

**VIRATI**

MYNDIGHETSSAMARBETSGRUPPEN

(Finansinspektionen/Finlands Bank/Statistikcentralen)

Utfärdat

Ersätter

Gäller fr.o.m.

**4.10.2004**

**1.1.2001**

31.12.2007

## RÄNTERISKER

**R**

Frekvens: **Kvartalsvis**  
Svarsnoggrannhet: **1 000 euro**  
Inlämningstid: **20 bankdagar**  
För definitionerna svarar: **Finansinspektionen**  
Uppgifterna tillställs: **Finansinspektionen**  
  
Uppgiftslämnarnivåer: **203, 284, 292, 293 och 294**

<b>R03</b>	Värdoförändring på fordringsbevis Poster i euro och övriga valutor (valutavis)	30.6.2005
<b>R05</b>	Aktiva Poster i euro och övriga valutor (valutavis)	30.6.2005
<b>R06</b>	Passiva Poster i euro och övriga valutor (valutavis)	30.6.2005
<b>R07</b>	Åtaganden utanför balansräkningen Poster i euro och övriga valutor (valutavis)	30.6.2005
<b>R08</b>	Derivatkontrakt, Värdoförändring på åtaganden utanför balansräkningen Poster i euro och övriga valutor (valutavis)	30.6.2005
<b>R10</b>	Nuvärdesmetoden: resultaten; poster i euro och övriga valutor (valutavis)	31.12.2007
<b>R15</b>	Nuvärdesmetoden: schablonmetoden, aktiva; poster i euro och övriga valutor (valutavis)	31.12.2007
<b>R16</b>	Nuvärdesmetoden: schablonmetoden, passiva; poster i euro och övriga valutor (valutavis)	31.12.2007
<b>R17</b>	Nuvärdesmetoden: schablonmetoden, derivatkontrakt poster i euro och övriga valutor (valutavis)	31.12.2007

**Anmärkning:** Blankettmallarna har siffran 0 i de fält där sök- eller beräkningsformler  
förekommer i Excelarbetsböckerna eller motsvarande program  
Inget rapporteras i de grå fälten

**Bilagor:** -

**Referenser:** Finansinspektionens standard RA4.5 om rapportering av ränterisk  
Definitioner av rapportörkategorierna framgår av bilaga 6 "Rapportörerna i kreditinstitutsrapporteringen"

**Upplysningar:** Finansinspektionen; Janne Kainu, Tel. 010 831 5396

## RÄNTERISKER

## VÄRDEFÖRÄNDRING PÅ FORDRINGSBEVIS

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

R03
-----

Rapporten gäller
/

*Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis*

**Valuta:**  Valuta, namn 

Radnr knr

Värde
05

05	2	Värdeförändring på fordringsbevis i handelslagret (trading book) då räntorna stiger med 1 procentenhet
----	---	--

--

95	1	Värdeförändring på fordringsbevis i låneportföljen (banking book) då räntorna stiger med 1 procentenhet
----	---	---

--









## RÄNTERISKER

## DERIVATKONTRAKT

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

R08
-----

Rapporten gäller /
--------------------------

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

**Valuta:**  Valuta, namn

Radnr	knr		Värde
			05
05	7	Värdeförändring på derivat i handelslagret (trading book) då räntorna stiger med 1 procentenhet	0
0505	2	Derivatkontrakt som skyddar fordringsbevis (förklarad på formuläret R03)	
0510	9	Derivatkontrakt som inte skyddar fordringsbevis (förklarad på formuläret R03)	
95	6	Värdeförändring på derivat i låneportföljen (banking book) då räntorna stiger med 1 procentenhet	0
9505	1	Derivatkontrakt som skyddar fordringsbevis (förklarad på formuläret R03)	
9510	8	Derivatkontrakt som inte skyddar fordringsbevis (förklarad på formuläret R03)	

