



## Valutareservförvaltning, förslag till projekt avseende verkställande av de restriktioner som gäller.

- Vi avser att granska processer, rutiner och aktiviteter som genomförs, eller kommer att genomföras, av banken för att säkerställa att beslutade restriktioner tillämpas i verksamheten och systemstödet (Dimension). Vi kommer att följa hanteringkedjan från beslut till verifiering och bedöma den interna kontrollen i de olika momenten:
  - Fastställande av finansiell riskpolicy
  - Utarbetande och fastställande av underliggande investerings- och förvaltningspolicy
  - Kommunikation av beslutade restriktioner till berörd personal
  - Implementering av restriktionerna i verksamheten och systemstöd
  - Bankens testning och verifiering av tillämpade restriktioner, inklusive avstämning med/uppföljning som görs av Riskenheten
- Enligt plan skall KAP den 30/6 2010 ha dokumenterat regelefterlevnaden i Dimension mot investerings- och riskpolicy.
- Granskningen kommer att genomföras genom intervjuer med i huvudsak KAP ledning, Middle Office och Riskenheten samt inläsning av relevant dokumentation. Under granskningen kommer även kontakt tas med internrevisionen.
- Omfattningen bedöms bli cirka 70 timmar, inklusive avrapportering av möjliga förbättringsförslag.
- Granskningen föreslås genomföras under augusti-september då rutinbeskrivningen torde vara implementerad. Projektet bedöms kunna avrapporteras under oktober 2010.