

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z01

Raportoitava ajankohta

/

Korkosopimusten erityisriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Kokonaismäärä	Kerroin %	Omien varojen vaatimus
05		10

Rivino	tno	vno	
05		8	1.6/1.12 Korkosopimusten erityisriskin omien varojen vaatimus yhteensä
05	05	3	1.1/1.7 Keskushallinnon erät
05	10	0	1.2/1.8 Alhaisen riskin erät; jäljellä oleva juoksuaika enintään 6 kuukautta
05	15	5	1.3/1.9 Alhaisen riskin erät; jäljellä oleva juoksuaika yli 6 kuukautta, enintään 24 kuukautta
05	20	2	1.4/1.10 Alhaisen riskin erät; jäljellä oleva juoksuaika yli 24 kuukautta
05	25	7	1.5/1.11 Muut erät

0		0
	0,00 %	
	0,25 %	0
	1,00 %	0
	1,60 %	0
	8,00 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z02a

Raportoitava
ajankohta

/

Korkosopimusten yleisriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Valuutta : Valitse

Pitkien nettopositioiden markkina-arvo	Lyhyiden nettopositioiden markkina-arvo	Kerroin %	Painotetut pitkät nettopositiot	Painotetut lyhyet nettopositiot	Nettoutettu positio	Nettouttamatta jäänyt pitkä positio	Nettouttamatta jäänyt lyhyt positio	Omien varojen vaatimuserroin %	Omien varojen vaatimus
05	10		15	20	25	30	35		40

A Maturiteettipohjainen laskentatapa

Rivino	tno	vno									
05		4	36	Omien varojen vaatimus yhteensä	0	0				0	
				Alue 1							
05	05	5	26/23/27	Maturiteettiluokittain nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot yhteensä	0	0	0	0	0	10 %	0
05	05	6		Maturiteettiluokka 1		0,00 %					
05	05	6		Maturiteettiluokka 2		0,20 %	0	0	0		
05	05	7		Maturiteettiluokka 3		0,40 %	0	0	0		
05	05	7		Maturiteettiluokka 4		0,70 %	0	0	0		
				Alue 2							
05	10	5	26/24/27	Maturiteettiluokittain nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot yhteensä	0	0	0	0	0	10 %	0
05	10	6		Maturiteettiluokka 5		1,25 %	0	0	0		
05	10	6		Maturiteettiluokka 6		1,75 %	0	0	0		
05	10	7		Maturiteettiluokka 7		2,25 %	0	0	0		
				Alue 3							
05	15	6	26/25/27	Maturiteettiluokittain nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot yhteensä	0	0	0	0	0	10 %	0
05	15	7		Maturiteettiluokka 8		2,75 %	0	0	0		
05	15	7		Maturiteettiluokka 9		3,25 %	0	0	0		
05	15	8		Maturiteettiluokka 10		3,75 %	0	0	0		
05	15	8		Maturiteettiluokka 11		4,50 %	0	0	0		
05	15	9		Maturiteettiluokka 12		5,25 %	0	0	0		
05	15	9		Maturiteettiluokka 13		6,00 %	0	0	0		
05	15	0		Maturiteettiluokka 14		8,00 %	0	0	0		
05	15	0		Maturiteettiluokka 15		12,50 %	0	0	0		
05	20	6	28	Alueen 1 nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot	0	0	0	0	0	40 %	0
05	25	7		Alueen 2 nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot	0	0	0	0	0	30 %	0
05	30	7	30	Alueen 3 nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot	0	0	0	0	0	30 %	0
05	35	8	31	Alueiden 1 ja 2 välillä nettoutetut positiot	0					40 %	0
05	35	9		Alueen 1 nettouttamatta jäänyt		0	0				
05	35	9		Alueen 2 nettouttamatta jäänyt		0	0				
05	40	8	32	Alueiden 2 ja 3 välillä nettoutetut positiot	0					40 %	0
05	40	9		Alueen 2 nettouttamatta jäänyt		0	0				
05	40	9		Alueen 3 nettouttamatta jäänyt		0	0				
05	45	9	33	Alueiden 1 ja 3 välillä nettoutetut positiot	0					150 %	0
05	45	0		Alueen 1 nettouttamatta jäänyt		0	0				
05	45	0		Alueen 3 nettouttamatta jäänyt		0	0				
05	50	9	34	Nettouttamatta jääneet positiot		0	0			100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z02b

