

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	Moderbolaget 31.03.2019	Grupp 31.03.2019
	TSEK	TSEK
Aktiekapital	37 594	37 594
Balanserade vinstmedel	153 248	159 738
Övriga fond som ingår i kärnprimärkapital	9 110	26 076
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	199 952	223 409
Ytterligare värdejusteringar	-1 049	-1 071
Immateriella tillgångar	-1 560	-22 545
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2 609	-23 616
Kärnprimärkapital och primärkapital	197 343	199 792
Supplementärkapital	0	0
Totalt kapital (primärkapital+supplementärkapital)	197 343	199 792
Kapitalrelationer och buffertkrav		
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 235 138	1 331 335
Kapitalrelationer (%)		
Kärnprimärkapitalrelation	15,98	15,01
Primärkapitalrelation	15,98	15,01
Total kapitalrelation	15,98	15,01
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	9,00	9,00
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	2,00	2,00
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50	2,50
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	7,98	7,01
	TSEK	TSEK
Riskvägt exponeringsbelopp		
Kreditrisk	326 304	305 354
Marknadsrisk	26 538	56 431
Valutarisk	44 882	51 450
CVA risk	0	0
Defaultfond	56	56
Settlement risk	644	644
Operativ risk	836 714	917 400
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 235 138	1 331 335
Kapitalbaskrav		
Kreditrisk	26 104	24 428
Marknadsrisk	2 123	4 514
Valutarisk	3 591	4 116
CVA risk	0	0
Defaultfond	4	4
Settlement risk	52	52
Operativ risk	66 937	73 392
Totalt minimikapitalbaskrav	98 811	106 507

Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker

Institutsexponering	127 609	136 718
Företagsexponeringar	9 838	10 596
Hushållsexponeringar	94 998	94 998
Other items	93 860	63 042
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	326 305	305 354

Internt bedömt kapitalbehov

Kreditrisk	33 700	35 700
Marknadsrisk	7 300	10 300
Operativ risk	67 000	73 500
Totalt internt bedömt kapitalbehov	108 000	119 500

Bruttosoliditet

Totalt exponeringsbelopp	1 777 187	1 782 124
Bruttosoliditet i %	11,10 %	11,21 %

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

Utlåning	714
Inlåning	1 275

Likviditetskvoter definerad enligt återhämtningsplan:

Likviditet (stressat)	Kvot 1,61
<i>Gräns för stressat affärläge enligt återhämtningsplan</i>	0,50
Finansiering (hur inlåning finansierar bolagets likviditetsutnyttjande)	1,58
<i>Gräns för stressat affärläge enligt återhämtningsplan</i>	0,95
