

31.12.2013

Uppgifter om kapitalbas	Pareto Securities AB, tkr
Primärt kapital, brutto	106,944
Avdragsposter	-7,112
Supplementärt kapital	33,000
Utökad kapitalbas	-
Total kapitalbas	132,832

Uppgifter om kapitalkrav

Kapitalkrav för kreditrisk	13,307
Kapitalkrav för risker i handelslager	5,872
Kapitalkrav för operativ risk	33,737
Kapitalkrav för valutarisk	1,006
Kapitalkrav för råvarurisk	-
Totalt kapitalkrav	53,922

Kapitaltäckningskvot (kapitalbas/kapitalkrav) 2.46

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	MSEK
Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk.	50
Utlåning	147
Inlåning	534
Kvot inlåning/utlåning	3.63
Kvot likviditetsreserv/inlåning	0.09