

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.

Kapitalbas	30.09.2018
	TSEK
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	153 016
Reservfond	7 550
Fond för utvecklingsavgifter	1 856
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	200 016
Ytterligare värdejusteringar	-374
Immateriella tillgångar	-1 856
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2 230
Kärnprimärkapital och primärkapital	197 785
Supplementärkapital	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	197 785
Kapitalrelationer och buffertkrav	
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 099 341
Kapitalrelationer (%)	
Kärnprimärkapitalrelation	17,99
Primärkapitalrelation	17,99
Total kapitalrelation	17,99
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	9,00
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	2,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	9,99
	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp	
Kreditrisk	303 323
Marknadsrisk	52 135
Valutarisk	23 836
CVA risk	0
Defaultfond	29
Settlement risk	3 622
Operativ risk	716 396
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 099 341
Kapitalbaskrav	
Kreditrisk	24 266
Marknadsrisk	4 171
Valutarisk	1 907
CVA risk	0
Defaultfond	2
Settlement risk	290
Operativ risk	57 312
Totalt minimikapitalbaskrav	87 947

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker	
Institutsexponering	192 241
Företagsexponeringar	17 590
Hushållsexponeringar	67 079
Other items	26 413
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	303 323

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

Bruttosoliditet	
Totalt exponeringsbelopp	2 138 482
Bruttosoliditet i %	9,25 %

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 (uppgår till en nivå som klarar av en period av minst 120 dagar under normala förhållande)	MSEK
---	-------------

Likviditetsreserven består av högkvalitativa tillgångar enligt definitionen i FFFS 2010:7, kap 4, § 5.	65
--	----

Utlåning	580
Inlåning	1 174

Kvot inlåning/utlåning	2,02
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0,06
