

31.03.2014

**Uppgifter om kapitalbas**

**Pareto Securities AB, tkr**

Primärt kapital, brutto	106,944
Avdragsposter	-5,959
Supplementärt kapital	26,400
Utökad kapitalbas	-
<b>Total kapitalbas</b>	<b>127,385</b>

**Uppgifter om kapitalkrav**

Kapitalkrav för kreditrisk	11,975
Kapitalkrav för risker i handelslager	8,406
Kapitalkrav för operativ risk	35,577
Kapitalkrav för valutarisk	-
Kapitalkrav för råvarurisk	-
<b>Totalt kapitalkrav</b>	<b>55,958</b>

**Kapitaltäckningskvot (kapitalbas/kapitalkrav) 2.28**

**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**

141

**Inlåning**

479

**Kvot inlåning/utlåning**

3.40

**Kvot likviditetsreserv/inlåning**

0.10