

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z01
-----

Rapporten gäller
---------------------

/
---

### Kapitalkrav för specifika risker i ränteavtal

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Totalt	Koefficient %	Kapitalkrav
05		10

Radnr	knr	ref.
05	8	1.6/1.12 <b>Summa kapitalkrav för specifika risker i ränteavtal</b>
05 05	3	1.1/1.7 Regeringars och annan centralförvaltnings poster
05 10	0	1.2/1.8 Lågriskposter; återstående löptid högst 6 månader
05 15	5	1.3/1.9 Lågriskposter; återstående löptid över 6 månader, högst 24 månader
05 20	2	1.4/1.10 Lågriskposter; återstående löptid över 24 månader
05 25	7	1.5/1.11 Övriga poster

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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z02a

Rapporten  
gäller

/

## Kapitalkrav för generella risker i ränteavtal

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Valuta:

Välj

## A Löptidsbaserad beräkningsmetod

Radnr	knr	ref.	
05	4	36	Summa kapitalkrav
<b>Zon 1</b>			
05 05	5	26/23/27	Summa löptidskategorivis matchade resp. icke-matchade positioner
05 05 05	6		Löptidskategori 1
05 05 10	6		Löptidskategori 2
05 05 15	7		Löptidskategori 3
05 05 20	7		Löptidskategori 4
<b>Zon 2</b>			
05 10	5	26/24/27	Summa löptidskategorivis matchade resp. icke-matchade positioner
05 10 05	6		Löptidskategori 5
05 10 10	6		Löptidskategori 6
05 10 15	7		Löptidskategori 7
<b>Zon 3</b>			
05 15	6	26/25/27	Summa löptidskategorivis matchade resp. icke-matchade positioner
05 15 05	7		Löptidskategori 8
05 15 10	7		Löptidskategori 9
05 15 15	8		Löptidskategori 10
05 15 20	8		Löptidskategori 11
05 15 25	9		Löptidskategori 12
05 15 30	9		Löptidskategori 13
05 15 35	0		Löptidskategori 14
05 15 40	0		Löptidskategori 15
05 20	6	28	Matchade och icke-matchade positioner inom zon 1
05 25	7		Matchade och icke-matchade positioner inom zon 2
05 30	7	30	Matchade och icke-matchade positioner inom zon 3
05 35	8	31	Matchade positioner mellan zonerna 1 och 2
05 35 05	9		Återstod inom zon 1
05 35 10	9		Återstod inom zon 2
05 40	8	32	Matchade positioner mellan zonerna 2 och 3
05 40 05	9		Återstod inom zon 2
05 40 10	9		Återstod inom zon 3
05 45	9	33	Matchade positioner mellan zonerna 1 och 3
05 45 05	0		Återstod inom zon 1
05 45 10	0		Återstod inom zon 3
05 50	9	34	Icke-matchade positioner

Långa nettopositioners marknadsvärde	Korta nettopositioners marknadsvärde	Koefficient %	Riskvägda långa nettopositioner	Riskvägda korta nettopositioner	Matchad position	Icke- matchad lång position	Icke- matchad kort position	Kapitalkravs- koefficient %	Kapitalkrav
05	10		15	20	25	30	35		40
0	0								0
0	0				0	0	0	10 %	0
		0,00 %							
		0,20 %	0	0	0	0	0		
		0,40 %	0	0	0	0	0		
		0,70 %	0	0	0	0	0		
0	0				0	0	0	10 %	0
		1,25 %	0	0	0	0	0		
		1,75 %	0	0	0	0	0		
		2,25 %	0	0	0	0	0		
0	0				0	0	0	10 %	0
		2,75 %	0	0	0	0	0		
		3,25 %	0	0	0	0	0		
		3,75 %	0	0	0	0	0		
		4,50 %	0	0	0	0	0		
		5,25 %	0	0	0	0	0		
		6,00 %	0	0	0	0	0		
		8,00 %	0	0	0	0	0		
		12,50 %	0	0	0	0	0		
					0	0	0	40 %	0
					0	0	0	30 %	0
					0	0	0	30 %	0
					0			40 %	0
						0	0		
					0			40 %	0
						0	0		
					0			150 %	0
						0	0		
						0	0		
						0	0	100 %	0

