

Nedan presenteras konsoliderat periodisk information per 2019-12-31 om Pareto Securities AB grupp (556206-8956). Informationen är beräknad och uppställt i enlighet med Europaparlamentets och rådets förordning (EU) nr 575/2013 om tillsynskrav för kreditinstitut och värdepappersföretag och lämnas i enlighet med FFFS 2014:12.

Mall för upplysningar om kapitalbas under övergångsperioden enligt Kommissionens genomförandeförordning (EU) Nr 1423/2013			
	Kärnprimärkapital: instrument och reserver	(A) 31 December 2019 (SEK tusen)	(B) Förordning (EU) nr 575/2013 Artikelhänvisning
1	Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	37 594	26 (1), 27, 28, 29, EBA-förteckningen 26 (3)
	Varav: Kapitalinstrument		EBA-förteckningen 26 (3)
	Varav: Share premium		EBA-förteckningen 26 (3)
	of which:		EBA-förteckningen 26 (3)
2	Ej utdelade vinstmedel	155 205	26 (1) (c)
3	Akkumulerat annat totalresultat (och andra reserver, för att inkludera orealiserade vinster och förluster enligt tillämpliga redovisningsstandarder)	29 767	26 (1)
3a	Reserveringar för allmänna risker i bankrörelse		26 (1) (f)
4	Belopp för kvalificerade poster som avses i artikel 483.3 och tillhörande överkursfonder som omfattas av utfasning från kärnprimärkapitalet		486 (2)
	Kapitaltillskott från den offentliga sektorn för vilka äldre regler får tillämpas till den 1 januari 2018		483 (2)
5	Minoritetsintressen (tillåtet belopp i konsoliderat kärnprimärkapital)		84, 479, 480
5a	Delårsresultat netto efter avdrag för förutsebara kostnader och utdelningar som har verifierats av personer som har en oberoende ställning		26 (2)
6	Kärnprimärkapital före lagstiftningsjusteringar	222 566	
Kärnprimärkapital: lagstiftningsjusteringar			
7	Ytterligare värdejusteringar (negativt belopp)	-94	34, 105
8	Immateriella tillgångar (netto efter minskning för tillhörande skatteskulder) (negativt belopp)	-23 884	36 (1) (b), 37, 472 (4)
9	Tomt fält i EU		
10	Uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet, utom sådana som uppstår till följd av temporära skillnader (netto efter minskning för tillhörande skatteskuld när villkoren i artikel 38.3 är uppfyllda) (negativt belopp)		36 (1) (c), 38, 472 (5)
11	Reserver i verkligt värde relaterade till vinster eller förluster på kassaflödessäkringar		33 (a)
12	Negativa belopp till följd av beräkning av förväntade förlustbelopp		36 (1) (d), 40, 159, 472 (6)
13	Eventuell ökning i eget kapital till följd av värdepapperiserade tillgångar (negativt belopp)		32 (1)
14	Vinster eller förluster på skulder som värderas till verkligt värde och som beror på ändringar av institutets egen kreditstatus		33 (1) (b) (c)
15	Förmånsbestämda pensionsplaner (negativt belopp)		36 (1) (e), 41, 472 (7)
16	Ett instituts direkta och indirekta innehav av egna kärnprimärkapitalinstrument (negativt belopp)		36 (1) (f), 42, 472 (8)
17	Innehav av kärnprimärkapitalinstrument i enheter i den finansiella sektorn med vilka institut har ett korsvist ägande som är avsett att på konstlad väg öka institutets kapitalbas (negativt belopp)		36 (1) (g), 44, 472 (9)
18	Institutets direkta och indirekta innehav av kärnprimärkapitalinstrument i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet inte har någon väsentlig investering (belopp över tröskelvärdet på 10 %, netto efter godtagbara korta positioner) (negativa belopp)		36 (1) (h), 43, 45, 46, 49 (2) (3), 79, 472 (10)
19	Institutets direkta, indirekta och syntetiska innehav av kärnprimärkapitalinstrument i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet en väsentlig investering (belopp över tröskelvärdet på 10 %, netto efter godtagbara korta positioner) (negativa belopp)		36 (1) (i), 43, 45, 47, 48 (1) (b), 49 (1) to (3), 79, 470, 472 (11)
