

VIRATI

VIRANOMAISYHTEISTYÖRYHMÄ

(Finanssivalvonta/Suomen Pankki/Tilastokeskus)

Annettu

Korvaa

Voimassa

30.9.2004

10.6.2000

30.9.2011

M

RAHOITUSRISKI

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Palautusviive: 20 pankkipäivää
Vastaustarkkuus: 1000 euroa
Määrittelyistä vastaa: Finanssivalvonta
Tiedot toimitetaan: Finanssivalvonnalle
Voimaantulo: 30.9.2011

Rahoitusriski:

Tiedonantajatasot: 221, 292, 284, 294, 203

M01 Taseen vastaavaa; euromääräiset ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä
M02 Taseen vastattavaa; euromääräiset ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä
M03 Liitetiedot; taseen vastaavaa; euromääräiset ja muut kuin euromääräiset erät yhteen
M04 Liitetiedot; taseen vastattavaa; euromääräiset ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä

Tiedonantajatasot: 287, 288, 289
(keskusrahallaitokset)

M41 Taseen vastaavaa; euromääräiset ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä
M42 Taseen vastattavaa; euromääräiset ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä

Liite 1: Rahoitusriski; LASKUSÄÄNNÖT

Viitteet: *Rahoitustarkastuksen standardi RA 4.7 rahoitusriskin ilmoittamisesta
*Tiedonantajatasojen määritelmät ja sisältö liitteessä 6 "Tiedonkeruun tiedonantajat"
*Lomakemallissa tietokentillä esiintyy 0 niissä tietokentissä, joihin EXCEL-työkirjoissa tai muutoin liittyy poiminta- tai laskukaava.

Tiedustelut: || Finanssivalvonta; Lauri Kujala puh. 010 831 5223

**RAHOITUSRISKI; LIITETIEDOT; TASEEN VASTATTAVAA
EURO- JA MUUT KUIN EUROMÄÄRÄISET ERÄT YHTEENSÄ (C3)**

Standardi: RA 4.7
 Tiedonantajatasot: 203, 221, 292, 284, 294
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: 1000 EUR
 Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

M04
 Raportoitava
 ajankohta
 /

Rivino		tno		tase-erä		no		Luokittelutekijät		Yhteensä		>0kk <=1kk	>1kk <=3kk	>3kk <=6kk	>6kk <=9kk	>9kk <=12kk	>1v <=2v	>2v <=5v	>5v	
B	C	K	O	C040001	C0401	C0402	C0403	C0404	C0501	C050003	C06	10	15	20	25	30	35	40	45	
krit				05																

Rivino	tno	tase-erä	no	Luokittelutekijät	0901	0901	0901	0901	0901
05	8			Velat, joihin on kytketty pääsopimuksesta erotettava johdannainen					0
0505	3	4405		Talletukset	Kr01	Kr15			
0510	0	4605		Joukkovelkakirjat	Kr01	Kr15			
0515	5	463005		Sijoitus- ja yritystodistukset	Kr01	Kr15			
0520	2			Muut	Kr01	K04/ K0606/ K0609/ K0704/ K0709/ K99/ Kr15			

ULKOMAISET SIVUKONTTORIT (203) ILMOITTAVAT:

Rivino		tno		tase-erä		no		Luokittelutekijät		Yhteensä		>0kk <=1kk	>1kk <=3kk	>3kk <=6kk	>6kk <=9kk	>9kk <=12kk	>1v <=2v	>2v <=5v	>5v	
B	C	L	O	C040001	C0401	C0402	C0403	C0404	C0501	C050003	C06	10	15	20	25	30	35	40	45	
krit				05																

20	7	43		Sivukonttorin velat luottolaitokselle ilman ulkomaisia sivukonttoreita	Kr01	Kr02 L04					0901	0								
25	2	43		Sivukonttorin velat luottolaitoksen muille sivukonttoreille	Kr01	Kr02 L05					0901	0								



VIRATI

VIRANOMAISYHTEISTYÖRYHMÄ

(Finanssivalvonta/Suomen Pankki/Tilastokeskus)

Annettu

Korvaa

Voimassa

31.3.2005

30.9.2011 alkaen

M/Liite 1

RAHOITUSRISKI; laskusäännöt

Rivi merkitään i :llä, sarake j :llä, koordinaatteina käytetään taulun rivi- ja sarakenumeroita.

Esimerkki: $X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...50}$, kun $05 \leq i \leq 70$.

Selitys: Sarakkeeseen 05 lasketaan sarakkeiden 10...50 summa riveillä 05...70.

Taulu M01:

$$X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...55}, \text{ kun } 05 \leq i \leq 70$$

$$X_{07,j} = \sum_i Y_{0705...0720,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

$$X_{10,j} = \sum_i Y_{1005...101010,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

$$X_{25,j} = \sum_i Y_{2570,2575,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

$$X_{2570,j} = \sum_i Y_{257005...257010,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

$$X_{2575,j} = \sum_i Y_{257505...257510,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

$$X_{30,j} = \sum_i Y_{3005...3020,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

$$X_{70,j} = \sum_i Y_{05...60,j-y07,j-y10,j-y25,j-y2570,j-y2575,j-y30}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 55$$

Taulu M02:

$$X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...45}, \text{ kun } 05 \leq i \leq 50$$

$$X_{05,j} = \sum_i Y_{0505...0510,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 45$$

$$X_{0510,j} = \sum_i Y_{051005...051010,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 45$$

$$X_{10,j} = \sum_i Y_{100505...1010,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 45$$

$$X_{15,j} = \sum_i Y_{1540...1550,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 45$$

$$X_{50,j} = \sum_i Y_{05...45,j-y05,j-y0510,j-y10,j-y15}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 45$$

Taulu M03:

$$X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...50}, \text{ kun } 25 \leq i \leq 75$$

Taulu M04:

$$X_{05,05} = \sum_j Y_{0505...0520,05}$$

$$X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...45}, \text{ kun } 20 \leq i \leq 25$$

Taulu M41:

$$X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...50}, \text{ kun } 05 \leq i \leq 25$$

Taulu M42:

$$X_{i,05} = \sum_j Y_{i,10...45}, \text{ kun } 05 \leq i \leq 10$$

$$X_{05,j} = \sum_i Y_{0505...0510,j}, \text{ kun } 10 \leq j \leq 45$$