Kapitalrelationer och buffertkrav</b>	
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>971,698</b>
<b>Kapitalrelationer (%)</b>	
Kärnprimärkapitalrelation	17.23
Primärkapitalrelation	17.23
Total kapitalrelation	17.23
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7.00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2.50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	9.23
	<b>TSEK</b>
<b>Riskvägt exponeringsbelopp</b>	
Kreditrisk	227,883
Marknadsrisk	79,901
Valutarisk	25,428
CVA risk	0
Defaultfond	30
Settlement risk	1,549
Operativ risk	636,907
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>971,698</b>
<b>Kapitalbaskrav</b>	
Kreditrisk	18,231
Marknadsrisk	6,392
Valutarisk	2,034
CVA risk	0
Defaultfond	2
Settlement risk	124
Operativ risk	50,953
<b>Totalt minimikapitalbaskrav</b>	<b>77,736</b>
<b>Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker</b>	
Institutsexponering	90,231
Företagsexponeringar	12,894
Hushållsexponeringar	56,808
Other items	67,950
<b>Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker</b>	<b>227,883</b>

**Internt bedömt kapitalbehov**

Kreditrisk	24,000
Marknadsrisk	25,000
Operativ risk	52,000
<b>Totalt internt bedömt kapitalbehov</b>	<b>101,000</b>

**Bruttosoliditet**

Totalt exponeringsbelopp	1,540,330
Bruttosoliditet i %	10.87 %

\*\*\*\*\*

**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**

453

**Inlåning**

870

**Kvot inlåning/utlåning**

1.92

**Kvot likviditetsreserv/inlåning**

0.07

\*\*\*\*\*