20	Tomt fält i EU		
20a	Exponeringsbelopp för följande poster som är kvalificerade för en riskvikt på 1 250 % när institutet väljer alternativet med avdrag		36 (1) (k)
20b	Varav: kvalificerade innehav utanför den finansiella sektorn (negativt belopp)		36 (1) (k) (i), 89 to 91
			36 (1) (k) (ii)
			243 (1) (b)
20c	Varav: värdepapperiseringspositioner (negativt belopp)		244 (1) (b)
			258
20d	Varav: transaktioner utan samtidig motprestation (negativt belopp)		36 (1) (k) (iii), 379 (3)
21	Uppskjutna skattefordringar som uppstår till följd av temporära skillnader (belopp över tröskelvärdet på 10 %, netto efter minskning för tillhörandes skatteskuld när villkoren i artikel 38.3 är uppfyllda) (negativt belopp)		36 (1) (c), 38, 48 (1) (a), 470, 472 (5)
22	Belopp som överskrider tröskelvärdet på 15 % (negativt belopp)		48 (1)

23	varav: Institutets direkta och indirekta innehav av kärnprimärkapitalinstrument i enheter i den finansiella sektorn när institutet har en väsentlig investering i de enheterna		36 (1) (i), 48 (1) (b), 470, 472 (11)
24	Tomt fält i EU		
25	Varav: uppskjutna skattefordringar som uppstår till följd av temporära skillnader		36 (1) (c), 38, 48 (1) (a), 470, 472 (5)
25a	Förluster för innevarande räkenskapsår (negativt belopp)		36 (1) (a), 472 (3)
25b	Förutsebara skatter som är relaterade till kärnprimärkapitalposter (negativt belopp)		36 (1) (l)
26	Lagstiftningsjusteringar som tillämpas på kärnprimärkapital med avseende på belopp som omfattas av behandling som föreskrivs i lagstiftning före kapitaltäckningsförordningen		
26a	Lagstiftningsjusteringar som avser orealiserade vinster och förluster i enlighet med artiklarna 467 och 468		
26b	Belopp som ska dras av från eller läggas till kärnprimärkapital med avseende på ytterligare filter och avdrag som krävs enligt bestämmelserna före kapitaltäckningsförordningen		481
27	Avdrag från kvalificerade primärkapitaltillskott som överskrider institutets primärkapitaltillskott (negativt belopp)		36 (1) (j)
28	Sammanlagda lagstiftningsjusteringar av kärnprimärkapital		-23 978
29	Kärnprimärkapital		198 588
Primärkapitaltillskott: Instrument			
30	Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder		51, 52
31	Varav: klassificerade som eget kapital enligt tillämpliga redovisningsstandarder		
32	Varav: klassificerade som skulder enligt tillämpliga redovisningsstandarder		
33	Belopp för kvalificerade poster som avses i artikel 484.4 och tillhörande överkursfonder som omfattas av utfasning från primärkapitaltillskottet		486 (3)
	Kapitaltillskott från den offentliga sektorn för vilka äldre regler får tillämpas till den 1 januari 2018		483 (3)
34	Kvalificerade primärkapital som ingår i konsoliderat primärkapitaltillskott (inbegripet minoritetsintressen som inte tas med i rad 5) som utfärdats av dotterföretag och innehas av tredje part		85, 86, 480
35	Varav: instrument som utfärdats av dotterföretag och som omfattas av utfasning		486 (3)
36	Primärkapitaltillskott före lagstiftningsjusteringar		
Primärkapitaltillskott: lagstiftningsjusteringar			
37	Ett institutets direkta och indirekta innehav av egna kärnprimärkapitalinstrument (negativt belopp)		52 (1) (b), 56 (a), 57, 475 (2)
38	Innehav av primärkapitaltillskottsinstrument i enheter i den finansiella sektorn med vilka institutet har ett korsvis ägande som är avsett att på konstlad väg öka institutets kapitalbas (negativt belopp)		56 (b), 58, 475 (3)
39	Direkta och indirekta innehav av primärkapitaltillskottsinstrument i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet inte har någon väsentlig investering (belopp över tröskelvärdet 10 %, netto efter godtagbara korta positioner) (negativt belopp)		56 (c), 59, 60, 79, 475 (4)
