

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

Opgørelse af renterisiko, jf. § 7

1.000 kr.

			Beløb
1.		Renterisiko i henhold til § 7, stk. 2:	
	1.1	Solvenskrav i kapitalcenteret	Sk2
	1.2	Maksimalt tilladt renterisiko (1 pct. af post 1.1 tillagt 5 pct. af yderligere overdækning)	MTR2
	1.3	Renterisiko i henhold til § 7, stk. 2, inden modregning af renterisiko i EUR/DKK efter § 7, stk. 7	RIM2
	1.4	Renterisiko i henhold til § 7, stk. 2, efter modregning af renterisiko i EUR/DKK efter § 7, stk. 7	REM2
2.		Renterisiko i henhold til § 7, stk. 4:	
	2.1	Solvenskrav i kapitalcenteret	Sk4
	2.2	Maksimalt tilladt renterisiko (5 pct. af post 2.1 tillagt 10 pct. af yderligere overdækning)	MTR4
	2.3	Renterisiko opgjort i henhold til § 7, stk. 4, inden modregning af renterisiko i EUR/DKK efter § 7, stk. 7	RIM4
	2.4	Renterisiko opgjort i henhold til § 7, stk. 4, efter modregning af renterisiko i EUR/DKK efter § 7, stk. 7	REM4

Gruppenavn

RRO

Fanen er et repeterende ark.

Nyt ark for hvert kapitalcenternr.

Opgørelse af valutakursrisiko, jf. § 9

1.000 kr.

			Beløb
1.		Opgørelse af valutakursrisiko i henhold til § 9, stk. 2:	
	1.1	Solvenskrav i kapitalcenteret	Sk
	1.2	Maksimal tilladt valutakursrisiko (10 pct. af post 1.1 tillagt 10 pct. af yderligere overdækning)	MTV
	1.3	Valutakursrisiko opgjort i henhold til § 9, stk. 2	VO

Gruppenavn **VKRO**

**Fanen er et repeterende ark.
Nyt ark for hvert kapitalcenternr.**

Opgørelse af optionsrisiko, jf. § 10

1.000 kr.

		Beløb
1.	Optionsrisiko i henhold til § 10, stk. 3:	
1.1	Solvenskrav i kapitalcenteret	Sk
1.2	Maksimal tilladt optionsrisiko (0,5 pct. af post 1.1 tillagt 1 pct. af yderligere overdækning)	MTO
1.3	Optionsrisiko opgjort i henhold til § 10, stk. 3, før modregning af optionsrisiko i EUR/DKK efter § 10, stk. 6	OFM
1.4	Optionsrisiko opgjort i henhold til § 10, stk. 3, efter modregning af optionsrisiko i EUR/DKK efter § 10, stk. 6	OEM

Gruppenavn **OPRO**

**Fanen er et repeterende ark.
Nyt ark for hvert kapitalcenternr.**

Opgørelse af renterisiko på fondsbeholdning m.m., jf. § 17

1.000 kr.

			Renterisiko
1.		Renterisiko i henhold til § 17, stk. 1:	
	1.1	Kapitalgrundlag	Kg
	1.2	Maksimal tilladt renterisiko (8 pct. af post 1.1)	MTR
	1.3	Renterisiko i henhold til § 17, stk. 1, inden modregning af renterisiko i EUR/DKK efter § 7, stk. 7	RIM
	1.4	Renterisiko i henhold til § nu 17, stk. 1, efter modregning af renterisiko i EUR/DKK efter § 7, stk. 7.	REM

Gruppenavn RRFO

Opgørelse af renterisiko på fondsbeholdning mv., jf. § 28

1.000 kr.

		Renterisiko
1.	Børsnoterede obligationer i DKK	BO
2.	Unoterede obligationer i DKK	UO
3.	Tilgodehavender i DKK hos kreditinstitutter	Tkre
4.	Øvrig fondsbeholdning i DKK	FX
5.	Ikke-balanceførte poster i DKK	IbP
6.	Efterstillet kapital i DKK	Ekap
7.	Fondsbeholdning mv. i DKK i alt (post 1 + 2 + 3 + 4 + 5 + 6)	FDTot
8.	Fondsbeholdning mv. i EUR i alt	FETot
9.	Fondsbeholdning mv. i øvrige valutaer i alt	FXTot
10.	Alle valutaer i alt (summen af de numeriske værdier af post 7 + 8 + 9)	VTot
11.	Kapitalgrundlag	Kg
12.	Maksimalt tilladt renterisiko (8 pct. af post 11)	MTR

Gruppenavn **RRFBO**

Opgørelse af renterisiko inden for balanceprincippet, jf. § 26

1.000 kr.

			Renterisiko
1.		Renterisiko i henhold til § 26, stk. 1:	
	1.1	Kapitalgrundlag	Kg
	1.2	Maksimal tilladt renterisiko (1 pct. af post 1.1)	MTR
	1.3	Renterisiko ifølge dispensation efter § 30	Rdisp
	1.4	Renterisiko som følge af øvrige betalingsforskelle, jf. post 2.5	RBfX
2.		Opgørelse af renterisiko i henhold til § 26, stk. 2:	
	2.1	Renterisiko i DKK	RrD
	2.2	Renterisiko i EUR	RrE
	2.3	Summen af lange nettopositioner i øvrige valutaer	LNvX
	2.4	Summen af korte nettopositioner i øvrige valutaer	KNvX
	2.5	Renterisiko i alt (numerisk sum af post 2.1 til 2.4)	RTot

Gruppenavn

RRBPO