

Pareto Securities AB

Offentliggörande av information om kapitaltäckning för 30.06.2021

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	42 500		42 500	
Balanserade vinstmedel	153 331		146 081	
Övriga fond som ingår i kärnprimärkapital	30 930		40 311	
Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	226 761		228 893	
Ytterligare värdejusteringar	-1 029		-1 047	
Immateriella tillgångar	-2 498		-14 015	
Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital	-3 527		-15 061	
Kärnprimärkapital och primärkapital	223 234		213 831	
Supplementärkapital	38 750		40 000	
Total kapitalbas (primärkapital+supplementärkapital)	261 984		253 831	
Kapitalrelationer och buffertkrav				
Kapitalbaskrav (pelare 1)	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	29 741	25 %	27 895	22 %
Marknadsrisk	5 919	5 %	8 070	6 %
Valutarisk	7 445	6 %	8 105	6 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	2	0 %	2	0 %
Settlement risk	0	0 %	0	0 %
Operativ risk	76 282	64 %	84 198	66 %
Totalt minimikapitalbaskrav	119 389		128 271	
Internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)		Andel		Andel
Kreditrisk	61 000	39 %	55 000	34 %
Marknads-och valutarisk	17 000	11 %	21 000	13 %
Operativ risk	77 000	50 %	85 000	53 %
Totalt internt bedömt kapitalbehov (pelare 2)	155 000		161 000	
Kombinerat buffertkrav				
Totalt kombinerat buffertkrav	41 786		44 895	
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	4 477	0,30 %	4 810	0,30 %
Varav kapitalkonserveringsbuffert	37 309	2,50 %	40 085	2,50 %
Totalt kapitalbaskrav (pelare 1+2 + kombinerat buffertkrav)	196 786		205 895	
Totalt kapitalbaskrav i % av totalt kapital		75 %		81 %

Kapitalrelationer (%)				
Kärnprimärkapitalrelation	14,96		13,34	
Primärkapitalrelation	14,96		13,34	
Total kapitalrelation	17,56		15,83	
Totalt kärnprimärkapitalkrav inklusive buffertkrav	7,30		7,30	
Varav kontracyklisk kapitalbuffert	0,30		0,30	
Varav kapitalkonserveringsbuffert	2,50		2,50	
Kärnprimärkapital tillgängligt att använda som buffert	8,96		7,34	
Riskvägt exponeringsbelopp ("RWA")	TSEK	% av RWA	TSEK	% av RWA
Kreditrisk	371 759	25 %	348 691	22 %
Marknadsrisk	73 984	5 %	100 880	6 %
Valutarisk	93 059	6 %	101 311	6 %
CVA risk	0	0 %	0	0 %
Defaultfond	29	0 %	29	0 %
Settlement risk	2	0 %	2	0 %
Operativ risk	953 524	64 %	1 052 477	66 %
Totalt riskvägt exponeringsbelopp	1 492 358		1 603 389	
Riskvägt exponeringsbelopp per exponeringsklass kreditrisker				
Institutsexponering	92 705	25 %	100 051	29 %
Företagsexponeringar	48 839	13 %	50 677	15 %
Hushållsexponeringar	29 472	8 %	29 472	8 %
Other items	200 742	54 %	168 491	48 %
Summa riskvägt exponeringsbelopp kreditrisker	371 757		348 691	
Bruttosoliditet				
Totalt exponeringsbelopp	3 398 934		3 422 714	
Bruttosoliditet i %	6,57 %		6,25 %	

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, 4 kap. 5 §.	65

Utlåning	1 410
Inlåning	2 240

Likviditetskvoter definierad enligt återhämtningsplan:	Kvot
Likviditet (stressat)	5,36
Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan	0,50

Finansiering (hur inlåning finansierar internt likviditetsutnyttjande)	1,38
Gräns för stressat affärsläge enligt återhämtningsplan	0,86
