

30/06/2014

Uppgifter om kapitalbas

Pareto Securities AB, tkr

Primärt kapital, brutto	106,944
Avdragsposter	-6,164
Supplementärt kapital	23,100
Utökad kapitalbas	-
Total kapitalbas	123,880

Uppgifter om kapitalkrav

Kapitalkrav för kreditrisk	9,764
Kapitalkrav för risker i handelslager	9,891
Kapitalkrav för operativ risk	35,577
Kapitalkrav för valutarisk	-
Kapitalkrav för råvarurisk	-
Totalt kapitalkrav	55,232

Kapitaltäckningskvot (kapitalbas/kapitalkrav) 2.24

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 rebelieåna säkerheter för utlåningen.

Likviditetsreserv

Likviditetsreserven består av likvida och belåningsbara obligationer med låg kreditrisk.

MSEK

50

Utlåning

143

Inlåning

502

Kvot inlåning/utlåning

3.51

Kvot likviditetsreserv/inlåning

0.10