FINANSSIVALVONTA

#REF!

Annettu

Korvaa

Voimassa

KORKORISKI

FINANSSIVALVONTA

#REF!

Annettu
Korvaa
Voimassa

KORKORISKI

#REF!

R06

Määräykset ja ohjeet: 1/2014

Tiedonantajatasot: 201, 284

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautusviive: 20 pankkipäivää

TASEEN VASTATTAVAA

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain

Valuutta: #REF!

Rivinro				Luokittelut ekijät C krit	Yhteensä	> 0 <= 1 kk C040001	> 1 kk <= 2 kk C040501	> 2 kk <= 3 kk C040502	> 3 kk <= 4 kk C040503	> 4 kk <= 5 kk C040504	> 5 kk <= 6 kk C040505	> 6 kk <= 7 kk C040506	> 7 kk <= 8 kk C040507	> 8 kk <= 9 kk C040508	> 9 kk <= 10 kk C040509	> 10 kk <= 11 kk C040510	> 11 kk <= 12 kk C040511	> 1 v <= 2 v C050001	> 2 v <= 3 v C050002	> 3 v <= 4 v C050003	> 4 v <= 5 v C050004	> 5 v <= 7 v C150101	> 7 v <= 10 v C150301	> 10 v <= 15 v C16	> 15 v <= 20 v C17001	> 20 v C1702	
				Lähin korontarkistusajankohta	02	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260	270	280	290	300	310	
100			TALLETUKSET	Kr03	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	10		Keskuspankit ja luottolaitokset	Kr03	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	10	05	Käyttötilit / yön yli- talletukset	Kr03	0																							
100	10	10	Määräaikaistalletukset	Kr03	0																							
100	10	15	Irtisanomisehtoiset talletukset	Kr03	0																							
100	10	20	Takaisinostosopimukset	Kr03	0																							
100	20		Yritykset	Kr03	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	20	05	Käyttötilit / yön yli- talletukset	Kr03	0																							
100	20	10	Määräaikaistalletukset	Kr03	0																							
100	20	15	Irtisanomisehtoiset talletukset	Kr03	0																							
100	20	20	Takaisinostosopimukset	Kr03	0																							
100	30		Kotitaloudet	Kr03	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	30	05	Käyttötilit / yön yli- talletukset	Kr03	0																							
100	30	10	Määräaikaistalletukset	Kr03	0																							
100	30	15	Irtisanomisehtoiset talletukset	Kr03	0																							
100	30	20	Takaisinostosopimukset	Kr03	0																							
100	40		Muut	Kr03	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
100	40	05	Käyttötilit / yön yli- talletukset	Kr03	0																							
100	40	10	Määräaikaistalletukset	Kr03	0																							
100	40	15	Irtisanomisehtoiset talletukset	Kr03	0																							
100	40	20	Takaisinostosopimukset	Kr03	0																							
110			LIIKKEELLELASKETUT VIERAANPÄÄOMAN EHTOISET ARVOPAPERIT	Kr03	0																							
120			MUUT RAHOITUSVELAT	Kr03	0																							
130			MUUT VELAT	Kr03	0																							

FINANSSIVALVONTA

#REF!

Annettu
Korvaa
Voimassa

KORKORISKI

#REF!

R08

Määräykset ja ohjeet: 1/2014

Tiedonantajatasot: 201, 284

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautusviive: 20 pankkipäivää

JOHDANNAISET

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain

Valuutta: #REF!

Rivinro			Arvo	> 0 <= 1 kk C040001	> 1 kk <= 2 kk C040501	> 2 kk <= 3 kk C040502	> 3 kk <= 4 kk C040503	> 4 kk <= 5 kk C040504	> 5 kk <= 6 kk C040505	> 6 kk <= 7 kk C040506	> 7 kk <= 8 kk C040507	> 8 kk <= 9 kk C040508	> 9 kk <= 10 kk C040509	> 10 kk <= 11 kk C040510	> 11 kk <= 12 kk C040511	> 1 v <= 2 v C050001	> 2 v <= 3 v C050002	> 3 v <= 4 v C050003	> 4 v <= 5 v C050004	> 5 v <= 7 v C150101	> 7 v <= 10 v C150301	> 10 v <= 15 v C16	> 15 v <= 20 v C17001	> 20 v C1702
			05	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260	270	280	290	300
05		Kaupankäyntivarastoon (Trading book) luettavien johdannaisten arvonmuutos korkojen noustessa 1%-yksikön	0																					
05	05	Saamistodistuksia (ilmoitettu lomakkeella R03) suojaavat johdannaiset																						
05	10	Muut kuin saamistodistuksia suojaavat johdannaiset																						
95		Rahoitustaseeseen (Banking book) luettavien johdannaisten arvonmuutos korkojen noustessa 1 %-yksikön	0																					
95	05	Saamistodistuksia (ilmoitettu lomakkeella R03) suojaavat johdannaiset																						
95	10	Muut kuin saamistodistuksia suojaavat johdannaiset																						

