

## 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
<b>Basisoplysninger</b>	
1. Balance før scenarie	BBa
2. Solvenskrav før scenarie	BSo
3. Basiskapital før scenarie	BBk
4. Øvrige reserver der kan anvendes til dækning af tab	BAR
5. Pensionskassen er i (vælg: Rødt lys, Gult lys eller Grønt lys)	Lys
<b>Konklusion</b>	
<b>Rødt</b>	
6. Renterisiko-rentebærende fordringer	RRF
7. Landspændrisiko-danske statsobligationer	RL
8. Aktiekursrisiko	RA
9. Ejendomsrisiko	RE
10. Råvarerisiko	RRv
11. Finansielle instrumenter	RFI
12. Valutarisiko	RV
13. Skatteeffekt	RS
14. Samlet risiko på aktiverne	RSR
15. Renterisiko-pensionshensættelser	RRP
16. Landspændrisiko-pensionshensættelser	RLP
17. Basiskapital efter scenarie	RBa
18. Solvenskrav efter scenarie -	RSo
19. 3 pct. af pensionshensættelserne efter scenarie +	RPP
20. Overdækning =	RO
21. Værste rentescenarie (vælg: Fald eller Stigning)	RFS
22. Risikojusteret solvensgrad (angives i pct.)	RRS
<b>Gult</b>	
23. Renterisiko-rentebærende fordringer	GRF
24. Landspændrisiko-danske statsobligationer	GL
25. Aktiekursrisiko	GA
26. Ejendomsrisiko	GE
27. Råvarerisiko	GRv
28. Finansielle instrumenter	GFI
29. Valutarisiko	GV
30. Skatteeffekt	GS
31. Samlet risiko på aktiverne	GSR
32. Renterisiko-pensionshensættelser	GRP
33. Landspændrisiko-pensionshensættelser	GLP
34. Basiskapital efter scenarie	GBa
35. Solvenskrav efter scenarie -	GSo
36. 3 pct. af pensionshensættelserne efter scenarie +	GPP
37. Overdækning =	GO
38. Værste rentescenarie (vælg: Fald eller Stigning)	GFS

Gruppenavn **BaKo**

# Renterisiko

1.000 kr.

		Markedsværdi
	<b>Renterisiko</b>	
1.	Rentebærende fordringer	RRF
2.	Danske statsobligationer	RDS
3.	Aktier	RA
4.	Ejendomme	RE
5.	Råvareindekserede obligationer	RRO
6.	Øvrige investeringsaktiver	RAI
7.	Netto valutabeholdning	RNV
8.	Pensionshensættelser	RPh
	<b>Rødt</b>	
9.	Renterisiko-rentebærende fordringer (rentefald)	RFF
10.	Renterisiko-rentebærende fordringer (rentestigning)	RFS
11.	Landspændrisiko-danske statsobligationer (rentefald)	RSF
12.	Landspændrisiko-danske statsobligationer (rentestigning)	RSS
13.	Renterisiko-pensionshensættelser (rentefald)	RPF
14.	Renterisiko-pensionshensættelser (rentestigning)	RPS
15.	Landspændrisiko-pensionshensættelser (rentefald)	RLF
16.	Landspændrisiko-pensionshensættelser (rentestigning)	RLS
	<b>Gult</b>	
17.	Renterisiko-rentebærende fordringer (rentefald)	GFF
18.	Renterisiko-rentebærende fordringer (rentestigning)	GFS
19.	Landspændrisiko-danske statsobligationer (rentefald)	GSF
20.	Landspændrisiko-danske statsobligationer (rentestigning)	GSS
21.	Renterisiko-pensionshensættelser (rentefald)	GPF
22.	Renterisiko-pensionshensættelser (rentestigning)	GPS
23.	Landspændrisiko-pensionshensættelser (rentefald)	GLF
24.	Landspændrisiko-pensionshensættelser (rentestigning)	GLS

Gruppenavn **Mv**

## Finansielle instrumenter - risiko

1.000 kr.

		Rødt Rentefald	Rødt Rentestigning	Gult Rentefald	Gult Rentestigning
1.	Finansielle instrumenter - rente	RF	RS	GF	GS
2.	Finansielle instrumenter - aktier	RF		GF	
3.	Finansielle instrumenter - råvarer	RF		GF	
<b>4.</b>	<b>Total</b>	RF	RS	GF	GS

Gruppenavn

FRe

FAk

FRv

FTot

# Valutakursrisiko Value-at-risk

1.000 kr.

		Beløb
	<b>Valuta - Nettobeholdning</b>	
1.	USD	USD
2.	GBP	GBP
3.	SEK	SEK
4.	NOK	NOK
5.	CHF	CHF
6.	CAD	CAD
7.	JPY	JPY
8.	EUR	EUR
<b>9.</b>	<b>Total</b>	Tot
10.	VaR (99 %)	VaR1
11.	VaR (99,5 %)	VaR2
12.	Øvrig valuta	VA
	<b>Total</b>	
13.	Rødt	TR
14.	Gult	TG

Gruppenavn **VaRi**