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z02b

Rapporten  
gäller

/

## Kapitalkrav för generella risker i ränteavtal

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Valuta:

Välj

## B Durationsbaserad beräkningsmetod

Radnr	knr	ref.
05	5	47
05 10	6	37/40
05 15	7	38/41
05 20	7	39/42
05 25	8	43
05 25 05	9	
05 25 10	9	
05 30	8	44
05 30 05	9	
05 30 10	9	
05 35	9	45
05 35 05	0	
05 35 10	0	
05 40	9	46

Långa nettopositioners durationsvägda marknadsvärde	Korta nettopositioners durationsvägda marknadsvärde	Koefficient %	Riskvägda långa nettopositioner	Riskvägda korta nettopositioner	Matchad position	Icke- matchad lång position	Icke- matchad kort position	Kapitalkravs- koefficient %	Kapitalkrav
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	0	40 %	0
						0	0		
						0	0		
					0			150 %	0
						0	0		
						0	0		
						0	0	100 %	0

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z03

## Kapitalkrav för positionsrisk i ränteavtal

Rapporten  
gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 205, 214, 244, 260, 264  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svartsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr knr ref. **Summa kapitalkrav för positionsrisk i ränteavtal**

05 0 553

0

Summa kapitalkrav för specifika risker i ränteavtal

05 05 5 550

0

05 05 05 0

Summa kapitalkrav för generella risker i ränteavtal enligt den löptidsbaserade beräkningsmetoden

05 10 2 551

0

05 10 05 7

Summa kapitalkrav för generella risker i ränteavtal enligt den durationsbaserade beräkningsmetoden

05 15 7 552

0

05 15 05 2

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontroldelen.

# KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z04
-----

Rapporten gäller
---------------------

/
---

## Kapitalkrav för aktiepositionsrisker

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Långa nettopositioner	Korta nettopositioner	Brutto- totalposition	Netto- totalposition	Koefficient %	Kapitalkrav
05	10	15	20		25

Radnr	knr	ref.	
05	1	78	<b>Summa kapitalkrav för aktiepositionsrisker</b>
05	05	6	88 Kapitalkrav för specifika aktierisker
05	05	1	82 Positioner vars koefficient är 0%
05	05	8	83 Positioner vars koefficient är 2%
05	05	3	84 Positioner vars koefficient är 4%
05	10	3	93 Kapitalkrav för generella aktierisker

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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z05

## Kapitalkrav för aktiepositionsrisiker

Rapporten  
gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 205, 214, 244, 260, 264  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr knr ref. **Summa kapitalkrav för aktiepositionsrisiker**

05			2	563		0
----	--	--	---	-----	--	---

Summa kapitalkrav för specifika aktierisiker

05	05		7	561		0
05	05	05	2			

Summa kapitalkrav för generella aktierisiker

05	10		4	562		0
05	10	05	9			

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontrolldelen.

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z06

Rapporten  
gäller

/

## Nettoposition i teckningsförbindelser

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Förbindelsernas teckningsvärde	Koefficient %	Nettoposition i teckningsförbindelser
05		10

Radnr	knr	ref.
05		3
05 05		8
05 10		5
05 15		0
05 20		7
05 25		2
05 30		9

112 **Summa teckningsförbindelser för ränteavtal**  
 107 på dagen för teckningsförbindelsens ikraftträdande  
 108 förbindelser som varit i kraft 1 bankdag  
 109 förbindelser som varit i kraft 2-3 bankdagar  
 110 förbindelser som varit i kraft 4 bankdagar  
 111 förbindelser som varit i kraft 5 bankdagar  
 förbindelser som varit i kraft över 5 bankdagar