RAHOITUSTASEEN JOHDANNAISET

			Luokittelutekijät B krit	C krit	O	U	Yhteensä	> 0 <= 1 kk C040001	> 1 kk <= 2 kk C040501	> 2 kk <= 3 kk C040502	> 3 kk <= 4 kk C040503	> 4 kk <= 5 kk C040504	> 5 kk <= 6 kk C040505	> 6 kk <= 7 kk C040506	> 7 kk <= 8 kk C040507	> 8 kk <= 9 kk C040508	> 9 kk <= 10 kk C040509	> 10 kk <= 11 kk C040510	> 11 kk <= 12 kk C040511	> 1 v <= 2 v C050001	> 2 v <= 3 v C050002	> 3 v <= 4 v C050003	> 4 v <= 5 v C050004	> 5 v <= 7 v C150101	> 7 v <= 10 v C150301	> 10 v <= 15 v C16	> 15 v <= 20 v C17001	> 20 v C1702
		Korkojohdannaiset					05	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260	270	280	290	300
		FRA sopimukset																										
100	05	Ostot	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904	U060401	0																					
100	10	Myynnit	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904	U060404	0																					
		Futuurit																										
110	05	Ostot	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904	U060402 U060403	0																					
110	10	Myynnit	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904	U060405 U060406	0																					
		Koronvaihtosopimukset																										
120	05	Pääomasaaminen	Kr01 Kr05	Kr03	0904	U070101	0																					
120	10	Pääomavelka	Kr01 Kr05	Kr03	0904	U070102	0																					
		Ostetut optiot																										
130	05	Call ja Cap	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907	U080501	0																					
130	10	Put ja Floor	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907	U080701	0																					
		Asetetut optiot																										
140	05	Call ja Cap	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907	U080502	0																					
140	10	Put ja Floor	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907	U080702	0																					
		Valuuttajohdannaiset																										
		Termiinit																										
150	05	Ostot	Kr01 Kr05	Kr02	0904	U060101	0																					
150	10	Myynnit	Kr01 Kr05	Kr02	0904	U060103	0																					
		Futuurit																										
160	05	Ostot	Kr01 Kr05	Kr02	0904	U060201	0																					
160	10	Myynnit	Kr01 Kr05	Kr02	0904	U060203	0																					
		Koron ja -valuutanvaihtosopimukset																										
170	05	Pääomasaaminen	Kr01 Kr05	Kr03	0904	U070201	0																					
170	10	Pääomavelka	Kr01 Kr05	Kr03	0904	U070202	0																					

MUUT TASEEN ULKOPUOLISET SITOUMUKSET

			Yhteensä	> 0 <= 1 kk C040001	> 1 kk <= 2 kk C040501	> 2 kk <= 3 kk C040502	> 3 kk <= 4 kk C040503	> 4 kk <= 5 kk C040504	> 5 kk <= 6 kk C040505	> 6 kk <= 7 kk C040506	> 7 kk <= 8 kk C040507	> 8 kk <= 9 kk C040508	> 9 kk <= 10 kk C040509	> 10 kk <= 11 kk C040510	> 11 kk <= 12 kk C040511	> 1 v <= 2 v C050001	> 2 v <= 3 v C050002	> 3 v <= 4 v C050003	> 4 v <= 5 v C050004	> 5 v <= 7 v C150101	> 7 v <= 10 v C150301	> 10 v <= 15 v C16	> 15 v <= 20 v C17001	> 20 v C1702
			05	100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260	270	280	290	300
		ASIAKKAAN HYVÄKSI ANNETUT PERUUTTAMATTOMAT SITOUMUKSET																						
180		Talletuksentekosopimukset, joissa luottolaitos on sitoutunut tekemään talletuksen	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0906	U0204	0																					
		LUOTTOLAITOKSEN PUOLESTA TAI SEN HYVÄKSI ANNETUT SITOUMUKSET																										
190		Talletuksentekosopimukset, joissa luottolaitos on sitoutunut ottamaan vastaan talletuksen	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0906	U0403	0																					

FINANSSIVALVONTA

#REF!

Annettu	
Korvaa	
Voimassa	

KORKORISKI: NYKYARVOMENETELMÄ

#REF!

R10

Määräykset ja ohjeet: 1/2014

Tiedonantajatasot: 201, 284

Frekvenssi: Neljännesvuosittain

Vastaustarkkuus: 1000 EUR

Palautusviive: 20 pankkipäivää

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain

Valuutta: #REF!

Luvut tuhansina euroina

Rivinro		Muutos korkopistettä					
		-200	-100	-50	50	100	200
		05	10	15	20	25	30
05	Valvottavan omalla nykyarvomenetelmällä laskettu korkoriski						
20	Standardimenetelmällä laskettuna						

FINANSSIVALVONTA

#REF!

Annettu
Korvaa
Voimassa

KORKORISKI

#REF!

R18

Määräykset ja ohjeet: 1/2014

Tiedonantajatasot: 201, 284

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautusviive: 20 pankkipäivää

PANKIN OMALLA MENETELMÄLLÄ LASKETTU TULORISKI

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain

Valuutta: #REF!

Rivinro			Muutos korkopistettä					
			-200	-100	-50	50	100	200
			100	110	120	130	140	150
100		Valvottavan omalla menetelmällä laskettu tuloriski	0	0	0	0	0	0
100	05	Valvottavan omalla menetelmällä laskettu tuloriski ilman johdannaisten vaikutusta						
100	10	Valvottavan omalla menetelmällä laskettu johdannaisten aiheuttama tuloriski						