

Master data - Information om indberetterenheden

FTId nummer	idno
Indberetningsperiode (åååå4k)	refperio
Løbenummer	loebenr

Information om virksomheder

Virksomhedens navn	firmanavn
Gadenavn og nr.	gadenavn
Postnr.	postnr
Postboks	boks
By	by
Telefonnr.	tlf

Kontaktpersoner

Navn	Telefonnr.	E-mail adresse
fuldtnavn	tlf	email

Basisoplysninger og konklusion

1.000 kr.

	Beløb
Basisoplysninger	
1. Balance	Bal
2. Kapitalkrav før scenarie	KFS
3. Basiskapital før scenarie	BFS
4. Skattesats	Skat
Konklusion - Rødt	
5. Værste rentescenarie	VRs
6. Renterisiko-rentebærende fordringer	RrF
7. Landespændrisiko-danske statsobligationer	LDS
8. Aktiekursrisiko	Aris
9. Råvarerisiko	Rris
10. Valutakursrisiko	Vris
11. Ejendomsrisiko	Eris
12. Kredit- og modpartsrisiko	KMris
13. Risiko i dattervirksomheder	RisDv
14. Samlet risiko på aktiverne	RisAk
15. Renterisiko-livsforsikringshensættelser	RrL
16. Landespændrisiko-livsforsikringshensættelser	LLh
17. Renterisiko-præmie- og erstatningshensættelser	RPEh
18. Landespændrisiko-præmie- og erstatningshensættelser	Lpe
Livsforsikringsselskaber og tværgående pensionskasser	
19. Basiskapital efter scenarie	BeSL
20. Kapitalkrav efter scenarie -	KeS
21. 3 pct. af garanterede ydelser og bonuspotentiale på fremtidige præmier efter scenarie +	GyBo
22. Overdækning =	OdL
23. Kollektivt bonuspotentiale efter scenarie	KBeS
24. Bonuspotentiale på fripolicydelserne efter scenarie	BpFy
25. Risikojusteret solvensgrad	RisS
26. Selskabet er i	LLys
Skadesforsikringsselskaber og arbejdsskadeselskaber	
27. Basiskapital efter scenarie	BeSS
28. Overdækning	OdS
29. Selskabet er i	SLys

Gruppenavn BaKo

Renterisiko - Rentebærende fordringer

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
	Basiskapital			
1.	Nominelt forrentede obligationer - Varighed på et år og derunder	Mv	Rf	Rs
2.	Varighed på over et år og til og med 3,6 år	Mv	Rf	Rs
3.	Varighed på over 3,6 år	Mv	Rf	Rs
4.	Indeksobligationer	Mv	Rf	Rs
5.	Pantebreve og erhvervsobligationer	Mv	Rf	Rs
6.	Finansielle instrumenter	Mv	Rf	Rs
	Total - Renterisiko på rentebærende fordringer	Mv	Rf	Rs

Gruppenavn

NFO
Vh1
Vh36
iobL
PE
Fin
RFtot

Renterisiko - Rentebærende fordringer, Rentebestand

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
1.	Nominelt forrentede obligationer - Varighed på et år og derunder	Mv	Rf	Rs
2.	Varighed på over et år og til og med 3,6 år	Mv	Rf	Rs
3.	Varighed på over 3,6 år	Mv	Rf	Rs
4.	Indeksobligationer	Mv	Rf	Rs
5.	Pantebreve og erhvervsobligationer	Mv	Rf	Rs
6.	Finansielle instrumenter	Mv	Rf	Rs

Gruppenavn

NFO
Vh1
Vh36
iobL
PE
Fin

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Landespændsrisiko - Danske statsobligationer

1.000 kr.

	Markedsværdi	Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
Basiskapital			
Danske statsobligationer	Mv	Rf	Rs
Total - Landespændsrisiko på danske statsobligationer	Mv	Rf	Rs

Gruppenavn

DSb

DStot

Landspændsrisiko - Danske statsobligationer, Rentebestand

1.000 kr.

	Markedsværdi	Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
Danske statsobligationer	Mv	Rf	Rs

Gruppenavn

DSR

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Renterisiko - Livsforsikrings-, præmie- og erstatningshensættelser, Rentebestand

1.000 kr.

		Hensættelser	Hensættelser (Andel)	Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
1.	Garanterede ydelser	Hs		Rf	Rs
2.	Bonuspotentiale på fripolicydelser	Hs		Rf	Rs
3.	Bonuspotentiale på fremtidige præmier	Hs		Rf	Rs
4.	Kollektivt bonuspotentiale	Hs			
5.	Andel af bonuspotentiale på fripolicy der kan anvendes til dækning af tab	Hs	HsA		

Gruppenavn

GY

BFy

BFP

KB

Tab

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Renterisiko - Livsforsikrings-, præmie- og erstatningshensættelser

1.000 kr.

