

VIRATI

VIRANOMAISYHTEISTYÖRYHMÄ

(Rahoitustarkastus/Suomen Pankki/Tilastokeskus)

Annettu

Korvaa

Voimassa

6.10.2004

10.6.2000

31.3.2005 alkaen

P

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKUKSET

Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293 Rahoitustarkastukselle
221, 281, 284, 292, 293 Tilastokeskukselle

Frekvenssi: Neljännesvuosittain
Palautusviive: 20 pankkipäivää
Vastaustarkkuus: 1000 euroa
Määrittelyistä vastaa: Rahoitustarkastus
Voimaantulo: 31.3.2005

- P01** Asiakkaan puolesta kolmannen hyväksi annetut sitoumukset
P02 Asiakkaan hyväksi annetut peruuttamattomat sitoumukset
P03 Asiakkaan hyväksi annetut peruutettavissa olevat sitoumukset
P04 Luottolaitoksen hyväksi annetut sitoumukset
P05 (poistettu)
P06 Termiini- ja futuurisopimukset
P07 SWAP-sopimukset
P08 Optiosopimukset; kohde-etuuden nimellisarvo
P09 Optiosopimukset; deltakertoimella korjattu arvo
P13 Luottojohdannaiset; kohde-etuuden nimellisarvo
- P21** (poistettu)
P22 (poistettu)
P23 (poistettu)
P24 (poistettu)
P25 (poistettu)
P26 Termiini- ja futuurisopimukset; muut kuin euromääräiset erät
P27 SWAP-sopimukset; muut kuin euromääräiset erät
P28 Optiosopimukset; kohde-etuuden nimellisarvo; muut kuin euromääräiset erät
P29 (poistettu)
P33 (poistettu)
- P36** Termiini- ja futuurisopimukset; euromääräiset erät
P37 SWAP-sopimukset; euromääräiset erät
P38 Optiosopimukset; kohde-etuuden nimellisarvo; euromääräiset erät

Liite 1: Taseen ulkopuoliset sitoumukset; LASKUSÄÄNNÖT

Viitteet: *Rahoitustarkastuksen määräykset 106.8 ja 106.8a (taseen ulkopuoliset sitoumukset)
*Tilastokeskuksen tiedonkeruupäätös TK-41-381-04
*Tiedonantajatasojen määritelmät ja sisältö liitteessä 6 "Luottolaitostiedonkeruun tiedonantajat"
*Lomakemallissa tietokentillä esiintyy 0 niissä tietokentissä, joihin EXCEL-työkirjoissa tai muutoin liittyy poiminta- tai laskukaava .

Tiedustelut: Rahoitustarkastus; Veli-Jukka Lehtonen 010 831 5373

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P03

Raportoitava ajankohta
00 / 0000

ASIAKKAAN HYVÄKSI ANNETUT PERUUTETTAVISSA OLEVAT SITOUKSET

(P03)		Rivino	tno	Luokittelutekijät				Euro ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä C		
								Kotimaa C1	Ulkomaat C2	Yhteensä C3
B	C	O	u	05	10	15				
krit	krit									
05	0			Jatkuvat luottolimitit	01	0906	0301			0
95	9			Muut	01	0906	0309			0

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
 Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
 Frekvenssi: neljännesvuosittain
 Vastaustarkkuus: 1000 EUR
 Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P04

Raportoitava
 ajankohta
 00 / 0000

LUOTTOLAITOKSEN HYVÄKSI ANNETUT SITOUKUKSET

(P04)		Luokittelutekijät				Euro ja muut kuin euromääräiset erät		Yhteensä C3								
						yhteensä C		>0kk <=1kk	>1kk <=3kk	>3kk <=6kk	>6kk <=9kk	>9kk <=12kk	>1v <=2v	>2v <=5v	>5v	
Rivino	tno	B	C	O	u	C1	C2	C3	C040001	C0401	C0402	C0403	C0404	C0501	C050003	C06
		krit	krit			05	10	15	20	25	30	35	40	45	50	55
05	1							0								
10	8							0								
15	3							0								
20	0							0								
95	0							0								



TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P08

Raportoitava
 ajankohta
 00 / 0000

OPTIOSOPIMUKSET, kohde-etuuden nimellisarvo

(P08)	Rivino	tno	Luokittelutekijät				Euro ja muut kuin euromääräiset erät			Yhteensä C3				
							yhteensä C			P-ryhmä P0010	U-kriteeri 05	>0v <=1v C050001	>1v <=5v C05	>5v C06
							Kotimaa C1	Ulkomaat C2	Yhteensä C3					
			B krit	C krit	O	u	05	10	15	20	25	30	35	40
05	5	Valuuttaoptiot (call), ostetut				080101	0	0	0					
0505	0	Ostettava valuutta	01	05	0906	08010101			0					
0515	2	Myytävä valuutta	01	05	0906	08010103			0					
10	2	Valuuttaoptiot (call), asetetut				080102	0	0	0					
1005	7	Ostettava valuutta	01	05	0906	08010201			0					
1015	9	Myytävä valuutta	01	05	0906	08010203			0					
15	7	Valuuttaoptiot (put), ostetut				080201	0	0	0					
1505	2	Ostettava valuutta	01	05	0906	08020101			0					
1515	4	Myytävä valuutta	01	05	0906	08020103			0					
20	4	Valuuttaoptiot (put), asetetut				080202	0	0	0					
2005	9	Ostettava valuutta	01	05	0906	08020201			0					
2015	1	Myytävä valuutta	01	05	0906	08020203			0					
45	3	Osakeoptiot (call), ostetut	01	05	0906	081101			0					
50	1	Osakeoptiot (call), asetetut	01	05	0906	081102			0					
55	6	Osakeoptiot (put), ostetut	01	05	0906	081701			0					
60	3	Osakeoptiot (put), asetetut	01	05	0906	081702			0					
65	8	Osakeindeksiopiot (call), ostetut	01	05	0906	081901			0					
70	5	Osakeindeksiopiot (call), asetetut	01	05	0906	081902			0					
75	0	Osakeindeksiopiot (put), ostetut	01	05	0906	082101			0					
80	7	Osakeindeksiopiot (put), asetetut	01	05	0906	082102			0					
81	8	Eksoottiset opiot (call), ostetut	01	05	0906	082301			0					
82	9	Eksoottiset opiot (call), asetetut	01	05	0906	082302			0					
83	0	Eksoottiset opiot (put), ostetut	01	05	0906	082501			0					
84	1	Eksoottiset opiot (put), asetetut	01	05	0906	082502			0					
85	2	Muut opiot (call), ostetut	01	05	0906	082901			0					
90	9	Muut opiot (call), asetetut	01	05	0906	082902			0					
95	4	Muut opiot (put), ostetut	01	05	0906	083901			0					
99	8	Muut opiot (put), asetetut	01	05	0906	083902			0					

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P13

Raportoitava
ajankohta
00 / 0000

LUOTTOJOHDANNAISET, kohde-etuuden nimellisarvo

(P13)		Rivino	tno	Luokittelutekijät				Euro ja muut kuin euromääräiset erät yhteensä C			Yhteensä C3			
				B	C	O	u	Kotimaa	Ulkomaat	Yhteensä	U-kriteeri	>0v <=1v	>1v <=5v	>5v
				krit	krit			C1	C2	C3	05	C050001	C05	C06
								05	10	15	17	20	25	30
05	2						1301	0	0	0				
0505	7			01	05	0904	130101			0				
0510	4			01	05	0904	130102			0				
0515	9			01	05	0904	130103			0				
06	3						1302	0	0	0				
0605	8			01	05	0904	130201			0				
0610	5			01	05	0904	130202			0				
0615	0			01	05	0904	130203			0				
07	4						1303	0	0	0				
0705	9			01	05	0904	130301			0				
0710	6			01	05	0904	130302			0				
0715	1			01	05	0904	130303			0				
10	9						1309	0	0	0				
1005	4			01	05	0904	130901			0				
1010	1			01	05	0904	130902			0				
1015	6			01	05	0904	130903			0				

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P26

Raportoitava
ajankohta
00 / 0000

TERMIINI- JA FUTUURISOPIMUKSET

MUUT KUIN EUROMÄÄRÄISET ERÄT

(P26)

Rivino tno

15	9	Korkotermiinit, ostot (FRA)
17	1	Korkofutuurit, ostot (alle vuoden kohde-etuus)
19	3	Korkofutuurit, ostot (yli vuoden kohde-etuus)
25	1	Korkotermiinit, myynnit (FRA)
27	3	Korkofutuurit, myynnit (alle vuoden kohde-etuus)
29	5	Korkofutuurit, myynnit (yli vuoden kohde-etuus)

