



FINANSTILSYNET

THE FINANCIAL SUPERVISORY
AUTHORITY OF NORWAY

Mal for brev sendt de seks panelbankene

| VÅR REFERANSE

| DERES REFERANSE

| DATO

Varsel om stedlig tematisyn

Det vises til telefonsamtale dd.mm.

Finanstilsynet bekrefter med dette stedlig tematisyn i (banken) den dd.mm fra kl 09:00. Tematisynet er et ledd i Finanstilsynets arbeid med å vurdere det nåværende systemet for fastsettelsen av Norwegian Interbank Offered Rate (NIBOR). Tematisynet vil konsentreres om forhold knyttet til bankens rolle som panelbank for NIBOR. Finanstilsynet gjennomfører tilsvarende tematisyn i de fem andre panelbankene for NIBOR. Det forutsettes at seksjonsleder compliance deltar, og at andre relevante personer, etter bankens vurdering, fra operativ eller kontrollmessig side deltar, eller er tilgjengelige, under deler av tilsynet. Fra Finanstilsynet vil xx, yy og zz møte.

Finanstilsynet ønsker i tillegg å ha samtale med internrevisor, og ber om at det avtales separat møte med denne.

Finanstilsynet har tidligere mottatt dokumentasjon fra banken som er relevant for tematisynet, jf. vårt brev av 10. august 2012 og Deres brev av dd.mm 2012. For helhetens skyld, og for å fange opp eventuelle endringer i etterkant av tidligere oversendt materiale, bes det om at nedenstående dokumentasjon blir sendt Finanstilsynet i tre eksemplarer og på lagringsmedium slik at den er Finanstilsynet i hende senest dd. april 2013.

1. Organisasjonskart hvor navn, funksjon og plassering på den/de i banken som fastsetter og publiserer bankens daglige bidrag til NIBOR, og den/de som evt. er back-up for førstnevnte, er fremhevet.
2. Stillingsinstrukser og fullmakter for ovennevnte personer.
3. Retningslinjer for å identifisere og håndtere eventuelle interessekonflikter som kan oppstå som følge av at banken selv har interesser i markeder der NIBOR benyttes som referanserenter, jf. "Regler for beregning og publisering av norske pengemarkedsrenter - NIBOR", punkt 4.
4. Eventuelle separate retningslinjer for informasjonshåndtering knyttet til arbeidet med NIBOR.
5. Eventuelle separate retningslinjer for hvordan bankens daglige bidrag til NIBOR fastsettes, verifiseres og dokumenteres. Dersom det ikke er utarbeidet slike retningslinjer, bes det om en kortfattet beskrivelse av nevnte temaer, såfremt dette nå avviker fra tilsvarende beskrivelse mottatt i brev av 16. august 2012.
6. Dokumentasjon på at bankens daglige bidrag til NIBOR lagres. Beskrivelse av hva som lagres, og over hvor lang tid dette er lagret.

FINANSTILSYNET

Revierstredet 3
Postboks 1187 Sentrum
0107 Oslo

Telefon 22 93 98 00
Telefaks 22 63 02 26

post@finansstilsynet.no
www.finanstilsynet.no

Saksbehandler

7. Eventuell dokumentasjon på bankens følsomhet for endringer i NIBOR - det vil si hvordan en høyere og lavere NIBOR slår ut resultatmessig - på en gitt dag, i form av forfallsbok, posisjonslogger, sensitivitetslogger o.l. for uke 8, 2013.
8. Oversikt over eventuelle gjennomførte faktiske transaksjoner av usikrede interbank lån i NOK på NIBOR løpetider i 2013.
9. Eventuelle instruksjoner som omhandler compliancefunksjonens kontrollarbeid knyttet til fastsettelsen, verifiseringen og dokumenteringen av bankens daglige bidrag til NIBOR.
10. En nærmere beskrivelse av hvilke typer compliancekontroller/-stikkprøver som gjøres knyttet til bankens arbeid med NIBOR, og hvor ofte dette gjøres.
11. Eventuelle compliancelogger og compliancerapporter for 2012-2013 som omhandler compliancefunksjonens kontrollarbeid, og/eller andre forhold, knyttet til bankens arbeid med NIBOR.
12. Complianceplan for 2013.
13. Eventuelle styreprotokoller for 2012-2013 som omhandler compliancefunksjonens kontrollarbeid, og/eller andre forhold, knyttet til bankens arbeid med NIBOR.
14. Eventuelle rapporter fra internrevisor for 2012-2013 som omhandler compliancefunksjonens kontrollarbeid, og/eller andre forhold, knyttet til bankens arbeid med NIBOR.
15. Kopi av eventuelle klager/bekymringsmeldinger knyttet til bankens arbeid med NIBOR for 2012-2013.
16. En vurdering av fordeler og ulemper knyttet til organisering av bankens "NIBOR-virksomhet" som henholdsvis (i) en del av bankens "markets"-enhet og (ii) en del av bankens "treasury"-enhet.

Kopi av brevet bes sendt internrevisor.

For Finanstilsynet