

## 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.

### IFRS 9

Pareto Securities AB tillämpar inte övergångsbestämmelserna till IFRS 9. Kapitalbas, kapitalrelationer och bruttosoliditetsgrad speglar effekten av IFRS 9 till fullo.

<b>Kapitalbas</b>	<b>31.03.2018</b>
	<b>TSEK</b>
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	153 075
Reservfond	7 550
Fond för utvecklingsavgifter	1 781
<b>Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar</b>	<b>200 000</b>
Ytterligare värdejusteringar	-481
Immateriella tillgångar	-1 505
<b>Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital</b>	<b>-1 986</b>
<b>Kärnprimärkapital och primärkapital</b>	<b>198 014</b>
Supplementärkapital	0
<b>Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)</b>	<b>198 014</b>
<b>Kapitalrelationer och buffertkrav</b>	
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>1 066 562</b>
<b>Kapitalrelationer (%)</b>	
Kärnprimärkapitalrelation	18,57
Primärkapitalrelation	18,57
Total kapitalrelation	18,57
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	9,00
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	2,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	10,57
	<b>TSEK</b>
<b>Riskvägt exponeringsbelopp</b>	
Kreditrisk	222 714
Marknadsrisk	88 777
Valutarisk	38 645
CVA risk	0
Defaultfond	30
Settlement risk	0
Operativ risk	716 396
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>1 066 562</b>
<b>Kapitalbaskrav</b>	
Kreditrisk	17 817
Marknadsrisk	7 102
Valutarisk	3 092
CVA risk	0
Defaultfond	2
Settlement risk	0
Operativ risk	57 312
<b>Totalt minimikapitalbaskrav</b>	<b>85 325</b>

<b>Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker</b>	
Institutsexponering	115 515
Företagsexponeringar	10 741
Hushållsexponeringar	71 249
Other items	25 209
<b>Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker</b>	<b>222 714</b>

<b>Internt bedömt kapitalbehov</b>	
Kreditrisk	24 000
Marknadsrisk	25 000
Operativ risk	60 000
<b>Totalt internt bedömt kapitalbehov</b>	<b>109 000</b>

<b>Bruttosoliditet</b>	
Totalt exponeringsbelopp	1 682 066
Bruttosoliditet i %	11,77 %

\*\*\*\*\*

**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.

<b>Likviditetsreserv</b>	<b>MSEK</b>
Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk	65

<b>Utlåning</b>	603
<b>Inlåning</b>	986

<b>Kvot inlåning/utlåning</b>	1,64
<b>Kvot likviditetsreserv/inlåning</b>	0,07

\*\*\*\*\*