Raportoitava
ajankohta

/

Korkosopimusten yleisriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Valuutta : Valitse

B Duraatiopohjainen laskentatapa

Rivino	tno	vno	
05	5	47	Omien varojen vaatimus yhteensä
05 10	6	37/40	Alueen 1 nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot
05 15	7	38/41	Alueen 2 nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot
05 20	7	39/42	Alueen 3 nettoutetut ja nettouttamatta jääneet positiot
05 25	8	43	Alueiden 1 ja 2 välillä nettoutetut positiot
05 25 05	9		Alueen 1 nettouttamatta jäänyt
05 25 10	9		Alueen 2 nettouttamatta jäänyt
05 30	8	44	Alueiden 2 ja 3 välillä nettoutetut positiot
05 30 05	9		Alueen 2 nettouttamatta jäänyt
05 30 10	9		Alueen 3 nettouttamatta jäänyt
05 35	9	45	Alueiden 1 ja 3 välillä nettoutetut positiot
05 35 05	0		Alueen 1 nettouttamatta jäänyt
05 35 10	0		Alueen 3 nettouttamatta jäänyt
05 40	9	46	Nettouttamatta jääneet positiot

Pitkien nettopositoiden duraatiolla kerrottu markkina-arvo	Lyhyiden nettopositoiden duraatiolla kerrottu markkina-arvo	Kerroin %	Painotetut pitkät nettopositiot	Painotetut lyhyet nettopositiot	Nettoutettu positio	Nettouttamatta jäänyt pitkä positio	Nettouttamatta jäänyt lyhyt positio	Omien varojen vaatimuserroin %	Omien varojen vaatimus
05	10		15	20	25	30	35		40

									0
		1,00 %	0	0	0	0	0	2 %	0
		0,85 %	0	0	0	0	0	2 %	0
		0,70 %	0	0	0	0	0	2 %	0
					0			40 %	0
						0	0		
					0			40 %	0
						0	0		
					0			150 %	0
						0	0		
						0	0		
						0	0	100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z03

Raportoitava
ajankohta

/

Korkosopimusten positioriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 205, 214, 244, 260, 264
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti- tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	05

Rivino tno vno **Korkosopimusten positioriskin omien varojen vaatimus yhteensä**

05				0	553
----	--	--	--	---	-----

0

Korkosopimusten erityisriskin omien varojen vaatimus yhteensä

05	05			5	550
05	05	05		0	

0

Korkosopimusten yleisriskin omien varojen vaatimus yhteensä maturiteettipohjaista laskentatapaa käytettäessä

05	10			2	551
05	10	05		7	

0

Korkosopimusten yleisriskin omien varojen vaatimus yhteensä duraatiopohjaista laskentatapaa käytettäessä

05	15			7	552
05	15	05		2	

0

Tunnuksen tyyppin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunnus
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z04

Raportoitava ajankohta

/

Osakkeiden positioriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Pitkät nettopositiot	Lyhyet nettopositiot	Brutto- kokonaispositio	Netto- kokonaispositio	Kerroin %	Omien varojen vaatimus
05	10	15	20		25

Rivino	tno	vno	
05	1	78	Osakkeiden positioriskin omien varojen vaatimus yhteensä
05 05	6	88	Osakkeiden erityisriskin omien varojen vaatimus
05 05 05	1	82	Positiot, joiden kerroin on 0%
05 05 10	8	83	Positiot, joiden kerroin on 2%
05 05 15	3	84	Positiot, joiden kerroin on 4%
05 10	3	93	Osakkeiden yleisriskin omien varojen vaatimus

					0
					0
		0		0 %	0
		0		2 %	0
		0		4 %	0
			0	8 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z05

 Raportoitava
ajankohta

/

Osakkeiden positioriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 205, 214, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti-tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	
			05

 Rivino tno vno **Osakkeiden positioriskin omien varojen vaatimus yhteensä**

05				2	563
----	--	--	--	---	-----

0

Osakkeiden erityisriskin omien varojen vaatimus yhteensä

05	05			7	561
05	05	05		2	

0

Osakkeiden yleisriskin omien varojen vaatimus yhteensä

05	10			4	562
05	10	05		9	

0

Tunnuksen tyyppin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunnus
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z06