		Hensættelser	Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
	Total			
1.	Total - Garanterede ydelser	Hs	Rf	Rs
2.	Total - Bonuspotentiale på fripolicydelser	Hs	Rf	Rs
3.	Total - Bonuspotentiale på fremtidige præmier	Hs	Rf	Rs
4.	Total - Kollektivt bonuspotentiale	Hs	Rf	Rs
	Renterisiko - præmie- og erstatningshensættelser (Denne del af skemaet udfyldes kun af skadesforsikringsselskaber og arbejdsskadeselskaber)			
5.	Præmiehensættelser	Hs	Rf	Rs
6.	Erstatningshensættelser	Hs	Rf	Rs

Gruppenavn

GY
BFy
BFP
KB

Ph
Eh

Landespændsrisiko - Livsforsikrings-, præmie- og erstatningshensættelser, Rentebestand

1.000 kr.

		Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
1.	Garanterede ydelser	Rf	Rs
2.	Bonuspotentialer på fripolicydelser	Rf	Rs
3.	Bonuspotentialer på fremtidige præmier	Rf	Rs

Gruppenavn

GY

BFy

BFP

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Landespændsrisiko - Livsforsikrings-, præmie- og erstatningshensættelser

1.000 kr.

		Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning
	Total		
1.	Total - Garanterede ydelser	Rf	Rs
2.	Total - Bonuspotentiale på fripolicydelser	Rf	Rs
3.	Total - Bonuspotentiale på fremtidige præmier	Rf	Rs
	Landespændsrisiko - præmie- og erstatningshensættelser (Denne del af skemaet skal kun udfyldes af skadesforsikringsselskaber og arbejdsskadeselskaber)		
4.	Præmiehensættelser	Rf	Rs
5.	Erstatningshensættelser	Rf	Rs

Gruppenavn

GY
BFy
BFP
Ph
Eh

Aktiekursrisiko

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt
	Basiskapital		
1.	Aktier	Mv	Rdt
2.	Finansielle instrumenter	Mv	Rdt
	Total - Aktierisiko	Mv	Rdt

Gruppenavn

Akt

Fin

Atot

Aktiekursrisiko, Rentebestand

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt
1.	Aktier	Mv	Rdt
2.	Finansielle instrumenter	Mv	Rdt

Gruppenavn

Akt

Fin

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Råvarerisiko

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt
	Basiskapital		
1.	Råvareindeksede obligationer	Mv	Rdt
2.	Finansielle instrumenter	Mv	Rdt
	Total - Råvarerisiko	Mv	Rdt

Gruppenavn

RO

Fin

Rtot

Råvarerisiko, Rentebestand

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt
1.	Råvareindekserede obligationer	Mv	Rdt
2.	Finansielle instrumenter	Mv	Rdt

Gruppenavn

RO
Fin

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Valutakursrisiko - Value-at-risk

1.000 kr.

		Nettobeholdning
	Basiskapital	
1.	USD	USD
2.	GBP	GBP
3.	SEK	SEK
4.	NOK	NOK
5.	CHF	CHF
6.	CAD	CAD
7.	JPY	JPY
8.	EUR	EUR
9.	Total	Tot
10.	VaR (99 pct.)	VaR
11.	Øvrig valuta	XV
	Total - Valutakursrisiko	Vtot

Gruppenavn **VNb**

Valutakursrisiko - Value-at-risk, Rentebestand

1.000 kr.

		Nettobeholdning
1.	USD	USD
2.	GBP	GBP
3.	SEK	SEK
4.	NOK	NOK
5.	CHF	CHF
6.	CAD	CAD
7.	JPY	JPY
8.	EUR	EUR
9.	Total	Tot
10.	VaR (99 pct.)	VaR
11.	Øvrig valuta	XV

Gruppenavn **RNb**

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Ejendomsrisiko

1.000 kr.

Gruppenavn

		Markedsværdi	Rødt
	Basiskapital		
1.	Ejendomme	Mv	Rdt
2.	Ejendomsselskab	Mv	Rdt
3.	Finansielle instrumenter	Mv	Rdt
	Total - Ejendomsrisiko	Mv	Rdt

Ejd
Ejds
Fin
Etot

Ejendomsrisiko, Rentebestand

1.000 kr.

		Markedsværdi	Rødt
1.	Ejendomme	Mv	Rdt
2.	Ejendomsselskab	Mv	Rdt
3.	Finansielle instrumenter	Mv	Rdt

Gruppenavn

Ejd
Ejds
Fin

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Kreditrisiko

1.000 kr.

