

2013-03-31

Uppgifter om kapitalbas

Pareto Öhman AB, tkr

Primärt kapital, brutto	106 944
Avdragsposter	-17 211
Supplementärt kapital	33 000
Utökad kapitalbas	-
Total kapitalbas	122 733

Uppgifter om kapitalkrav

Kapitalkrav för kreditrisk	7 922
Kapitalkrav för risker i handelslager	11 454
Kapitalkrav för operativ risk	33 737
Kapitalkrav för valutarisk	318
Kapitalkrav för råvarurisk	-
Totalt kapitalkrav	53 431

Kapitaltäckningskvot (kapitalbas/kapitalkrav) 2,30

Kvantitativ information om likviditetsrisk och likviditetspositioner Pareto Öhman AB

Balansräkningen består på tillgångssidan till största del av likvida värdepapper och utlåning mot säkerhet i noterade värdepapper. En god likviditetsberedskap säkerställs genom hållande av en likviditetsreserv samt genom att Pareto Öhman AB gentemot kunderna har en avtalsmässig möjlighet att rebelieåna säkerheter för utlåningen.

Likviditetsreserv

Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk.

MSEK

50

Utlåning

150

Inlåning

513

Kvot inlåning/utlåning

3,42

Kvot likviditetsreserv/inlåning

0,10