

Kreditinstitutsavdelningen
Veli-Jukka Lehtonen

13.9.1999

Holdingsammanslutningarna
Kreditinstituten
Sparbanksinspektionen
Centralinstitutet enligt andelsbankslagen

ÄNDRING AV ANVISNING 105.12 OM HANTERING AV DERIVATRISKER

För kännedom bifogas Finansinspektionens allmänna anvisning 105.12 om hantering av derivatrisker. Anvisningen träder i kraft den 15 september 1999 och gäller tills vidare.

I anvisningen har principen för beräkning av derivatens kreditmotvärde preciserats (avsnitt 5.1 Kreditrisk). Enligt anvisningen beräknas derivatens kreditmotvärde alltid på basis av marknadsvärdet. Det framtida potentiella kreditmotvärdet beräknas enligt en statistisk metod eller vid en mera begränsad derivatverksamhet med hjälp av de koefficienter som tillämpas i kapitaltäckningsberäkningen.

Ytterligare upplysningar lämnas på Finansinspektionen av Veli-Jukka Lehtonen, tfn (09) 183 5373 och Eeva-Liisa Raitanen, tfn (09) 183 5378.

FINANSINSPEKTIONEN

Kaiju Kallio
biträdande direktör

Veli-Jukka Lehtonen
bankspektör

BILAGA

Anvisning 105.12