40	Institutets direkta och indirekta innehav av kärnprimärkapitalinstrument i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet har en väsentlig investering belopp över tröskelvärdet på 10 %, netto efter godtagbara korta positioner) (negativa belopp)		56 (d), 59, 79, 475 (4)
41	Lagstiftningsjusteringar som tillämpas på primärkapitaltillskott med avseende på belopp som omfattas av behandling som föreskrivs i lagstiftningen före kapitaltäckningsförordningen och övergångsbehandling som omfattas av utfasning i enlighet med förordning (EU) nr 575/2013 (dvs. restvärde enligt kapitaltäckningsförordningen)		
41a	Restvärden som dras från primärkapitaltillskott med avseende på avdrag från kärnprimärkapital under övergångsperioden i enlighet med artikel 472 i förordning (EU) nr 575/2013		472, 473(3)(a), 472 (4), 472 (6), 472 (8) (a), 472 (9), 472 (10) (a), 472 (11) (a)
	Varav poster ska redovisas rad för rad, t.ex. väsentliga delårsförluster netto, immateriella tillgångar, underskott i avsättningar i förhållande till förväntade förluster osv.		
41b	Restvärden som dras från primärkapitaltillskott med avseende på avdrag från supplementärkapital under övergångsperioden i enlighet med artikel 475 i förordning (EU) nr 575/2013		477, 477 (3), 477 (4) (a)
	Varav poster ska redovisas rad för rad, t.ex. korsvis ägande av icke-väsentliga investeringar i kapitalet hos andrasupplementärkapitalinstrument, direkta innehav enheter i den finansiella sektorn osv.		
41c	Belopp som ska dras av ifrån eller läggas till primärkapitaltillskott med avseende på ytterligare filter och avdrag som krävs enligt bestämmelserna före kapitaltäckningsförordningen		467, 468, 481
	Varav: ... eventuellt filter för realiserade förluster		
	Varav: ... eventuellt filter för realiserade vinster		
	Varav: ...		
42	Avdrag från kvalificerade supplementärkapitalinstrument som överskrider institutets supplementärkapital (negativt belopp)		56 (e)
43	Summa lagstiftningsjusteringar av primärkapitaltillskott		
44	Primärkapitaltillskott		

45	Primärkapital (primärkapital = kärnprimärkapital + primärkapitaltillskott)	198 588	
Supplementärkapital: instrument och avsättningar			
46	Kapitalinstrument och tillhörande överkursfonder	31 348	62, 63
47	Belopp för kvalificerade poster som avses i artikel 484.5 och tillhörande överkursfonder som omfattas av utfasning från supplementärkapitalet		486 (4)
	Kapitaltillskott från den offentliga sektorn för vilka äldre regler får tillämpas till den 1 januari 2018		483 (4)
48	Kvalificerande supplementärkapital som ingår i konsoliderat supplementärkapital (inbegripet minoritetsintressen och primärkapitaltillskottsinstrument som inte tas med i rad 5 eller 34) som utfärdats av dotterföretag och innehas av tredje part		87, 88, 480
49	Varav: instrument som utfärdats av dotterföretag och som omfattas av utfasning		486 (4)
50	Kreditriskjusteringar		62 (c) & (d)
51	Supplementärkapital före lagstiftningsjusteringar	31 348	
Supplementärkapital: lagstiftningsjusteringar			
52	Ett instituts direkta och indirekta innehav av egna supplementärkapitaltillskottsinstrument och efterställda lån (negativt belopp)		63 (b) (i), 66 (a), 67, 477 (2)
53	Innehav av supplementärkapital-tillskottsinstrument och efterställda lån i enheter i den finansiella sektorn med vilka institutet har ett korsvist ägande som är avsett att på konstlad väg öka institutets kapitalbas (negativt belopp)		66 (b), 68, 477 (3)
54	Direkta och indirekta innehav av supplementärkapitaltillskottsinstrument och efterställda lån i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet inte har någon väsentlig investering (belopp över tröskelvärdet 10 %, netto efter godtagbara korta positioner) (negativt belopp)		66 (c), 69, 70, 79, 477 (4)