Raportoitava
ajankohta

/

Merkintäsitoumusten nettopositio

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Sitoumusten merkintäarvo	Kerroin %	Merkintäsitoumusten nettopositio
05		10

Rivino	tno	vno
05	3	112
05 05	8	107
05 10	5	108
05 15	0	109
05 20	7	110
05 25	2	111
05 30	9	

Korkosopimusten merkintäsitoumukset yhteensä

merkintäsitoumuksen voimaantulopäivänä
 1 pankkipäivän voimassa olleet sitoumukset
 2-3 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset
 4 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset
 5 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset
 yli 5 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset

0		0
	100 %	0
	90 %	0
	75 %	0
	50 %	0
	25 %	0
	0 %	

Rivino	tno	vno
10	0	119
10 05	5	114
10 10	2	115
10 15	7	116
10 20	4	117
10 25	9	118
10 30	6	

Osakkeiden merkintäsitoumukset yhteensä

merkintäsitoumuksen voimaantulopäivänä
 1 pankkipäivän voimassa olleet sitoumukset
 2-3 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset
 4 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset
 5 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset
 yli 5 pankkipäivää voimassa olleet sitoumukset

0		0
	100 %	0
	90 %	0
	75 %	0
	50 %	0
	25 %	0
	0 %	

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z07a

Raportoitava ajankohta

/

Arvopaperien ja hyödykkeiden selvitysriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Menetelmä A

Hintaero	Kerroin %	Omien varojen vaatimus
05		10

Rivino	tno	vno	
05		9	134 Arvopaperien ja hyödykkeiden selvitysriskin omien varojen vaatimus yhteensä
05	05	0	122 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä 5 - 15 pankkipäivää
05	10	0	123 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä 16 - 30 pankkipäivää
05	15	1	124 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä 31 - 45 pankkipäivää
05	20	1	125 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä vähintään 46 pankkipäivää

		0
	8 %	0
	50 %	0
	75 %	0
	100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z07b

Raportoitava ajankohta

/

Arvopaperien ja hyödykkeiden selvitysriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Menetelmä B (Rahoitustarkastuksen luvalla)

Kauppahinta	Hintaero	Kerroin %	Omien varojen vaatimus
05	10		15

Rivino	tno	vno	
05		0	147 Arvopaperien ja hyödykkeiden selvitysriskin omien varojen vaatimus yhteensä
05	05	1	135 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä 5 - 15 pankkipäivää
05	10	1	136 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä 16 - 30 pankkipäivää
05	15	2	137 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä 31 - 45 pankkipäivää
05	20	2	138 Sovitun toimituspäivän jälkeen selvittämättä vähintään 46 pankkipäivää

			0
		0,5 %	0
		4,0 %	0
		9,0 %	0
		100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z07c

Raportoitava ajankohta

/

Arvopaperien ja hyödykkeiden selvitysriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 260
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 31.3, 20.5, 20.8, 20.11

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti- tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	05

Rivino tno vno **Arvopaperien ja hyödykkeiden selvitysriskin omien varojen vaatimus yhteensä**

05			2	160		0
05	05		3			

Tunnuksen tyyppin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunn
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z08

Raportoitava ajankohta

/

Vastapuoliriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Riskipainotettu arvo	Kerroin %	Omien varojen vaatimus
05		10

Rivino	tno	vno	
05		5	225 Vastapuoliriskin omien varojen vaatimus yhteensä
05	05	0	220 Luottokaupan riskipainotettu vastapuoliriski
05	10	7	221 Takaisinosto- ja myyntisopimuksia sekä arvopapereiden ja hyödykkeiden lainaamista koskeva riskipainotettu vastapuoliriski
05	15	2	222 Vakioimattomien johdannaissopimusten riskipainotettu vastapuoliriski
05	20	9	223 Muiden vastapuoliriskien riskipainotettu arvo

0	8 %	0
0		
0		
0		
0		

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z08b

Raportoitava
ajankohta

/

Vastapuoliriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 260
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 31.3, 20.5, 20.8, 20.11

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti- tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	05

Rivino tno vno **Vastapuoliriskin omien varojen vaatimus yhteensä**

05			1	250		0
05	05		2			

Tunnuksen tyyppin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunnus
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z09

Raportoitava ajankohta

/

Luottokaupan riskipainotettu vastapuoliriski

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Markkina-arvo/ maksun määrä	Riskipaino %	Riskipainotettu arvo
05		10

