

Tuloriski

Frekvenssi:

Vastaustarkkuus:

Palautusviive:

Määrittelyistä vastaa:

Tiedot toimitetaan:

Tiedonantajatasot:

Neljännesvuosittain

1 000 euroa

20 pankkipäivää

Finanssivalvonta

Finanssivalvonta

201, 204, 210, 260

R01

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain

Valuutta:

EUR

Luvut tuhansina euroina

Rivino

Tno

100

0

Valvottavan omalla menetelmällä
laskettu tuloriski

Muutos korkopistettä

-200	-100	-50	50	100	200
100	110	120	130	140	150

--	--	--	--	--	--

KORKORISKI SAAMISTODISTUSTEN ARVONMUUTOS

####

Frekvenssi:	Neljännesvuosittain	R03
Vastaustarkkuus:	1 000 euroa	
Palautusviive:	20 pankkipäivää	Raportoitava ajankohta
Määrittelyistä vastaa:	Finanssivalvonta	#REF!
Tiedot toimitetaan:	Finanssivalvonta	
Tiedonantajatasot:	201, 204, 210, 260	

*Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain
5 kk < t < 6 kk*

Valuutta:	EUR	#RE ▼	Arvo
Rivino	Tno		05

05	2	Kaupankäyntivarastossa (Trading book) pidettävien saamistodistusten arvonmuutos korkojen noustessa 1 %-yksikön	
----	---	--	--

95	1	Rahoitustaseessa (Banking book) pidettävien saamistodistusten arvonmuutos korkojen noustessa 1 %-yksikön	
----	---	--	--

KORKORISKI

####

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Vastustarkkuus: 1 000 euroa
Palautusviive: 20 pankkipäivää
Määrittelyistä vastaa: Finanssivalvonta
Tiedot toimitetaan: Finanssivalvonta
Tiedonantajatasot: 201, 204, 210, 260

TASEEN VASTAAVAA

R05

Raportoitava ajankohta #REF!

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain

Valuutta: EUR #REF!

Table with columns for Rivino, Viittaukset, Finrep, C krit, and various maturity periods (> 0, > 1 kk, etc.) and a final column for Eräntyneet ja järjestämättömät.

KORKORISKI

JOHDANNAISET

#REF!

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: 1 000 euroa
 Palautusviive: 20 pankkipäivää
 Määrittelyistä vastaa: Finanssivalvonta
 Tiedot toimitetaan: Finanssivalvonta
 Tiedonantajataso: 201, 204, 210, 260

R08

Raportoitava ajankohta

#REF!

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valutoittain
 5 kk < t < 6 kk

Valuutta: EUR #REF!

Rivino Tno

05	7	Kaupankäyntivarastoon (Trading book) luettavien johdannaisten arvonmuutos korkojen noustessa 1%-yksikön
0505	1	Saamistodistuksia (ilmoitettu lomakkeella R03) suojaavat johdannaiset
0510	9	Muut kuin saamistodistuksia suojaavat johdannaiset

Arvo
05

0

95	6	Rahoitustaseeseen (Banking book) luettavien johdannaisten arvonmuutos korkojen noustessa 1%-yksikön
9505	0	Saamistodistuksia (ilmoitettu lomakkeella R03) suojaavat johdannaiset
9510	8	Muut kuin saamistodistuksia suojaavat johdannaiset

0

RAHOITUSTASEEN JOHDANNAISET			Luokittelukäytäjät		
	B	C	O		
100					
10005					
1000505					
1000510					
10010					
1001005					
111010					
10015					
1001505					
1001510					
10020					
1002005					
1002010					
1002015					
1102020					
10025					
1002505					
1002510					
1002515					
1002520					
110					
11005					
1100505					
1100510					
11010					
1101005					
1101010					
11015					
1101505					
1101510					
11020					
1102005					
1102010					
11025					
1102505					
1102510					

