

Likviditet

Tillgodohavanden i centralbanker samt värdepappersinnehav i likviditetsreserven

	30 sep 2019	30 jun 2019	31 mar 2019	31 dec 2018	30 sep 2018
Marknadsvärde, mkr					
Tillgångar nivå 1	556 338	509 424	580 629	504 480	580 686
Kassa samt centralbanksreserver	318 301	297 576	391 127	350 679	411 136
Värdepapper emitterade eller garanterade av stater, centralbanker, multilaterala utvecklingsbanker och internationella organisationer	181 846	167 132	143 286	117 120	136 578
Värdepapper emitterade av kommuner och enheter inom den offentliga sektorn	1 922	1 034	1 002	482	749
Säkerställda obligationer med extremt hög kvalitet	54 269	43 682	45 214	36 199	32 223
Tillgångar nivå 2	8 240	8 840	8 105	7 167	6 821
Tillgångar nivå 2A	8 184	8 711	7 964	7 084	6 704
Värdepapper emitterade eller garanterade av stater, centralbanker, kommuner och enheter inom den offentliga sektorn	1 681	1 232	592	4	52
Säkerställda obligationer med hög kvalitet	6 501	7 477	7 372	7 080	6 652
Företagsvärdepapper (lägsta rating AA-)	2	2	-	-	-
Tillgångar nivå 2B	56	129	141	83	117
Värdepapper med bakomliggande tillgångar	-	-	-	-	-
Säkerställda obligationer med hög kvalitet	-	-	-	-	-
Företagsvärdepapper (rating A+ till BBB-)	56	129	141	83	117
Aktier (större aktieindex)	-	-	-	-	-
Summa likvida tillgångar	564 578	518 264	588 734	511 647	587 507
varav i SEK	187 295	200 666	157 472	128 606	158 523
varav i EUR	138 009	103 118	136 112	140 937	124 234
varav i USD	102 373	93 125	149 682	137 142	178 496
varav i övriga valutor	136 901	121 355	145 468	104 962	126 254

30 september 2019

Marknadsvärde, mkr	SEK	EUR	USD	Övrigt	Summa
Tillgångar nivå 1	185 974	136 793	98 373	135 198	556 338
Kassa samt centralbanksreserver	4 212	126 389	97 701	89 999	318 301
Värdepapper emitterade eller garanterade av stater, centralbanker, multilaterala utvecklingsbanker och internationella organisationer	130 921	9 755	672	40 498	181 846
Värdepapper emitterade av kommuner och enheter inom den offentliga sektorn	1 922	-	-	-	1 922
Säkerställda obligationer med extremt hög kvalitet	48 919	649	-	4 701	54 269
Tillgångar nivå 2	1 321	1 216	4 000	1 703	8 240
Tillgångar nivå 2A	1 321	1 160	4 000	1 703	8 184
Värdepapper emitterade eller garanterade av stater, centralbanker, kommuner och enheter inom den offentliga sektorn	-	-	-	1 681	1 681
Säkerställda obligationer med hög kvalitet	1 321	1 158	4 000	22	6 501
Företagsvärdepapper (lägsta rating AA-)	-	2	-	-	2
Tillgångar nivå 2B	-	56	-	-	56
Värdepapper med bakomliggande tillgångar	-	-	-	-	-
Säkerställda obligationer med hög kvalitet	-	-	-	-	-
Företagsvärdepapper (rating A+ till BBB-)	-	56	-	-	56
Aktier (större aktieindex)	-	-	-	-	-
Summa likvida tillgångar	187 295	138 009	102 373	136 901	564 578

Likviditet - nyckeltal

%	30 sep 2019	30 jun 2019	31 mar 2019	31 dec 2018	30 sep 2018	30 jun 2018	31 mar 2018	31 dec 2017
Liquidity coverage ratio (LCR), %	149	143	157	146	161	146	142	139
Net stable funding ratio (NSFR)*, %	112	109	103	104	103	103	102	102

* Från och med 30 juni 2019 enligt CRR2