

Pareto Securities AB

Offentliggörande av information om kapitaltäckning för 30.09.2020

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	150 530		146 270	
Övriga fond som ingår i kärnprimärkapital	9 446		11 708	
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	197 570		195 572	
Ytterligare värdejusteringar	-1 941		-1 962	
Immateriella tillgångar	-1 896		-9 000	
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-3 837		-10 962	
Kärnprimärkapital och primärkapital	193 733		184 610	
Supplementärkapital	33 010		35 759	
Total kapitalbas (primärkapital+supplementärkapital)	226 742		220 369	
Kapitalrelationer och buffertkrav				
Kapitalbaskrav (pelare 1)	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	45 305	37 %	43 829	34 %
Marknadsrisk	793	1 %	3 312	3 %
Valutarisk	6 461	5 %	7 052	5 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	5	0 %	5	0 %
Settlement risk	0	0 %	0	0 %
Operativ risk	69 287	57 %	76 072	58 %
Totalt minimikapitalbaskrav	121 851		130 270	
Internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)		Andel		Andel
Kreditrisk	50 000	37 %	50 000	34 %
Marknads- och valutarisk	16 000	12 %	21 000	14 %
Operativ risk	70 000	51 %	77 000	52 %
Totalt internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)	136 000		148 000	
Kombinerat buffertkrav				
Totalt kombinerat buffertkrav	41 886		44 780	
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	3 808	0,25 %	4 071	0,25 %
Varav kapitalkonserveringsbuffert	38 078	2,50 %	40 709	2,50 %
Totalt kapitalbaskrav (pelare 1+2 + kombinerat buffertkrav)	177 886		192 780	
Totalt kapitalbaskrav i % av totalt kapital		78 %		87 %
Kapitalrelationer (%)				
Kärnprimärkapitalrelation	12,72		11,34	
Primärkapitalrelation	12,72		11,34	
Total kapitalrelation	14,89		13,53	
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	6,72		5,34	

Riskvägt exponeringsbelopp ("RWA")	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	566 317	37 %	547 864	34 %
Marknadsrisk	9 911	1 %	41 399	3 %
Valutarisk	80 766	5 %	88 154	5 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	59	0 %	59	0 %
Settlement risk	0	0 %	0	0 %
Operativ risk	866 082	57 %	950 900	58 %
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 523 135		1 628 376	
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker				
Institutsexponering	248 364	44 %	256 498	47 %
Företagsexponeringar	111 127	20 %	77 612	14 %
Hushållsexponeringar	106 599	19 %	106 599	19 %
Other items	100 226	18 %	107 155	20 %
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	566 317		547 864	
Bruttosoliditet				
Totalt exponeringsbelopp	2 756 626		2 779 997	
Bruttosoliditet i %	7,03 %		6,64 %	

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	1 004
Inlåning	1 960

Likviditetskvoter definierad enligt återhämtningsplan:	Kvot
Likviditet (stressat)	6,91
<i>Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan</i>	0,50

Finansiering (hur inlåning finansierar internt likviditetsutnyttjande)	1,62
<i>Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan</i>	0,86