Rivino	tno	vno	
05		6	233 Luottokaupan riskipainotettu vastapuoliriski yhteensä
05	05	1	230 Ryhmä I (riskipaino 0%)
05	10	8	231 Ryhmä II (riskipaino 20%)
05	15	3	232 Ryhmä IV (riskipaino 100%)

		0
	0 %	
	20 %	0
	100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z10

 Raportoitava
ajankohta

/

Takaisinosto- ja myyntisopimusten sekä arvopapereiden ja hyödykkeiden lainaamisen riskipainotettu vastapuoliriski

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Arvopaperin tai hyödykkeen markkina-arvo	Vakuuden markkina-arvo tai velan määrä	Hintaero	Riskipaino %	Riskipainotettu arvo
05	10	15		20

Rivino	tno	vno	
05		9	238 Takaisinostosopimusten sekä arvopapereiden ja hyödykkeiden lainaksi antamisen riskipainotettu vastapuoliriski yhteensä
05	05	4	235 Ryhmä I (riskipaino 0%)
05	10	1	236 Ryhmä II (riskipaino 20%)
05	15	6	237 Ryhmä IV (riskipaino 100%)

				0
		0	0 %	0
		0	20 %	0
		0	100 %	0

Rivino	tno	vno	
10		6	238 Takaisinmyyntisopimusten sekä arvopapereiden ja hyödykkeiden lainaksi ottamisen riskipainotettu vastapuoliriski yhteensä
10	05	1	235 Ryhmä I (riskipaino 0%)
10	10	8	236 Ryhmä II (riskipaino 20%)
10	15	3	237 Ryhmä IV (riskipaino 100%)

				0
		0	0 %	0
		0	20 %	0
		0	100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z11b

Raportoitava
ajankohta

/

Vakioimattomien johdannaissopimusten riskipainotettu vastapuoliriski

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

B Käyvän arvon menetelmä

Jälleenhankinta- kustannus	Nimellis- arvo	Kerroin %	Tulevaisuuden luottoriski	Luottovasta- arvo	Riski- paino %	Riskipainotettu arvo
05	10		15	20		25