## Ränterisk: Nuvärdesmetoden

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

<b>R10</b>
------------

Rapporten gäller
/

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

**Valuta:**  Valuta, namn

Belopp anges i tusentals euro

Radnr knr

05	1
----	---

Ränterisk beräknad med egen nuvärdesmetod

### Ränterisk enligt basscenario

10	8
----	---

Basscenario från Finansinspektionen

15	3
----	---

Beräknad med egen nuvärdesmetod

20	0
----	---

Beräknad enligt schablonmetoden

Räntepunktsförändring					
-200	-100	-50	50	100	200
05	10	15	20	25	30

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

Räntepunktsförändring	

Förändringen i euro	

## Ränterisk: Nuvärdesmetoden

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

Valuta:  Valuta, namn ▼

Radnr knr

05	6
10	3
15	8
27	2
60	4

Kontanta medel

Fordringar på kreditinstitut och centralbanker

Fordringar på allmänheten och offentliga samfund

Fordringsbevis och fordringsbevis belåningsbara hos centralbanken

Övriga tillgångar

### Klassificeringsfaktorer

J	B	C	O
krit	krit	krit	
Kr10	Kr01 Kr05		0903
Kr10	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
Kr10	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
Kr10	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
Kr10	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910

## BALANSRÄKNING: AKTIVA

Belopp anges i tusentals euro

0 mån. < t < 1 mån.	1 mån. < t < 3 mån.	3 mån. < t < 6 mån.	6 mån. < t < 9 mån.
C040001	C0401	C0402	C0403
05	10	15	20


Notera förtecknet för posterna:

Plus (+) om ränteeffekten är positiv

Minus (-) om ränteeffekten är negativ



## Ränterisk: Nuvärdesmetoden

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

Valuta:  Valuta, namn

Radnr	knr		Klassificeringsfaktorer		
			B krit	C krit	O
05	7	Skulder till kreditinstitut	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
10	4	Skulder till allmänheten och offentliga samfund			
1005	9	På anfordran betalbara depositioner	Kr01 Kr05		0903 0910
1010	6	Övriga	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
15	9	Skuldebrev emitterade till allmänheten	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
20	6	Övriga skulder	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910
40	0	Efterställda skulder	Kr01 Kr05	Kr03	0903 0910

## BALANSRÄKNING: PASSIVA

Belopp anges i tusentals euro

0 mån. < t < 1 mån.	1 mån. < t < 3 mån.	3 mån. < t < 6 mån.	6 mån. < t < 9 mån.
C040001	C0401	C0402	C0403
05	10	15	20

0	0	0	0

Notera förtecknet för posterna:

Plus (+) om ränteeffekten är positiv

Minus (-) om ränteeffekten är negativ



## Ränterisk: Nuvärdesmetoden

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

Valuta:  Valuta, namn

## DERIVATKONTRAKT

Belopp anges i tusentals euro

Radnr	knr		Klassificeringsfaktorer			0 mån. < t < 1 mån.	1 mån. < t < 3 mån.	3 mån. < t < 6 mån.	6 mån. < t < 9 mån.	9 mån. < t < 12 mån.	1 år < t < 2 år	2 år < t < 3 år	3 år < t < 4 år
			B krit	C krit	O	C040001	C0401	C0402	C0403	C0404	C0501	C0502	C0503
05	9	<b>Valutaderivat</b>				0	0	0	0	0	0	0	0
0505	0	Terminer	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904								
0510	0	Futurer	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904								
0515	1	Ränte- och valutaswappar	Kr01 Kr05	Kr03	0904 0910								
0520	1	Valutaoptioner				0	0	0	0	0	0	0	0
Köpta valutaoptioner													
052005	2	Call	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907								
052010	2	Put	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907								
Utfärdade valutaoptioner													
052015	3	Call	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907								
052020	3	Put	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907								
0530	2	Övriga derivatinstrument	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904 0907 0910								

Notera förtecknet för posterna:  
 Plus (+) om ränteeffekten är positiv  
 Minus (-) om ränteeffekten är negativ