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

10		0
10 05		5
10 10		2
10 15		7
10 20		4
10 25		9
10 30		6

119 **Summa teckningsförbindelser för aktier**  
 114 på dagen för teckningsförbindelsens ikraftträdande  
 115 förbindelser som varit i kraft 1 bankdag  
 116 förbindelser som varit i kraft 2-3 bankdagar  
 117 förbindelser som varit i kraft 4 bankdagar  
 118 förbindelser som varit i kraft 5 bankdagar  
 förbindelser som varit i kraft över 5 bankdagar

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

**KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER****Z07a**Rapporten  
gäller

/

**Kapitalkrav för avvecklingsrisker avseende värdepapper och råvaror**

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

**Metod A**

Prisdifferens	Koefficient %	Kapitalkrav
05		10

Radnr	knr	ref.	
05		9	134 <b>Summa kapitalkrav för avvecklingsrisker avseende värdepapper och råvaror</b>
05	05	0	122 Icke-avvecklade under 5 - 15 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag
05	10	0	123 Icke-avvecklade under 16-30 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag
05	15	1	124 Icke-avvecklade under 31-45 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag
05	20	1	125 Icke-avvecklade under minst 46 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag

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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z07b
------

Rapporten gäller
---------------------

/
---

### Kapitalkrav för avvecklingsrisker avseende värdepapper och råvaror

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

#### Metod B (med Finansinspektionens tillstånd)

Kontraktpris	Prisdifferens	Koefficient %	Kapitalkrav
05	10		15

Radnr	knr	ref.	
05	0	147	<b>Summa kapitalkrav för avvecklingsrisker avseende värdepapper och råvaror</b>
05	05	135	Icke-avvecklade under 5 - 15 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag
05	10	136	Icke-avvecklade under 16-30 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag
05	15	137	Icke-avvecklade under 31-45 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag
05	20	138	Icke-avvecklade under minst 46 bankdagar efter avtalad avvecklingsdag

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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z07c

## Kapitalkrav för avvecklingsrisker avseende värdepapper och råvaror

Rapporten  
gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 260  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 31.3, 20.5, 20.8, 20.11

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr knr ref. **Summa kapitalkrav för avvecklingsrisker avseende värdepapper och råvaror**

05			2	160		0
05	05		3			

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontrolldelen.

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z08
-----

Rapporten gäller
---------------------

/
---

### Kapitalkrav för motpartsrisiker

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Riskvägt belopp	Koefficient %	Kapitalkrav
05		10

Radnr	knr	ref.	
05		5	225 <b>Summa kapitalkrav för motpartsrisiker</b>
05	05	0	220 Riskvägda motpartsrisiker i kreditaffärer
05	10	7	221 Riskvägda motpartsrisiker avseende återköps- och återförsäljningsavtal och värdepappers- och råvarulån
05	15	2	222 Riskvägda motpartsrisiker i icke-standardiserade derivatkontrakt
05	20	9	223 Riskvägt belopp av andra motpartsrisiker

0	8 %	0
0		
0		
0		
0		

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z08b

## Kapitalkrav för motpartsrisiker

Rapporten

gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 260  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 31.3, 20.5, 20.8, 20.11

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr	knr	ref.	Summa kapitalkrav för motpartsrisiker
05			1 250
05	05		2
			0

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontrolldelen.

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z09
-----

Rapporten gäller
---------------------

/
---

### Riskvägda motpartsrisiker i kreditaffärer

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Marknadsvärde/ betalningsbelopp	Riskvikt %	Riskvägt belopp
05		10

Radnr	knr	ref.	
05		6	233 <b>Summa riskvägda motpartsrisiker i kreditaffärer</b>
05	05	1	230 Grupp I (riskvikt 0%)
05	10	8	231 Grupp II (riskvikt 20%)
05	15	3	232 Grupp IV (riskvikt 100%)

		0
	0 %	
	20 %	0
	100 %	0

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z10

Rapporten  
gäller

/

## Riskvägda motpartsrisiker i återköps- och återförsäljningsavtal och värdepappers- och råvarulån

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Värdepapperets eller råvarans marknadsvärde	Säkerhetens marknadsvärde eller lånat belopp	Prisdifferens	Riskvikt %	Riskvägt belopp
05	10	15		20

Radnr knr ref.

