

OHJE VALUUTTAKURSSIRISKEILLE  
ASETETTAVISTA RAJOISTA

Ohje 105.9 / Dnro 2/311/99

1 (5)

## VALUUTTAMÄÄRÄISTÄ TOIMINTAA HARJOITTAVA LUOTTOLAITOS

SUOMEN PANKIN VALUUTTAINTERVENTIOIDEN VASTAPUOLEKSI HYVÄKSYMÄ  
ETA-VALTIOSSA TOIMILUVAN SAANEEN LUOTTOLAITOKSEN SIVUKONTTORI

## KUUKAUSIRAPORTTI

Raportoiva luottolaitos	
Osoite	
Yhteyshenkilö Puhelinnumero	
Päiväys Raportin laatijan allekirjoitus	

**Tiedon päivämäärä**

Lomake laaditaan erillisiä täyttöohjeita ja konekielisen tiedonvälityksen ohjeita noudattaen ja toimitetaan Rahoitustarkastukseen raportointikuukautta seuraavan kalenterikuukauden viidentenä pankkipäivänä.

Palautusosoite:

RAHOITUSTARKASTUS  
Luottolaitososasto  
PL 159

00101 HELSINKI

TELEFAX (09) 183 5209

**FX2 VALUUTTAPOSITIO**

RAPORTOINTIVALUUTTA ( EUR / FIM ) \_\_\_\_\_

<b>LUOTTOLAITOS (ILMAN ULKOMAISIA SIVUKONTTOREITA), 1 000 euroa / 1000 markkaa</b>						
Valuutta	Netto avistapositio	Netto termiinipositio	Netto futuuripositio	Valuutoittaiset nettopositiot	Rakennepositio	Valuutoittainen nettopositio ilman optioita
	1	2	3	4 (1 + 2 + 3)	5	6 (4 - 5)
480 USD Yhdysvaltain dollari						
481 GBP Englannin punta						
482 SEK Ruotsin kruunu						
483 NOK Norjan kruunu						
484 DKK Tanskan kruunu						
488 CHF Sveitsin frangi						
491 JPY Japanin jeni						
495						
496						
497						
Muut valuutat joita ei ole erikseen eritelty edellä	498 pitkä 499 lyhyt					

**FX2 VALUUTTAPOSITIO**

<b>LUOTTOLAITOS (ILMAN ULKOMAISIA SIVUKONTTOREITA), 1 000 euroa / 1000 markkaa</b>							
Valuutta	Valuutoittainen nettopositio ilman optiota	7 Asetetut optiot		8 Ostetut optiot		Delta-painotetut valuuttaoptio-sopimukset	Valuutoittainen nettopositio mukaan lukien optiot
		Potentiaaliset ostot (put-optiot)	Potentiaaliset myynnit (call-optiot)	Potentiaaliset ostot (call-optiot)	Potentiaaliset myynnit (put-optiot)		
	6 (4 - 5)	7.1	7.2	8.1	8.2	9	10 (6 + 9)
480 USD Yhdysvaltain dollari							
481 GBP Englannin punta							
482 SEK Ruotsin kruunu							
483 NOK Norjan kruunu							
484 DKK Tanskan kruunu							
488 CHF Sveitsin frangi							
491 JPY Japanin jeni							
495							
496							
497							
Muut valuutat joita ei ole erikseen eritelty edellä	498 pitkä 499 lyhyt						
Euro-optiot							

400 PITKÄT VALUUTOITTAISET NETTOPOSITIOT YHTEENSÄ (sarake 10)	
401 LYHYET VALUUTOITTAISET NETTOPOSITIOT YHTEENSÄ (sarake 10)	
403 KOKONAISNETTOVALUUTTAPOSITIO (itseisarvoltaan suurempi riveistä 400 tai 401)	



**FX2 VALUUTTAPOSITIO**

<b>LUOTTOLAITOKSEN ULKOMAINEN SIVUKONTTORI, 1 000 euroa / 1000 markkaa</b>							
Valuutta	Netto avistapositio	7 Asetetut optiot		8 Ostetut optiot		Delta-painotetut valuuttaoptio-sopimukset	Ulkomaisen sivukonttorin valuutoittainen netto-positio mukaan lukien optiot
		Potentiaaliset ostot (put optiot)	Potentiaaliset myynnit (call optiot)	Potentiaaliset ostot (call optiot)	Potentiaaliset myynnit (put optiot)		
	4 (1+2+3)	7.1	7.2	8.1	8.2	9	10 (4+9)
501 USD Yhdysvaltain dollari							
502 GBP Englannin punta							
503 SEK Ruotsin kruunu							
504 NOK Norjan kruunu							
505 DKK Tanskan kruunu							
509 CHF Sveitsin frangi							
512 JPY Japanin jeni							
516							
517							
518							
Muut valuutat joita ei ole erikseen eritelty edellä	519 pitkä 520 lyhyt						
Euro-optiot							

400 PITKÄT VALUUTOITTAISET NETTOPOSITIOT YHTEENSÄ (sarake 10)	
401 LYHYET VALUUTOITTAISET NETTOPOSITIOT YHTEENSÄ (sarake 10)	
403 KOKONAISNETTOVALUUTTAPOSITIO (itseisarvoltaan suurempi riveistä 400 tai 401)	