<b>R17A</b>
-------------

Rapporten gäller
/

4 år < t < 5 år C0504	5 år < t < 7 år C1501 C1502	7 år < t < 10 år C1503 C1504 C1505	10 år < t < 15 år C16	15 år < t < 20 år C1701	t > 20 år C1702
45	50	55	60	65	70

0	0	0	0	0	0
0	0	0	0	0	0



## Ränterisk: Nuvärdesmetoden

## DERIVATKONTRAKT

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämnings tid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar:** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

Valuta:  Valuta, namn

Belopp anges i tusentals euro

Radnr	knr	Klassificeringsfaktorer B krit	C krit	O	0 mån. < t < 1 mån.	1 mån. < t < 3 mån.	3 mån. < t < 6 mån.	6 mån. < t < 9 mån.	9 mån. < t < 12 mån.	1 år < t < 2 år	2 år < t < 3 år	3 år < t < 4 år	4 år < t < 5 år	5 år < t < 7 år	7 år < t < 10 år	10 år < t < 15 år
					C040001 05	C0401 10	C0402 15	C0403 20	C0404 25	C0501 30	C0502 35	C0503 40	C0504 45	C1501 C1502 50	C1503 C1504 C1505 55	C16 60
10	1				0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
1005	2	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904												
1010	2	Kr01 Kr05	Kr03	0904 0910												
1015	3				0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Köpta ränteoptioner																
101505	4	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
101510	4	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
101515	5	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
101520	5	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
Utfärdade ränteoptioner																
101525	6	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
101530	6	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
101535	7	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
101540	7	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
1025	4	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904												
1030	4	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904												
1035	5	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904 0907 0910												

Notera förtecknet för posterna:  
 Plus (+) om ränteeffekten är positiv  
 Minus (-) om ränteeffekten är negativ

**R17B**

Rapporten  
gäller  
/

15 år < t < 20 år	t > 20 år
C1701	C1702
65	70

0	0
0	0









## Ränterisk: Nuvärdesmetoden

## DERIVATKONTRAKT

**Frekvens:** Kvartalsvis  
**Svarsnoggrannhet:** 1 000 euro  
**Inlämningstid:** 20 bankdagar  
**För definitionerna svarar** Finansinspektionen  
**Uppgifterna tillställs:** Finansinspektionen  
**Uppgiftslämnarnivåer:** 284, 292, 293, 294 och 203

Rapportörkategorierna skall rapportera poster i euro och poster i övriga valutor valutavis

Valuta:  Valuta, namn

Belopp anges i tusentals euro

Radnr	knr	Klassificeringsfaktorer B krit	C krit	O	Belopp anges i tusentals euro											
					0 mån. < t < 1 mån.	1 mån. < t < 3 mån.	3 mån. < t < 6 mån.	6 mån. < t < 9 mån.	9 mån. < t < 12 mån.	1 år < t < 2 år	2 år < t < 3 år	3 år < t < 4 år	4 år < t < 5 år	5 år < t < 7 år	7 år < t < 10 år	10 år < t < 15 år
					C040001	C0401	C0402	C0403	C0404	C0501	C0502	C0503	C0504	C1501 C1502	C1503 C1504 C1505	C16
					05	10	15	20	25	30	35	40	45	50	55	60
25	5				0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
2505	6	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904												
2510	6	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904 0910												
2515	7				0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
251505	8	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
251510	8	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
251515	9	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904 0907												
251520	9	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0904 0907												
2520	7				0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
252005	8	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
252010	8	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
252015	9	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
252020	9	Kr01 Kr05	Kr02 Kr05	0907												
2525	8	Kr01 Kr05		0904 0907 0910												

Notera förtecknet för posterna:  
 Plus (+) om ränteeffekten är positiv  
 Minus (-) om ränteeffekten är negativ

R17C

Rapporten  
gäller  
/

15 år < t < 20 år	t > 20 år
C1701	C1702
65	70

0	0
0	0


0	0



---