Rivino	Tno	Vno
05	6	42

Johdannaissopimukset yhteensä

0	0		0	0		0
---	---	--	---	---	--	---

05	03	2
----	----	---

Netotettujen johdannaissopimusten arvo yhteensä

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

05	05	7
----	----	---

Korkosidonnaiset sopimukset yhteensä

0	0		0	0		0
---	---	--	---	---	--	---

05	05	05	8
----	----	----	---

421 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 0%

		0 %		0	0 %	
--	--	-----	--	---	-----	--

05	05	10	8
----	----	----	---

422 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 20%

		0 %		0	20 %	0
--	--	-----	--	---	------	---

05	05	15	9
----	----	----	---

423 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 50%

		0 %		0	50 %	0
--	--	-----	--	---	------	---

05	05	20	9
----	----	----	---

424 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 100%

		0 %		0	100 %	0
--	--	-----	--	---	-------	---

05	05	25	0
----	----	----	---

425 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 0%

		0,5 %	0	0	0 %	
--	--	-------	---	---	-----	--

05	05	30	0
----	----	----	---

426 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 20%

		0,5 %	0	0	20 %	0
--	--	-------	---	---	------	---

05	05	35	1
----	----	----	---

427 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 50%

		0,5 %	0	0	50 %	0
--	--	-------	---	---	------	---

05	05	40	1
----	----	----	---

428 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 100%

		0,5 %	0	0	100 %	0
--	--	-------	---	---	-------	---

05	05	45	2
----	----	----	---

Jäljellä oleva juoksuaika t > 5, riskipaino 0%

		1,5 %	0	0	0 %	
--	--	-------	---	---	-----	--

05	05	50	2
----	----	----	---

Jäljellä oleva juoksuaika t > 5, riskipaino 20%

		1,5 %	0	0	20 %	0
--	--	-------	---	---	------	---

05	05	55	3
----	----	----	---

Jäljellä oleva juoksuaika t > 5, riskipaino 50%

		1,5 %	0	0	50 %	0
--	--	-------	---	---	------	---

05	05	60	3
----	----	----	---

Jäljellä oleva juoksuaika t > 5, riskipaino 100%

		1,5 %	0	0	100 %	0
--	--	-------	---	---	-------	---

05	10	7
----	----	---

Valuuttakurssi- ja kultasidonnaiset sopimukset yhteensä

0	0		0	0		0
---	---	--	---	---	--	---

05	10	05	8
----	----	----	---

430 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 0%

		1 %	0	0	0 %	
--	--	-----	---	---	-----	--

05	10	10	8
----	----	----	---

431 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 20%

		1 %	0	0	20 %	0
--	--	-----	---	---	------	---

05	10	15	9
----	----	----	---

432 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 50%

		1 %	0	0	50 %	0
--	--	-----	---	---	------	---

05	10	20	9
----	----	----	---

433 Jäljellä oleva juoksuaika t ≤ 1, riskipaino 100%

		1 %	0	0	100 %	0
--	--	-----	---	---	-------	---

05	10	25	0
----	----	----	---

434 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 0%

		5 %	0	0	0 %	
--	--	-----	---	---	-----	--

05	10	30	0
----	----	----	---

435 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 20%

		5 %	0	0	20 %	0
--	--	-----	---	---	------	---

05	10	35	1
----	----	----	---

436 Jäljellä oleva juoksuaika 1 < t ≤ 5, riskipaino 50%

		5 %	0	0	50 %	0
--	--	-----	---	---	------	---

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z11b

Raportoitava
ajankohta

/

Vakioimattomien johdannaissopimusten riskipainotettu vastapuoliriski

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

B Käyvän arvon menetelmä

05	10	40	1	437	Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 100%
05	10	45	2		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 0%
05	10	50	2		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 20%
05	10	55	3		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 50%
05	10	60	3		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 100%

05	15		8		Osakesidonnaiset sopimukset yhteensä
05	15	05	9		Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 0%
05	15	10	9		Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 20%
05	15	15	0		Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 50%
05	15	20	0		Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 100%
05	15	25	1		Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 0%
05	15	30	1		Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 20%
05	15	35	2		Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 50%
05	15	40	2		Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 100%
05	15	45	3		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 0%
05	15	50	3		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 20%
05	15	55	4		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 50%
05	15	60	4		Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 100%

05	20		8		Jalometalleja ja muita hyödykkeitä koskevat sopimukset yhteensä
----	----	--	---	--	--

05	20	05	9		Jalometalleja koskevat sopimukset yhteensä
05	20	05	05	0	Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 0%
05	20	05	10	0	Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 20%
05	20	05	15	1	Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 50%
05	20	05	20	1	Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 100%
05	20	05	25	2	Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 0%
05	20	05	30	2	Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 20%

Jälleenhankinta- kustannus	Nimellis- arvo	Kerroin %	Tulevaisuuden luottoriski	Luottovasta- arvo	Riski- paino %	Riskipainotettu arvo
05	10		15	20		25

		5 %	0	0	100 %	0
		7,5 %	0	0	0 %	
		7,5 %	0	0	20 %	0
		7,5 %	0	0	50 %	0
		7,5 %	0	0	100 %	0

0	0		0	0		0
		6 %	0	0	0 %	
		6 %	0	0	20 %	0
		6 %	0	0	50 %	0
		6 %	0	0	100 %	0
		8 %	0	0	0 %	
		8 %	0	0	20 %	0
		8 %	0	0	50 %	0
		8 %	0	0	100 %	0
		10 %	0	0	0 %	
		10 %	0	0	20 %	0
		10 %	0	0	50 %	0
		10 %	0	0	100 %	0

0	0		0	0		0
---	---	--	---	---	--	---

0	0		0	0		0
		7 %	0	0	0 %	
		7 %	0	0	20 %	0
		7 %	0	0	50 %	0
		7 %	0	0	100 %	0
		7 %	0	0	0 %	
		7 %	0	0	20 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z11b

 Raportoitava
ajankohta

/

Vakioimattomien johdannaissopimusten riskipainotettu vastapuoliriski

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

B Käyvän arvon menetelmä

05	20	05	35	3
05	20	05	40	3
05	20	05	45	4
05	20	05	50	4
05	20	05	55	5
05	20	05	60	5

Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 50%
 Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 100%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 0%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 20%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 50%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 100%

05	20	10		9
05	20	10	05	0
05	20	10	10	0
05	20	10	15	1
05	20	10	20	1
05	20	10	25	2
05	20	10	30	2
05	20	10	35	3
05	20	10	40	3
05	20	10	45	4
05	20	10	50	4
05	20	10	55	5
05	20	10	60	5