Yhteensä	> 0 < 1 kk	> 1 kk < 2 kk	> 2 kk < 3 kk	> 3 kk < 4 kk	> 4 kk < 5 kk	> 5 kk < 6 kk	> 6 kk < 7 kk	> 7 kk < 8 kk	> 8 kk < 9 kk	> 9 kk < 10 kk	> 10 kk < 11 kk	> 11 kk < 12 kk	> 12 kk < 15 kk	> 15 kk < 18 kk	> 18 kk < 21 kk	> 21 kk < 24 kk	> 24 kk < 30 kk	> 30 kk < 36 kk	> 3 v < 4 v	> 4 v < 5 v	> 5 v < 7 v	> 7 v < 10 v	> 10 v < 15 v	> 15 v < 20 v	> 20 v	Kotimaiset	Ulkomaiset
	C040001																										
100	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260	270	280	290	300	310	320	330	340	360	370	

MUUT TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKSET		
120		
12005		
130		
13005		

Yhteensä	> 0 < 1 kk	> 1 kk < 2 kk	> 2 kk < 3 kk	> 3 kk < 4 kk	> 4 kk < 5 kk	> 5 kk < 6 kk	> 6 kk < 7 kk	> 7 kk < 8 kk	> 8 kk < 9 kk	> 9 kk < 10 kk	> 10 kk < 11 kk	> 11 kk < 12 kk	> 12 kk < 15 kk	> 15 kk < 18 kk	> 18 kk < 21 kk	> 21 kk < 24 kk	> 24 kk < 30 kk	> 30 kk < 36 kk	> 3 v < 4 v	> 4 v < 5 v	> 5 v < 7 v	> 7 v < 10 v	> 10 v < 15 v	> 15 v < 20 v	> 20 v	Kotimaiset	Ulkomaiset
120	110	120	130	140	150	160	170	180	190	200	210	220	230	240	250	260	270	280	290	300	310	320	330	340	360	370	

KORKORISKI: NYKYARVOMENETELMÄ

#REF!

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1 000 euroa
Palautusviive: 20 pankkipäivää
Määrittelyistä vastaa: Finanssivalvonta
Tiedot toimitetaan: Finanssivalvonta
Tiedonantajatasot: 201, 204, 210, 260

R10

Raportoitava
 ajankohta
 #REF!

Tiedonantajatasot ilmoittavat sekä euro- että muut kuin euromääräiset erät valuutoittain
 5 kk < t < 6 kk

Valuutta: EUR #REF! ▼

Luvut tuhansina euroina

Rivino Tno

05	1
20	0

Valvottavan omalla nykyarvomenetelmällä laskettu korkoriski

Standardimenetelmällä laskettuna

Muutos korkopistettä					
-200	-100	-50	50	100	200
05	10	15	20	25	30



KORKORISKI: NYKYARVOMENETELMÄ

Painokertoimet maturiteettiluokille:

	t:n keskiarvo vuosina	Modified duration	Tuottokäyrän oletettu muutos *	Painokerroin korkopisteinä
0 kk < t < 1 kk			200	0.00
1 kk < t < 2 kk			200	0.00
2 kk < t < 3 kk			200	0.00
3 kk < t < 4 kk			200	0.00
4 kk < t < 5 kk			200	0.00
5 kk < t < 6 kk			200	0.00
6 kk < t < 7 kk			200	0.00
7 kk < t < 8 kk			200	0.00
8 kk < t < 9 kk			200	0.00
9 kk < t < 10 kk			200	0.00
10 kk < t < 11 kk			200	0.00
11 kk < t < 12 kk			200	0.00
12 kk < t < 15 kk			200	0.00
15 kk < t < 18 kk			200	0.00
18 kk < t < 21 kk			200	0.00
21 kk < t < 24 kk			200	0.00
24 kk < t < 30 kk			200	0.00
30 kk < t < 36 kk			200	0.00
3 v < t < 4 v			200	0.00
4 v < t < 5 v			200	0.00
5 v < t < 7 v			200	0.00
7 v < t < 10 v			200	0.00
10 v < t < 15 v			200	0.00
15 v < t < 20 v			200	0.00
t > 20 v			200	0.00

* Tuottokäyrän oletettua muutosta muuttamalla voidaan laskea painokertoimet myös muille kuin korkokäyrän paralleelille 200 korkopisteen nousulle.