		Uvægtet beløb	Vægtet beløb
	Basiskapital		
1.	Statsobligationer	UvB	VB
2.	Realkreditobligationer - restløbetid under 6 mdr.	UvB	VB
3.	Restløbetid mellem 6 mdr. og 2 år	UvB	VB
4.	Restløbetid over 2 år	UvB	VB
5.	Andre gældsinstrumenter udstedt af kreditinstitutter mv. Restløbetid under 6 mdr.	UvB	VB
6.	Restløbetid mellem 6 mdr. og 2 år	UvB	VB
7.	Restløbetid over 2 år	UvB	VB
8.	Øvrige gældsinstrumenter mv.	UvB	VB
9.	Total - Kreditrisiko basiskapital (total vægtet beløb multipliceret med 0,08)		VB
	Total		VB
	Total - Kreditrisiko		VB

Gruppenavn

SobL

RobL

Rt6

Rt2

Gi

Gt6

Gt2

XG

KBtot

Tot

Ktot

Kreditrisiko, Rentebestand

1.000 kr.

		Uvægtet beløb	Vægtet beløb
1.	Statsobligationer	UvB	VB
2.	Realkreditobligationer - Restløbetid under 6 mdr.	UvB	VB
3.	Restløbetid mellem 6 mdr. og 2 år	UvB	VB
4.	Restløbetid over 2 år	UvB	VB
5.	Andre gældsinstrumenter udstedt af kreditinstitutter mv. Restløbetid under 6 mdr.	UvB	VB
6.	Restløbetid mellem 6 mdr. og 2 år	UvB	VB
7.	Restløbetid over 2 år	UvB	VB
8.	Øvrige gældsinstrumenter mv.	UvB	VB
9.	Total - Kreditrisiko basiskapital (total vægtet beløb multipliceret med 0,08)		VB

Gruppenavn

SobL
RobL
Rt6
Rt2
Gi
Gt6
Gt2
XG
KBtot

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Modpartsrisiko

1.000 kr.

Gruppenavn

		Uvægtet beløb	Vægtet beløb
	Basiskapital		
1.	Positiv markedsværdi af indgåede kontrakter	UvB	VB
2.	Rentekontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
3.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
4.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
5.	Valutakurskontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
6.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
7.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
8.	Aktiekontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
9.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
10.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
11.	Råvarekontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
12.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
13.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
14.	Total - Modpartsrisiko basiskapital (total vægtet beløb multipliceret med 0,08)		VB
	Total		VB
	Total - Modpartsrisiko		VB

PMv
Rk
Rk1
Rk5
Vk
Vk1
Vk5
Ak
Ak1
Ak5
Rvk
Rvk1
Rvk5
MBtot
Tot
Mtot

Modpartsrisiko, Rentebestand

1.000 kr.

Gruppenavn

		Uvægtet beløb	Vægtet beløb
1.	Positiv markedsværdi af indgåede kontrakter	UvB	VB
2.	Rentekontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
3.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
4.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
5.	Valutakurskontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
6.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
7.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
8.	Aktiekontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
9.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
10.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
11.	Råvarekontrakter - Restløbetid under 1 år	UvB	VB
12.	Restløbetid mellem 1 år og 5 år	UvB	VB
13.	Restløbetid over 5 år	UvB	VB
14.	Total - Modpartsrisiko basiskapital (total vægtet beløb multipliceret med 0,08)		VB

PMv
Rk
Rk1
Rk5
Vk
Vk1
Vk5
Ak
Ak1
Ak5
Rvk
Rvk1
Rvk5
MBtot

**Fanen er et repeterende ark.
Et nyt ark for hver rentebestand.**

Risici i dattervirksomheder

1.000 kr.

		Rødt
1.	Renterisiko - rentebærende fordringer (rentestigning)	RRS
2.	Renterisiko - rentebærende fordringer (rentefald)	RRF
3.	Landespændsrisiko - danske statsobligationer (rentestigning)	LDS
4.	Landespændsrisiko - danske statsobligationer (rentefald)	LDF
5.	Renterisiko - livsforsikringshensættelser (rentestigning)	RLS
6.	Renterisiko - livsforsikringshensættelser (rentefald)	RLF
7.	Landespændsrisiko - livsforsikringshensættelser (rentestigning)	LLS
8.	Landespændsrisiko - livsforsikringshensættelser (rentefald)	LLF
9.	Renterisiko - præmie- og erstatningshensættelser (rentestigning)	RPS
10.	Renterisiko - præmie- og erstatningshensættelser (rentefald)	RPF
11.	Landespændsrisiko - præmie- og erstatningshensættelser (rentestigning)	LPS
12.	Landespændsrisiko - præmie- og erstatningshensættelser (rentefald)	LPF
13.	Aktiekursrisiko	Aris
14.	Råvarerisiko	Rris
15.	Valutakursrisiko	Vris
16.	Ejendomsrisiko	Eris
17.	Kredit- og modpartsrisiko	KMris

Gruppenavn

RiDa