

Pareto Securities AB

Offentliggörande av information om kapitaltäckning för 30.06.2020

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		Gruppen	
	TSEK		TSEK	
Aktiekapital	37 594		37 594	
Balanserade vinstmedel	150 939		143 734	
Övriga fond som ingår i kärnprimärkapital	9 228		14 434	
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	197 761		195 762	
Ytterligare värdejusteringar	-309		-330	
Immateriella tillgångar	-2 151		-8 666	
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-2 461		-8 996	
Kärnprimärkapital och primärkapital	195 300		186 765	
Supplementärkapital	31 102		33 801	
Total kapitalbas (primärkapital+supplementärkapital)	226 402		220 565	
Kapitalrelationer och buffertkrav				
Kapitalbaskrav (pelare 1)	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	34 957	32 %	33 296	28 %
Marknadsrisk	1 045	1 %	3 286	3 %
Valutarisk	4 706	4 %	5 038	4 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	5	0 %	5	0 %
Settlement risk	28	0 %	28	0 %
Operativ risk	69 287	63 %	76 072	65 %
Totalt minimikapitalbaskrav	110 028		117 726	
Internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)		Andel		Andel
Kreditrisk	44 000	34 %	44 000	31 %
Marknads- och valutarisk	16 000	12 %	21 000	15 %
Operativ risk	70 000	54 %	77 000	54 %
Totalt internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)	130 000		142 000	
Kombinerat buffertkrav				
Totalt kombinerat buffertkrav	36 447		38 997	
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	2 063	0,15 %	2 207	0,15 %
Varav kapitalkonserveringsbuffert	34 384	2,50 %	36 789	2,50 %
Totalt kapitalbaskrav (pelare 1+2 + kombinerat buffertkrav)	166 447		180 997	
Totalt kapitalbaskrav i % av totalt kapital		74 %		82 %
Kapitalrelationer (%)				
Kärnprimärkapitalrelation	14,20		12,69	
Primärkapitalrelation	14,20		12,69	
Total kapitalrelation	16,46		14,99	
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,15		7,15	
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	0,15		0,15	
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50		2,50	
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8,20		6,69	

Riskvägt exponeringsbelopp ("RWA")	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	436 958	32 %	416 203	28 %
Marknadsrisk	13 065	1 %	41 078	3 %
Valutarisk	58 821	4 %	62 970	4 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	68	0 %	68	0 %
Settlement risk	354	0 %	354	0 %
Operativ risk	866 082	63 %	950 900	65 %
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 375 348		1 471 573	
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker				
Institutsexponering	185 812	43 %	194 788	47 %
Företagsexponeringar	46 292	11 %	47 320	11 %
Hushållsexponeringar	110 946	25 %	110 946	27 %
Other items	93 908	21 %	63 149	15 %
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	436 958		416 203	
Bruttosoliditet				
Totalt exponeringsbelopp	2 080 669		2 100 523	
Bruttosoliditet i %	9,39 %		8,89 %	

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, 4 kap. 5 §.	65

Utlåning	830
Inlåning	1 589

Likviditetskvoter definierad enligt återhämtningsplan:	Kvot
Likviditet (stressat)	5,18
Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan	0,50

Finansiering (hur inlåning finansierar internt likviditetsutnyttjande)	1,66
Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan	0,86
