

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRISK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

FFFS 2011:37

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

E-postadress

--

Rapporten ska sändas till Finansinspektionen

INNEHÅLLSFÖRTECKNING

- A. Likviditetsreserv
- B. Intradagssäkerheter
- C. Kassaflöden
- D. Förfall
- E. Skulder
- F. Säkerställda obligationer
- G. Tillgångar och kassaflöde

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRISK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

Belopp anges i tkr utan decimaler
Summeringar ska balansera

A. LIKVIDITETSRESERV

Kassa och tillgodohavanden i bank

	1 SEK	2 EUR	3 USD	4 Övriga valutor
A1 Ingående balans exklusive värderingsavdrag				
A2 Ingående balans inklusive värderingsavdrag				
A3 - varav belåningsbara i centralbank				
A4 - varav pantsatt				
A5 - varav utnyttjad pant				
A6 Likviditetsreserv (A2 - A5)				
A7 Likviditetsreservens kassaflöde, summa (A8 : A12)				
A8 1 dag				
A9 2 dagar				
A10 3 dagar				
A11 4 dagar				
A12 5 dagar				

Statspapper

	5	6	7	8
	SEK	EUR	USD	Övriga valutor
A1	Ingående balans exklusive värderingsavdrag			
A2	Ingående balans inklusive värderingsavdrag			
A3	- varav belåningsbara i centralbank			
A4	- varav pantsatt			
A5	- varav utnyttjad pant			
A6	Likviditetsreserv (A3 - A5)			
A7	Likviditetsreservens kassaflöde, summa (A8 : A12)			
A8	1 dag			
A9	2 dagar			
A10	3 dagar			
A11	4 dagar			
A12	5 dagar			

Säkerställda obligationer

	9	10	11	12
	SEK	EUR	USD	Övriga valutor
A1	Ingående balans exklusive värderingsavdrag			
A2	Ingående balans inklusive värderingsavdrag			
A3	- varav belåningsbara i centralbank			
A4	- varav pantsatt			
A5	- varav utnyttjad pant			
A6	Likviditetsreserv (A3 - A5)			
A7	Likviditetsreservens kassaflöde, summa (A8 : A12)			
A8	1 dag			
A9	2 dagar			
A10	3 dagar			
A11	4 dagar			
A12	5 dagar			

Övriga värdepapper

	13 SEK	14 EUR	15 USD	16 Övriga valutor
A1 Ingående balans exklusive värderingsavdrag				
A2 Ingående balans inklusive värderingsavdrag				
A3 - varav belåningsbara i centralbank				
A4 - varav pantsatt				
A5 - varav utnyttjad pant				
A6 Likviditetsreserv (A3 - A5)				
A7 Likviditetsreservens kassaflöde, summa (A8 : A12)				
A8 1 dag				
A9 2 dagar				
A10 3 dagar				
A11 4 dagar				
A12 5 dagar				

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRIKSK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

Belopp anges i tkr utan decimaler
Summeringar ska balansera

B. INTRADAGSSÄKERHETER

Intradagssäkerheter exklusive utlåning via dagslån

	SEK	EUR	USD	Övriga valutor
B1 Utbetalningsvolym under balansdagen				
B2 Högsta dagliga utbetalningsvolym sedan föregående balansdag				
B3 Betalningsnetto under balansdagen				
B4 Lägsta dagliga betalningsnetto sedan föregående balansdag				

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRISK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

Belopp anges i tkr utan decimaler
Summeringar ska balansera

D. FÖRFALL

Förfall

		SEK	EUR	USD	Övriga valutor
D1	Månad 1				
D2	Månad 2				
D3	Månad 3				
D4	Månad 4				
D5	Månad 5				
D6	Månad 6				
D7	Månad 7				
D8	Månad 8				
D9	Månad 9				
D10	Månad 10				
D11	Månad 11				
D12	Månad 12				
D13	År 2				
D14	År 3				
D15	År 4				
D16	År 5				
D17	År 6				
D18	År 7				
D19	År 8				
D20	År 9				
D21	År 10				
D22	År >10				

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRISK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

Belopp anges i tkr utan decimaler
Summeringar ska balansera

E. SKULDER

Säkerställda skulder

	1 SEK	2 EUR	3 USD	4 Övriga valutor
E1 Balansomslutning				
E2 Bruttoskuld till den största långivaren				
E3 Bruttoskuld till de fem största långivarna				
E4 Utestående skuld till kreditinstitut inom 1 dag				
E5 Utestående skuld till kreditinstitut > 1 dag - 1 vecka				
E6 Utestående skuld till kreditinstitut > 1 vecka - 1 månad				
E7 Utestående skuld till kreditinstitut > 1 månad - 3 månader				
E8 Utestående skuld till kreditinstitut > 3 månader - 6 månader				
E9 Utestående skuld till kreditinstitut > 6 månader - 1 år				
E10 Utestående skuld till kreditinstitut > 1 år				

