

## 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>31.12.2018</b>
	<b>TSEK</b>
Aktiekapital	37 594
Balanserade vinstmedel	153 016
Reservfond	7 550
Fond för utvecklingsavgifter	1 663
<b>Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar</b>	<b>199 823</b>
Ytterligare värdejusteringar	-387
Immateriella tillgångar	-1 663
<b>Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital</b>	<b>-2 050</b>
<b>Kärnprimärkapital och primärkapital</b>	<b>197 773</b>
Supplementärkapital	0
<b>Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)</b>	<b>197 773</b>
<b>Kapitalrelationer och buffertkrav</b>	
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>1 138 372</b>
<b>Kapitalrelationer (%)</b>	
Kärnprimärkapitalrelation	17,37
Primärkapitalrelation	17,37
Total kapitalrelation	17,37
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	9,00
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	2,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	9,37
	<b>TSEK</b>
<b>Riskvägt exponeringsbelopp</b>	
Kreditrisk	319 278
Marknadsrisk	81 227
Valutarisk	21 023
CVA risk	0
Defaultfond	55
Settlement risk	393
Operativ risk	716 396
<b>Totalt riskvägt exponeringsbelopp</b>	<b>1 138 372</b>
<b>Kapitalbaskrav</b>	
Kreditrisk	25 542
Marknadsrisk	6 498
Valutarisk	1 682
CVA risk	0
Defaultfond	4
Settlement risk	31
Operativ risk	57 312
<b>Totalt minimikapitalbaskrav</b>	<b>91 070</b>

<b>Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker</b>	
Institutsexponering	153 622
Företagsexponeringar	16 996
Hushållsexponeringar	81 375
Other items	67 285
<b>Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker</b>	<b>319 278</b>

<b>Internt bedömt kapitalbehov</b>	
Kreditrisk	38 000
Marknadsrisk	22 000
Operativ risk	60 000
<b>Totalt internt bedömt kapitalbehov</b>	<b>120 000</b>

<b>Bruttosoliditet</b>	
Totalt exponeringsbelopp	1 754 662
Bruttosoliditet i %	11,27 %

\*\*\*\*\*

#### **Kvantitativ information om likviditetsrisk och likviditetspositioner Pareto Securities AB**

Balansräkningen består på tillgångssidan till största del av utlåning till kreditinstitut, likvida värdepapper och utlåning till allmänheten mot säkerhet i noterade värdepapper. En god likviditetsberedskap säkerställs av styrelsen fastställd instruktion för hantering och kontroll av likviditetsrisker, beredskapsplanering, funktion för hantering av likviditet ("treasuryfunktionen"), genom hållande av en likviditetsreserv samt genom att Pareto Securities AB gentemot kunderna har en avtalsmässig möjlighet att rebelåna säkerheter för utlåningen. I årsredovisningen ges ytterligare detaljer om strategi och riktlinjer för att hantera likviditetsrisk, rapportering och stresstester som utförs.

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

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

<b>Utlåning</b>	595
<b>Inlåning</b>	988

<b>Likviditetskvoter definerad enligt återhämtningsplan:</b>	<b>Kvot</b>
Likviditet (stressat)	2,10
<i>Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan</i>	<i>0,50</i>

Finansiering (hur inlåning finansierar bolagets likviditetsutnyttjande)	1,33
<i>Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan</i>	<i>0,95</i>

\*\*\*\*\*