

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.

IRFS 9

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

Kapitalbas	30.06.2018
	TSEK
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	153 627
Reservfond	7 550
Fond för utvecklingsavgifter	1 229
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	200 000
Ytterligare värdejusteringar	-791
Immateriella tillgångar	-1 229
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2 020
Kärnprimärkapital och primärkapital	197 980
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	197 980
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 113 665
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	17,78
Primärkapitalrelation	17,78
Total kapitalrelation	17,78
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	9,00
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	2,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	9,78
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	301 609
Marknadsrisk	53 878
Valutarisk	41 753
CVA risk	0
Defaultfond	30
Settlement risk	0
Operativ risk	716 396
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 113 665
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	24 129
Marknadsrisk	4 310
Valutarisk	3 340
CVA risk	0
Defaultfond	2
Settlement risk	0
Operativ risk	57 312
Totalt minimikapitalbaskrav	89 093

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	177 335
Företagsexponeringar	28 964
Hushållsexponeringar	56 453
Other items	38 857
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	301 609

Internt bedömt kapitalbehov	
Kreditrisk	38 000
Marknadsrisk	22 000
Operativ risk	60 000
Totalt internt bedömt kapitalbehov	120 000

Bruttosoliditet	
Totalt exponeringsbelopp	1 910 825
Bruttosoliditet i %	10,36 %

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	689
Inlåning	1 320

Kvot inlåning/utlåning	1,92
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,05