Ej säkerställda skulder

	5 SEK	6 EUR	7 USD	8 Övriga valutor
E1	Balansomslutning			
E2	Bruttoskuld till den största långivaren			
E3	Bruttoskuld till de fem största långivarna			
E4	Utestående skuld till kreditinstitut inom 1 dag			
E5	Utestående skuld till kreditinstitut > 1 dag - 1 vecka			
E6	Utestående skuld till kreditinstitut > 1 vecka - 1 månad			
E7	Utestående skuld till kreditinstitut > 1 månad - 3 månader			
E8	Utestående skuld till kreditinstitut > 3 månader - 6 månader			
E9	Utestående skuld till kreditinstitut > 6 månader - 1 år			
E10	Utestående skuld till kreditinstitut > 1 år			

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRIISK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

Belopp anges i tkr utan decimaler
Summeringar ska balansera

F. SÄKERSTÄLLDA OBLIGATIONER

Säkerställda obligationer

	SEK	EUR	USD	Övriga valutor
F1 Utestående skuld i form av säkerställda obligationer				
F2 Tillgångar som kvalificerar för att ingå i säkerhetsmassan				
F3 Säkerhetsmassan som är knuten till obligationerna				
F4 - varav fyllnadssäkerheter				

MÅNADSRAPPORT LIKVIDITETSRIK

INSTITUT	
HANDLÄGGARE	TELEFONNUMMER

PERIOD

INSTITUTNUMMER
ORG.NUMMER

Belopp anges i tkr utan decimaler
Summeringar ska balansera

G. TILLGÅNGAR OCH KASSAFLÖDE

Likvida tillgångar

		SEK	EUR	USD	Övriga valutor
Tillgångar, nivå 1					
G1	Kontanta medel				
G2	Tillgodohavanden hos centralbanker				
G3	Värdepapper, stater, m.m.				
G4	Värdepapper, stater och centralbanker i hemlandsvaluta				
G5	Värdepapper, stater och centralbanker i utländsk valuta				
Tillgångar, nivå 2					
G6	Värdepapper, 20 procents riskvikt				
G7	Företagsobligationer				
G8	Säkerställda obligationer				

Kassautflöde

Hushåll					
G9	Inlåning, garanterad				
G10	Inlåning, övrig				
G11	Inlåning, > 30 dagar				
Småföretag utan säkerhet					
G12	Inlåning, garanterad				
G13	Inlåning, övrig				

	SEK	EUR	USD	Övriga valutor
Operativa relationer utan säkerhet				
G14	Inlåning, företag			
G15	Inlåning, stater, m.m.			
Övrigt utan säkerhet				
G16	Inlåning, samarbetande företag			
G17	Inlåning, stater, m.m., övriga			
G18	Övrigt			
Säkerställda värdepapper				
G19	Upplåning mot tillgångar, nivå 1			
G20	Upplåning mot tillgångar, nivå 2			
G21	Upplåning mot stater, m.m. motpart			
G22	Upplåning, övrig			
Ytterligare krav				
G23	Derivatskulder			
G24	Likviditetsbehov vid nedvärdering			
G25	Tillgångar som säkerheter i derivat			
G26	Strukturerade finansiella instrument			
G27	Strukturerade finansieringsobjekt			
G28	Kredit- och likviditetsfaciliteter, hushåll			
G29	Kreditfaciliteter, stater, m.m.			
G30	Likviditetsfaciliteter, stater, m.m.			
G31	Övriga kredit- och likviditetsfaciliteter			
G32	Avtalade finansieringsåtaganden			
G33	Värdeförändring på derivattransaktioner			
G34	Övriga villkorade finansieringsåtaganden			
G35	Övriga kassautflöden			

Kassainflöde

	SEK	EUR	USD	Övriga valutor
Säkerställda värdepapper				
G36 Inlöden från utlåning mot tillgångar, nivå 1				
G37 Inlöden från utlåning mot tillgångar, nivå 2				
G38 Inlöden från utlåning mot övriga tillgångar				
Kontrakterade inflöden från fullt fungerande lån				
G39 Till hushåll				
G40 Från värdepapper och till företag				
G41 Övrigt				
Övrigt				
G42 Kredit- och likviditetsfaciliteter				
G43 Depositioner, operativa eller samarbetande företag				
G44 Derivatfordringar				
G45 Övriga kassainflöden				