Muita hyödykkeitä koskevat sopimukset yhteensä
 Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 0%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 20%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 50%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t \leq 1$, riskipaino 100%
 Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 0%
 Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 20%
 Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 50%
 Jäljellä oleva juoksuaika $1 < t \leq 5$, riskipaino 100%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 0%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 20%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 50%
 Jäljellä oleva juoksuaika $t > 5$, riskipaino 100%

Jälleenhankinta- kustannus	Nimellis- arvo	Kerroin %	Tulevaisuuden luottoriski	Luottovasta- arvo	Riski- paino %	Riskipainotettu arvo
05	10		15	20		25

		7 %	0	0	50 %	0
		7 %	0	0	100 %	0
		8 %	0	0	0 %	
		8 %	0	0	20 %	0
		8 %	0	0	50 %	0
		8 %	0	0	100 %	0

0	0		0	0		0
		10 %	0	0	0 %	
		10 %	0	0	20 %	0
		10 %	0	0	50 %	0
		10 %	0	0	100 %	0
		12 %	0	0	0 %	
		12 %	0	0	20 %	0
		12 %	0	0	50 %	0
		12 %	0	0	100 %	0
		15 %	0	0	0 %	
		15 %	0	0	20 %	0
		15 %	0	0	50 %	0
		15 %	0	0	100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z12

 Raportoitava
ajankohta

/

Muiden vastapuoliriskien riskipainotettu arvo

Tiedonantajatasot: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Kirjanpito- arvo	Riskipaino %	Riskipainotettu arvo
05		10

Rivino	tno	vno	
05		1	249 Muiden vastapuoliriskien riskipainotettu arvo yhteensä
Palkkio-, komissio-, osinko- ja korkosaamiset			
05	05	6	240 Ryhmä I (riskipaino 0%)
05	10	3	241 Ryhmä II (riskipaino 20%)
05	15	8	242 Ryhmä IV (riskipaino 100%)
Muut vastaavat saamiset			
05	35	2	246 Ryhmä I (riskipaino 0%)
05	40	9	247 Ryhmä II (riskipaino 20%)
05	45	4	248 Ryhmä IV (riskipaino 100%)

	0
--	---

	0 %	
	20 %	0
	100 %	0

	0 %	
	20 %	0
	100 %	0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z13a

Raportoitava ajankohta

/

Valuuttakurssi- ja kultariskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Kaksivaiheinen menetelmä

Laske 050505, 050510, 0507

Rivino	tno	vno	
05		7	263/265 Valuuttakurssi- ja kultariskin omien varojen vaatimus
05 05		8	260 Kokonaisnettovaluuttapositio
05 05 05		9	Pitkät valuutoittaiset nettopositiot yhteensä
05 05 10		9	Lyhyet valuutoittaiset nettopositiot yhteensä
05 07		2	Kultanettopositio
05 10		8	262 2 % omien varojen yhteismäärästä

Arvo	Kerroin %	Omien varojen vaatimus
05		10

0	8 %	0
0		

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z14

 Raportoitava
ajankohta

/

Valuutta- ja kultapositio

Tiedonantajatasot: 201, 202, 203, 210, 240

Frekvenssi: neljännesvuosittain

Vastaustarkkuus: FIM 1000

Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11

Valuutta :

 Valitse
 ▼

Nettopositio

05

Rivino				tno
05				3
05	05			8
05	10			5
05	15			0
05	20			7
05	25			2

Valuutoittainen nettopositio

Avistapositio

Terminipositio

Futuuripositio

Rakennepositio

Delta-painotetut valuuttaoptiosopimukset

0

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z15

 Raportoitava
ajankohta

/

Valuuttakurssi- ja kultariskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 205, 214, 244, 260, 264
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti-tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	05

 Rivino tno vno **Valuuttakurssi- ja kultariskin omien varojen vaatimus yhteensä**

05		4	591	▼	0
05	05	9			

Tunnuksen tyyppin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunnus
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z16a

Raportoitava
ajankohta

/

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

A Maturiteettipohjainen laskentatapa

Pitkät positiot	Lyhyet positiot	Maturiteettiluokan avoin positio	Maturiteettiluokan sisäinen katettu positio	Omien varojen vaatimuskertoin %	Omien varojen vaatimus
05	10	15	20	25	30