54a	Varav nya innehav som inte omfattas av övergångsarrangemang		
54b	Varav innehav som inte fanns före den 1 januari 2013 och som omfattas av övergångsarrangemang		
55	Institutets direkta och indirekta innehav av supplementärkapitalinstrument och efterställda lån i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet har en väsentlig investering (netto efter godtagbara korta positioner) (negativt belopp)		66 (d), 69, 79, 477 (4)
56	Lagstiftningsjusteringar som tillämpas på supplementärkapitaltillskott med avseende på belopp som omfattas av behandling som föreskrivs i lagstiftningen före kapitaltäckningsförordningen och övergångsbehandling som omfattas av utfasning i enlighet med förordning (EU) nr 575/2013 (dvs. restvärde enligt kapitaltäckningsförordningen)		
56a	Restvärden som dras från supplementärkapital med avseende på avdrag från kärnprimärkapital under övergångsperioden i enlighet med artikel 472 i förordning (EU) nr 575/2013		472, 472(3)(a), 472 (4), 472 (6), 472 (8), 472 (9), 472 (10) (a), 472 (11) (a)
	Varav poster ska redovisas rad för rad, t.ex. väsentliga delårsförluster netto, immateriella tillgångar, underskott i avsättningar i förhållande till förväntade förluster osv.		
56b	Restvärden som dras från supplementärkapital med avseende på avdrag från primärkapitaltillskott under övergångsperioden i enlighet med artikel 475 i förordning (EU) nr 575/2013		475, 475 (2) (a), 475 (3), 475 (4) (a)
	Varav poster ska redovisas rad för rad, t.ex. korsvist ägande av primärkapitaltillskottsinstrument, direkta innehav av icke-väsentliga investeringar i kapitalet hos andra enheter i den finansiella sektorn osv.		
56c	Belopp som ska dras av ifrån eller läggas till supplementärkapital med avseende på ytterligare filter och avdrag som krävs enligt bestämmelser som tillämpades före kapitaltäckningsförordningen		467, 468, 481
	Varav: ... eventuellt filter för realiserade förluster		467
	Varav: ... eventuellt filter för realiserade vinster		468
	Varav: ...		481
57	Summa lagstiftningsjusteringar av supplementärkapital		
58	Supplementärkapital	31 348	
59	Totalt kapital (totalt kapital = primärkapital + supplementärkapital)	229 936	
59a	Riskvägda tillgångar med avseende på belopp som omfattas av behandling som föreskrivs i de bestämmelser som tillämpades före kapitaltäckningsförordningen och övergångs-behandling som omfattas av utfasning i enlighet med förordning (EU) nr 575/2013 (dvs. restvärde enligt kapitaltäckningsförordningen)		
	Varav: ...poster som inte dragits av från kärnprimärkapital (restvärden enligt kapitaltäckningsförordning (EU) 575/2013) (poster ska redovisas rad för rad, t.ex. uppskjutna skattefordringar som är beroende av framtida lönsamhet netto efter minskning för tillhörande skatteskuld, indirekta innehav av eget kärnprimärkapital osv.)		472, 472 (5), 472 (8) (b), 472 (10) (b), 472 (11) (b)
	Varav: ...poster som inte dragits av från primärkapitaltillskottsposter (restvärden enligt förordning (EU) nr 575/2013) (poster ska redovisas rad för rad, t.ex. korsvist ägande av supplementärkapitalinstrument, direkta innehav av icke-väsentliga investeringar i kapitalet hos andra enheter i den finansiella sektorn osv.)		475, 475 (2) (b), 475 (2) ©, 475 (4) (b)

	Poster som inte dragits av från supplementärkapitalinstrument (restvärden enligt förordning (EU) nr 575/2013) (poster ska redovisas rad för rad, t.ex. indirekta innehav av egna supplementärkapitalinstrument, innehav av icke-väsentliga investeringar i kapital hos andra enheter i den finansiella sektorn, indirekta innehav av väsentliga investeringar i kapital hos andra enheter i den finansiella sektorn osv.)		477, 477 (2) (b), 477 (2) (c), 477 (4) (b)