Luokittelutekijät				MUUT VALUUTAT B			MUUT VALUUTAT B3				
				Kotimaa B1	Ulkomaat B2	Yhteensä B3	P-ryhmä P0010	U-kriteeri 05	>0v <=1v C050001	>1v <=5v C05	>5v C06
B	C	O	u	05	10	15	20	25	30	35	40
krit	krit										
01	05	0904	060401			0					
01	05	0904	060402			0					
01	05	0904	060403			0					
01	05	0904	060404			0					
01	05	0904	060405			0					
01	05	0904	060406			0					

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUMUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P27

Raportoitava
ajankohta

00 / 0000

SWAP-SOPIMUKSET

MUUT KUIN EUROMÄÄRÄISET ERÄT

(P27)

Rivino tno

				MUUT VALUUTAT B			MUUT VALUUTAT B3				
Luokittelutekijät				Kotimaa	Ulkomaat	Yhteensä	P-ryhmä	U-kriteeri	>0v <=1v	>1v <=5v	>5v
B	C	O	u	B1	B2	B3	P0010	05	C050001	C05	C06
krit	krit			05	10	15	20	25	30	35	40
05	8		Koronvaihtosopimukset				0				
0505	3		Pääomasaaminen	01	05	0904	070101				
0510	0		Pääomavelka	01	05	0904	070102				

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUMUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P36

Raportoitava
 ajankohta
 00 / 0000

TERMIINI- JA FUTUURISOPIMUKSET

EUROMÄÄRÄISET ERÄT

(P36)

Rivino tno

				EURO A			EURO A3					
				Kotimaa	Ulkomaat	Yhteensä	P-ryhmä	U-kriteeri	>0v <=1v	>1v <=5v	>5v	
				A1	A2	A3	P0010	05	C050001	C05	C06	
				05	10	15	20	25	30	35	40	
				B	C	O	u	Luokittelutekijät				
				krit	krit							
15	1	Korkotermiinit, ostot (FRA)		05	0904	060401						
17	3	Korkofutuurit, ostot (alle vuoden kohde-etuus)		05	0904	060402						
19	5	Korkofutuurit, ostot (yli vuoden kohde-etuus)		05	0904	060403						
25	3	Korkotermiinit, myynnit (FRA)		05	0904	060404						
27	5	Korkofutuurit, myynnit (alle vuoden kohde-etuus)		05	0904	060405						
29	7	Korkofutuurit, myynnit (yli vuoden kohde-etuus)		05	0904	060406						

TASEEN ULKOPUOLISET SITOUMUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P37

Raportoitava
 ajankohta
 00 / 0000

SWAP-SOPIMUKSET

EUROMÄÄRÄISET ERÄT

(P37)		Luokittelutekijät				EURO A			EURO A3				
						Kotimaa A1	Ulkomaat A2	Yhteensä A3	P-ryhmä P0010	U-kriteeri 05	>0v <=1v C050001	>1v <=5v C05	>5v C06
Rivino	tno	B krit	C krit	O	u	05	10	15	20	25	30	35	40
05	0				0701	0	0	0					
0505	5		05	0904	070101			0					
0510	2		05	0904	070102			0					



TASEEN ULKOPUOLISET SITOUMUKSET

Määräykset: 106.8 ja 106.8a
Tiedonantajatasot: 203, 221, 281, 284, 292, 293
Frekvenssi: neljännesvuosittain
Vastaustarkkuus: 1000 EUR
Palautuspäivä: 20 pankkipäivää

P38

Raportoitava ajankohta
00 / 0000

OPTIOSOPIMUKSET, kohde-etuuden nimellisarvo

EUROMÄÄRÄISET ERÄT

(P38)		Luokittelutekijät				EURO A			EURO A3				
Rivino	tno	B	C	O	u	Kotimaa	Ulkomaat	Yhteensä	P-ryhmä	U-kriteeri	>0v <=1v	>1v <=5v	>5v
		krit	krit			A1	A2	A3	P0010	05	C050001	C05	C06
						05	10	15	20	25	30	35	40
25	5			05	0904	080501		0					
30	2			05	0904	080502		0					
35	7			05	0904	080701		0					
40	4			05	0904	080702		0					