

30.09.2013

Uppgifter om kapitalbas

Pareto Securities AB, tkr

Primärt kapital, brutto	106,944
Avdragsposter	-8,370
Supplementärt kapital	33,000
Utökad kapitalbas	-
Total kapitalbas	131,574

Uppgifter om kapitalkrav

Kapitalkrav för kreditrisk	5,355
Kapitalkrav för risker i handelslager	8,148
Kapitalkrav för operativ risk	33,737
Kapitalkrav för valutarisk	535
Kapitalkrav för råvarurisk	-
Totalt kapitalkrav	47,775

Kapitaltäckningskvot (kapitalbas/kapitalkrav) 2.75

Kvantitativ information om likviditetsrisk och likviditetspositioner Pareto Securities 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 Securities AB gentemot kunderna har en avtalsmässig möjlighet att rebelåna säkerheter för utlåningen.

Likviditetsreserv

Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk.

MSEK

50

Utlåning

118

Inlåning

517

Kvot inlåning/utlåning

4.38

Kvot likviditetsreserv/inlåning

0.10