60	Totala riskvägda tillgångar	1 306 942	
Kapitalrelationer och buffertar			
61	Kärnprimärkapital (som procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)	15,19 %	92 (2) (a), 465
62	Primärkapital (som procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)	15,19 %	92 (2) (b), 465
63	Totalt kapital (som procentandel av det riskvägda exponeringsbeloppet)	17,59 %	92 (2) (c)
64	Institutspecifika buffertkrav (krav på kärnprimärkapital i enlighet med artikel 92.1 a plus krav på kapitalkonserveringsbuffert och kontryckisk kapitalbuffert, plus systemriskbuffert, plus buffert för systemviktiga institut (buffert för globala systemviktiga institut eller andra systemviktiga institut) uttryckt som en procentandel av det riskvägda exponerings-beloppet)	9,50 %	Kapitalkravsdirektivet 128, 129, 130
65	Varav: krav på kapitalkonserveringsbuffert	2,50 %	
66	Varav: krav på kontryckisk kapitalbuffert	2,50 %	
67	Varav: krav på systemriskbuffert	0	
67a	Varav: buffert för globalt systemviktigt institut eller för annat systemviktigt institut	0	Kapitalkravsdirektivet 131
68	Common Equity Tier 1 available to meet buffers (as a percentage of risk exposure amount)	9,19 %	Kapitalkravsdirektivet 128
69	[ej relevant i EU-förordningen]		
70	[ej relevant i EU-förordningen]		
71	[ej relevant i EU-förordningen]		
Kapitalrelationer och buffertar			
72	Direkta och indirekta innehav av kapital i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet inte har någon väsentlig investering (belopp under tröskelvärdet på 10 %, netto efter godtagbara korta positioner)		36 (1) (h), 45, 46, 472 (10) 56 (c), 59, 60, 475 (4), 66 (c), 69, 70, 477 (4)
73	Institutets direkta och indirekta innehav av kärnprimärkapitalinstrument i enheter i den finansiella sektorn i vilka institutet har en väsentlig investering (belopp under tröskelvärdet på 10 %, netto efter godtagbara korta positioner)		36 (1) (i), 45, 48, 470, 472 (11)
74	Tomt fält i EU		
75	Uppskjutna skattefordringar som uppstår till följd av temporära skillnader (belopp under tröskelvärdet på 10 %, netto efter minskning för tillhörande skatteskuld när villkoren i artikel 38.3 är uppfyllda)		36 (1) (c), 38, 48, 470, 472 (5)
Tak som ska tillämpas på inkludering av avsättningar i supplementärkapitalet			
76	Kreditriskjusteringar som inkluderas i supplementärkapitalet med avseende på exponeringar som omfattas av schablonmetoden (före tillämpning av taket)		62
77	Tak för inkludering av kreditriskjusteringar i supplementärkapitalet enligt schablonmetoden		62
78	Kreditriskjusteringar som inkluderas i supplementärkapitalet med avseende på exponeringar som omfattas av internmetoden (före tillämpningen av taket)		62
79	Tak för inkludering av kreditriskexponeringar i supplementärkapitalet enligt internmetoden		62
Kapitalinstrument som omfattas av utfasningsarrangemang (får endast tillämpas mellan den 1 januari 2013 och den 1 januari 2022)			
80	Nuvarande tak för kärnprimärkapitalinstrument som omfattas av utfasningsarrangemang		484 (3), 486 (2) & (5)
81	Belopp som utesluts från kärnprimärkapital på grund av tak (överskjutande belopp över taket efter inlösen och förfallodagar)		484 (3), 486 (2) & (5)
82	Nuvarande tak för primärkapitaltill-skottsinstrument som omfattas av utfasningsarrangemang		484 (4), 486 (3) & (5)
83	Belopp som utesluts från primärkapitaltillskott på grund av tak (överskjutande belopp över taket efter inlösen och förfallodagar)		484 (4), 486 (3) & (5)
84	Nuvarande tak för supplementärkapital-instrument som omfattas av utfasningsarrangemang		484 (5), 486 (4) & (5)
85	Belopp som utesluts från supplementärkapitalet på grund av tak (överskjutande belopp över taket efter inlösen och förfallodagar)		484 (5), 486 (4) & (5)