05			9
05	05		4
05	10		1
05	15		6

238 **Summa riskvägda motpartsrisiker i återköpsavtal och utlåning av värdepapper och råvaror**

235 Grupp I (riskvikt 0%)

236 Grupp II (riskvikt 20%)

237 Grupp IV (riskvikt 100%)

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

Radnr knr ref.

10			6
10	05		1
10	10		8
10	15		3

238 **Summa riskvägda motpartsrisiker i återförsäljningsavtal och inlåning av värdepapper och råvaror**

235 Grupp I (riskvikt 0%)

236 Grupp II (riskvikt 20%)

237 Grupp IV (riskvikt 100%)

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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z11b

Rapporten  
gäller

/

## Riskvägda motpartsrisker i icke-standardiserade derivatkontrakt

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svars noggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

## B Metoden med gängse värde

Återanskaffnings- kostnad	Nominellt belopp	Koefficient %	Framtida kreditrisker	Kreditmot- belopp	Risk- vikt %	Riskvägt belopp
05	10		15	20		25

Radnr	Tno	Vno
05		6

42 Summa derivatkontrakt

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

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

Summa nettade derivatkontrakt

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

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

Summa ränterelaterade kontrakt

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

421 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 0 %

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

422 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 20 %

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

423 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 50 %

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

424 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 100 %

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

425 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 0 %

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

426 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 20 %

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

427 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 50 %

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

428 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 100 %

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

Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 0 %

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

Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 20 %

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

Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 50 %

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

Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 100 %

0	0		0	0		0
		0 %		0	0 %	
		0 %		0	20 %	0
		0 %		0	50 %	0
		0 %		0	100 %	0
		0,5 %	0	0	0 %	
		0,5 %	0	0	20 %	0
		0,5 %	0	0	50 %	0
		0,5 %	0	0	100 %	0
		1,5 %	0	0	0 %	
		1,5 %	0	0	20 %	0
		1,5 %	0	0	50 %	0
		1,5 %	0	0	100 %	0

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

Summa valutakurs- och guldrelaterade kontrakt

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

430 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 0 %

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

431 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 20 %

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

432 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 50 %

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

433 Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 100 %

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

434 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 0 %

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

435 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 20 %

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

436 Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 50 %

0	0		0	0		0
		1 %	0	0	0 %	
		1 %	0	0	20 %	0
		1 %	0	0	50 %	0
		1 %	0	0	100 %	0
		5 %	0	0	0 %	
		5 %	0	0	20 %	0
		5 %	0	0	50 %	0

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z11b

Rapporten  
gäller

/

## Riskvägda motpartsrisker i icke-standardiserade derivatkontrakt

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svars noggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

## B Metoden med gängse värde

05	10	40	1	437	Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 100 %
05	10	45	2		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 0 %
05	10	50	2		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 20 %
05	10	55	3		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 50 %
05	10	60	3		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 100 %

05	15		8		<b>Summa aktierelaterade kontrakt</b>
05	15	05	9		Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 0 %
05	15	10	9		Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 20 %
05	15	15	0		Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 50 %
05	15	20	0		Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 100 %
05	15	25	1		Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 0 %
05	15	30	1		Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 20 %
05	15	35	2		Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 50 %
05	15	40	2		Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 100 %
05	15	45	3		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 0 %
05	15	50	3		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 20 %
05	15	55	4		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 50 %
05	15	60	4		Återstående löptid $t > 5$ , riskvikt 100 %

05	20		8		<b>Summa ädelmetall- och andra råvarurelaterade kontrakt</b>
----	----	--	---	--	--

05	20	05	9		<b>Summa ädelmetallrelaterade kontrakt</b>
05	20	05	05	0	Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 0 %
05	20	05	10	0	Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 20 %
05	20	05	15	1	Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 50 %
05	20	05	20	1	Återstående löptid $t \leq 1$ , riskvikt 100 %
05	20	05	25	2	Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 0 %
05	20	05	30	2	Återstående löptid $1 < t \leq 5$ , riskvikt 20 %

