

Föreskrifter och anvisningar 4/2013

Beräkning av stressat Value at Risk-tal samt av kapital som krävs för att fånga upp tillkommande fallissemangs- och migrationsrisker

Dnr
FIVA 5/01.00/2013

Utfärdade
24.4.2013

Gäller från
15.5.2013

FINANSINSPEKTIONEN

telefon 010 831 51

fax 010 831 5328

fornamn.efternamn@finanssivalvonta.fi

www.finansinspektionen.fi

Upplysningar
Risktillsyn/Marknadsrisker och operativa risker



Innehåll

1	Tillämpningsområde	3
2	Beräkning av stressat Value at Risk-tal	4
3	Beräkning av kapital som krävs för att fånga upp tillkommande fallissemangs- och migrationsrisker	5

1 Tillämpningsområde

- (1) Kapitel 2 i dessa anvisningar tillämpas på följande i 4 § i lagen om Finansinspektionen (878/2008) avsedda auktoriserade tillsynsobjekt som tillämpar en beräkningsmetod baserad på en intern modell vid beräkning av kapitalkravet för marknadsrisken i handelslagret:
- kreditinstitut
 - värdepappersföretag med undantag för de värdepappersföretag som avses i 6 kapitel 1 § 4 och 5 mom. i lagen om investeringstjänster (747/2012)
 - sammanslutningar enligt lagen om en sammanslutning av inlåningsbanker (599/2010)
- (2) Kapitel 3 i dessa anvisningar tillämpas på följande i 4 § i lagen om Finansinspektionen avsedda auktoriserade tillsynsobjekt som tillämpar en beräkningsmetod baserad på en intern modell vid beräkning av kapitalkravet för särskild ränterisk i handelslagret:
- kreditinstitut
 - värdepappersföretag med undantag för de värdepappersföretag som avses i 6 kapitel 1 § 4 och 5 mom. i lagen om investeringstjänster
 - sammanslutningar enligt lagen om en sammanslutning av inlåningsbanker (599/2010)

2 Beräkning av stressat Value at Risk-tal

- (1) Europeiska bankmyndigheten har med stöd av 16 artikel i Europeiska parlamentets och rådets förordning (EU) nr 1093/2010 utfärdat anvisningarna: "Anvisningar om stressad Value at Risk-modell (Stressed VaR)" (EBA/GL/2012/2).

ANVISNING (stycke 2)

- (2) Finansinspektionen rekommenderar att de företag som nämns i stycke 1 i kapitel 1 i dessa anvisningar ska iaktta de i stycke 1 i detta kapitel avsedda anvisningarna av Europeiska bankmyndigheten, som finns på Finansinspektionen.fi

3 Beräkning av kapital som krävs för att fånga upp tillkommande fallissemangs- och migrationsrisker

- (1) Europeiska bankmyndigheten har med stöd av 16 artikel i Europeiska parlamentets och rådets förordning (EU) nr 1093/2010 utfärdat anvisningarna: "Anvisningar om kapital som krävs för att fånga upp tillkommande fallissemangs- och migrationsrisker (Incremental Risk Charge, IRC)" (EBA/GL/2012/3).

ANVISNING (stycke 2)

- (2) Finansinspektionen rekommenderar att de företag som nämns i stycke 2 i kapitel 1 i dessa anvisningar ska iaktta de i stycke 1 i detta kapitel avsedda anvisningarna av Europeiska bankmyndigheten, som finns på Finansinspektionen.fi

