

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	Moderbolaget 30.06.2019		Grupp 30.06.2019	
	TSEK		TSEK	
Aktiekapital	37 594		37 594	
Balanserade vinstmedel	153 901		160 391	
Övriga fond som ingår i kärnprimärkapital	8 595		25 561	
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	200 090		223 546	
Ytterligare värdejusteringar	-2 256		-2 277	
Immateriella tillgångar	-1 045		-22 670	
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-3 301		-24 947	
Kärnprimärkapital och primärkapital	196 789		198 598	
Supplementärkapital	25 748		27 725	
Total kapitalbas (primärkapital+supplementärkapital)	222 537		226 323	
Kapitalrelationer och buffertkrav				
Kapitalbaskrav (pelare 1)	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	28 400	28 %	26 557	24 %
Marknadsrisk	1 583	2 %	4 133	4 %
Valutarisk	5 935	6 %	6 678	6 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	9	0 %	9	0 %
Settlement risk	1	0 %	1	0 %
Operativ risk	66 937	65 %	73 392	66 %
Totalt minimikapitalbaskrav	102 863		110 769	
Internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)		Andel		Andel
Kreditrisk	42 700	36 %	42 700	33 %
Marknadsrisk	9 500	8 %	13 500	10 %
Operativ risk	67 000	56 %	73 500	57 %
Totalt internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)	119 200		129 700	
Kombinerat buffertkrav				
Totalt kombinerat buffertkrav	57 861		62 308	
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	25 716	2,0 %	27 692	2,0 %
Varav kapitalkonserveringsbuffert	32 145	2,5 %	34 615	2,5 %
Totalt kapitalbaskrav (pelare 1+2 + kombinerat buffertkrav)	177 061		192 008	
Totalt kapitalbaskrav i % av totalt kapital		80 %		85 %
Kapitalrelationer (%)				
Kärnprimärkapitalrelation	15,30		14,34	
Primärkapitalrelation	15,30		14,34	
Total kapitalrelation	17,31		16,35	
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	7,30		6,34	

Riskvägt exponeringsbelopp ("RWA")	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	354 997	28 %	331 959	24 %
Marknadsrisk	19 782	2 %	51 666	4 %
Valutarisk	74 186	6 %	83 478	6 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	107	0 %	107	0 %
Settlement risk	7	0 %	7	0 %
Operativ risk	836 714	65 %	917 400	66 %
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 285 793		1 384 617	
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker				
Institutsexponering	114 860	32 %	120 594	36 %
Företagsexponeringar	32 690	9 %	33 932	10 %
Hushållsexponeringar	101 814	29 %	101 814	31 %
Other items	105 633	30 %	75 619	23 %
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	354 997		331 959	
Bruttosoliditet				
Totalt exponeringsbelopp	1 789 295		1 767 464	
Bruttosoliditet i %	11,00 %		11,24 %	

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

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	750
Inlåning	1 333

Likviditetskvoter definierad enligt återhämningsplan:	Kvot
Likviditet (stressat)	2,70
<i>Gräns för stressat affärsläge enligt återhämningsplan</i>	0,50

Finansiering (hur inlåning finansierar internt likviditetsutnyttjande)	1,60
<i>Gräns för stressat affärsläge enligt återhämningsplan</i>	0,95