Återanskaffningskostnad	Nominellt belopp	Koefficient %	Framtida kreditrisker	Kreditmotbelopp	Riskvikt %	Riskvägt belopp
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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z11b

Rapporten  
gäller

/

## Riskvägda motpartsrisiker i icke-standardiserade derivatkontrakt

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)

28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

## B Metoden med gängse värde

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

Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 50 %Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 100 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 0 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 20 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 50 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 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

## Summa andra råvarurelaterade kontrakt

Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 0 %Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 20 %Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 50 %Återstående löptid  $t \leq 1$ , riskvikt 100 %Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 0 %Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 20 %Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 50 %Återstående löptid  $1 < t \leq 5$ , riskvikt 100 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 0 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 20 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 50 %Återstående löptid  $t > 5$ , riskvikt 100 %

Återanskaffnings- kostnad	Nominellt belopp	Koefficient %	Framtida kreditrisiker	Kreditmot- belopp	Risk- vikt %	Riskvägt belopp
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

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z12

Rapporten  
gäller

/

## Riskvägt belopp av andra motpartsrisker

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 205, 210, 214, 240, 244, 260, 264

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Bokförings- belopp	Riskvikt %	Riskvägt belopp
05		10

Radnr	knr	ref.	
05		1	249 <b>Summa riskvägt belopp av andra motpartsrisker</b>
<b>Arvodes-, kommissions-, dividend- och räntefordringar</b>			
05	05	6	240 Grupp I (riskvikt 0%)
05	10	3	241 Grupp II (riskvikt 20%)
05	15	8	242 Grupp IV (riskvikt 100%)
<b>Andra motsvarande fordringar</b>			
05	35	2	246 Grupp I (riskvikt 0%)
05	40	9	247 Grupp II (riskvikt 20%)
05	45	4	248 Grupp IV (riskvikt 100%)

	0
--	---

	0 %	
	20 %	0
	100 %	0

	0 %	
	20 %	0
	100 %	0

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

<b>Z13a</b>
-------------

Rapporten gäller
---------------------

/
---

### Kapitalkrav för valutakurs- och guldrisker

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svartsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

#### Tvåstegsmetoden

Kalkylera 050505, 050510 och 0507
--------------------------------------

Radnr	knr	ref.	
05		7	263/265 Kapitalkrav för valutakurs- och guldrisker
05	05	8	260 Total nettovalutaposition
05	05 05	9	Summa långa nettovalutapositioner
05	05 10	9	Summa korta nettovalutapositioner
05	07	2	Nettopositionen i guld
05	10	8	262 2 % av den totala kapitalbasen

Belopp	Koefficient %	Kapitalkrav
05		10

0	8 %	0
0		

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z14

Rapporten

gäller

/

### Valuta- och guldposition

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 202, 203, 210, 240

Frekvens: kvartalsvis

Svarsnoggrannhet: FIM 1000

Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11

Valuta:

Välj

Nettoposition

05

Radnr				knr
05				3
05	05			8
05	10			5
05	15			0
05	20			7
05	25			2

#### Nettovalutaposition

Avistaposition

Terminsposition

Futurposition

Strukturposition

Deltavägda valutaoptionskontrakt

0

**KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER****Z15****Kapitalkrav för valutakurs- och guldrisker**Rapporten  
gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 205, 214, 244, 260, 264  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr	knr	ref.	Summa kapitalkrav för valutakurs- och guldrisker
05		4	591
05	05	9	

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontrolldelen.

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z16a

Rapporten  
gäller

/

## Kapitalkrav för råvarurisker

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svartsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

## A Löptidsbaserad beräkningsmetod

Radnr knr

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

Summa kapitalkrav för råvara  
 0 ≤ 1 månad  
 > 1 ≤ 3 månader  
 > 3 ≤ 6 månader  
 > 6 ≤ 12 månader  
 > 1 ≤ 2 år  
 > 2 ≤ 3 år  
 över 3 år  
 Täckt position mellan löptidskategorierna  
 Återstående öppen position

Långa positioner	Korta positioner	Löptidskategorins öppna position	Löptidskategorins interna täckta position	Kapitalkravskoefficient %	Kapitalkrav
05	10	15	20	25	30

					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

.....

# KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z16b
------

Rapporten gäller
---------------------

/
---

## Kapitalkrav för råvarurisker

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svartsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

### B Förenklad beräkningsmetod

Radnr knr

05			1
10			1
15			2

Summa kapitalkrav för råvarurisker  
 Råvarupositioner och kapitalkrav för nettopositionen  
 Kapitalkrav för bruttopositionen

Långa positioner	Korta positioner	Nettoposition/ bruttoposition	Kapitalkravs- koefficient %	Kapitalkrav
05	10	15	20	25
				0
		0	15,0 %	0
		0	3,0 %	0

=====

**KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER**

Z17

**Kapitalkrav för råvarurisker**Rapporten  
gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 205, 214, 244, 260, 264  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr	knr
05	6
05 05	1

**Summa kapitalkrav för råvarurisker**

			▼	0

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontroldelen.

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z18

Rapporten  
gäller

/

## Kapitalkrav för generella risker enligt egna modeller

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarens noggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Typpi	Kod	Nimi	Föregående dags VaR-värde	Genomsnittet av VaR-värdena för de föregående 60 bankdagarna	Överskridningar enligt back testing	Kapitalkrav
			05	10	15	20

Radnr	knr
05	7
05 05	2

## Summa kapitalkrav vid användning av egna modeller

						0
						0

**KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER****Z19****Kapitalkrav för specifika risker i ränteavtal och aktier enligt egna modeller**

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svartsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Rapporten gäller
---------------------

/
---

Kapitalkrav
-------------

05
----

0
---

Radnr knr

05				8
05	05			3
05	10			0

Kapitalkrav för specifika risker

Andel specifik risk i VaR-värdet

Summa VaR-värden för underportföljer med specifika risker

---

 Obs! Rapportera antingen på rad 0505 eller 0510!

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

Z20

## Kapitalkrav beräknat med egna modeller

Rapporten  
gäller

/

Uppgiftslämnarnivåer: 205, 214, 244, 260, 264  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svarsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)  
 31.3, 20.5, 20.8, 20.11 (sammanslutningen av andelsbanker)

Företagets			Kapitalkrav
typ av ID-kod	ID-kod	namn	05

Radnr	knr
05	1

Summa kapitalkrav beräknat med egna modeller

0

05	05		6
05	05	05	1

Summa kapitalkrav för specifika risker i ränteavtal och aktier enligt egna modeller

0

05	10		3
05	10	05	8

Summa kapitalkrav för generella risker enligt egna modeller

0

Tillåtna kodtyper: 1 = AS-signum, 2 = Stiftelseregisternr, 3 = Föreningsregisternr, 4 = Artificiellt signum  
 As-signumet ges utan det bindestreck som avskiljer kontrolldelen.

## KAPITALKRAV FÖR MARKNADSRISKER

### Samlingstabell (för rapportering)

Z21

 Rapporten  
gäller

/

### Kapitalkrav

Uppgiftslämnarnivåer: 201, 210, 240  
 Frekvens: kvartalsvis  
 Svartsnoggrannhet: FIM 1000  
 Inlämningstid: 28.2, 15.5, 15.8, 15.11 (kreditinstitut)  
 28.2, 30.4, 31.7, 31.10 (värdepappersföretag)

Kalkylera 0505 och 0510

Kapitalkrav

05

Radnr knr

05				2
05	05			7
05	10			4

Summa kapitalkrav för råvarurisker

Summa kapitalkrav för råvarurisker enligt löptidsbaserad beräkningsmetod

Summa kapitalkrav för råvarurisker enligt förenklad beräkningsmetod

0

10				9
10	05			4
10	10			1

Summa kapitalkrav vid användning av egna modeller

Kapitalkrav för generella risker enligt egna modeller

Kapitalkrav för specifika risker enligt egna modeller

0

0

0