Rivino tno

05			0
05	05		1
05	10		1
05	15		2
05	20		2
05	25		3
05	30		3
05	35		4
10			0
15			1

Hyödykkeen omien varojen vaatimus yhteensä

0 ≤ 1 kuukautta

> 1 ≤ 3 kuukautta

> 3 ≤ 6 kuukautta

> 6 ≤ 12 kuukautta

> 1 ≤ 2 vuotta

> 2 ≤ 3 vuotta

yli 3 vuotta

Maturiteettiluokkien välinen katettu positio

Jäljelle jäävä avoin positio

					0
		0	0	1,5 %	0
		0	0	1,5 %	0
		0	0	1,5 %	0
		0	0	1,5 %	0
		0	0	1,5 %	0
		0	0	1,5 %	0
		0	0	1,5 %	0
			0	0,6 %	0
			0	15,0 %	0

.....

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z16b

Raportoitava ajankohta

/

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

B Yksinkertaistettu laskenta

Pitkät positiot	Lyhyet positiot	Nettopositio/ bruttopositio	Omien varojen vaatimuserroin %	Omien varojen vaatimus
05	10	15	20	25

Rivino tno

05			1
10			1
15			2

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus yhteensä
 Hyödykepositiot ja nettopositio omien varojen vaatimus
 Bruttopositio omien varojen vaatimus

			0	0
		0	15,0 %	0
		0	3,0 %	0

=====

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT**Z17****Hyödykeriskin omien varojen vaatimus**Raportoitava
ajankohta

/

Tiedonantajatasot: 205, 214, 244, 260, 264
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti- tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	05

Rivino				tno
05				6
05	05			1

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus yhteensä

			▼	0

Tunnuksen tyypin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunnus
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z19

Korkosopimusten ja osakkeiden erityisriskin omien varojen vaatimus sisäistä mallia käytettäessä

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Raportoitava ajankohta

/

Omien varojen vaatimus

05

Rivino tno

05				8
05	05			3
05	10			0

Erityisriskin omien varojen vaatimus

Erityisriskin osuus Var-luvusta

Erityisriskejä sisältävien alasalkkujen VaR-luvut yhteensä

0

Huom. täytettävä vain joko rivi 0505 tai 0510!

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Z20

Raportoitava
ajankohta

/

Sisäisten mallien avulla laskettu omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 205, 214, 244, 260, 264
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: FIM 1000
 Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (osuuspankkien yhteenliittymä)

Yrityksen			Omien varojen vaatimus
yksilöinti- tunnuksen tyyppi	yksilöintitunnus	nimi	05

Rivino tno
 05 1

Sisäisillä malleilla laskettu omien varojen vaatimus yhteensä

0

05 05 6
 05 05 05 1

Korkosopimusten ja osakkeiden erityisriskin omien varojen vaatimus yhteensä sisäistä mallia käytettäessä

0

05 10 3
 05 10 05 8

Yleisriskin omien varojen vaatimus yhteensä sisäistä mallia käytettäessä

0

Tunnuksen tyyppin sallitut arvot ovat: 1 = LY-tunnus, 2 = säätiörekisteritunnus, 3 = yhdistysrekisteritunnus, 4 = keinotekoinen tunnus
 Ly-tunnus annetaan ilman tarkistusmerkkiä erottavaa väliviivaa.

MARKKINARISKIN KATTAMISEKSI VAADITTAVAT OMAT VARAT

Koontitaulukko (raportoitava)

Omien varojen vaatimus

Tiedonantajatasot: 201, 210, 240
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: FIM 1000
Palautuspäivä: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (luottolaitokset)
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (sijoituspalveluyritykset)

Laske 0505 ja 0510

Rivino tno

05				2
05	05			7
05	10			4

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus yhteensä

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus yhteensä maturiteettipohjaista laskentaa käytettäessä

Hyödykeriskin omien varojen vaatimus yhteensä yksinkertaista laskentaa käytettäessä

10				9
10	05			4
10	10			1

Omien varojen vaatimus yhteensä sisäistä mallia käytettäessä

Yleisriskin omien varojen vaatimus sisäistä mallia käytettäessä

Erityisriskin omien varojen vaatimus sisäistä mallia käytettäessä

Z21

Raportoitava
ajankohta

/

Omien varojen
vaatimus

05

0

0

0

0