Euroopan unionin
virallinen lehti

FI
L-sarja

2025/379

12.3.2025

KOMISSION TÄYTÄNTÖÖNPANOASETUS (EU) 2025/379,

annettu 26 päivänä helmikuuta 2025,

täytäntöönpanoasetuksessa (EU) 2016/2070 säädettyjen teknisten täytäntöönpanostandardien muuttamisesta Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2013/36/EU 78 artiklan 2 kohdassa tarkoitetussa raportoinnissa unionissa sovellettavien vertailusalkkujen, raportointimallien ja raportointiohjeiden osalta

(ETA:n kannalta merkityksellinen teksti)

EUROOPAN KOMISSIO, joka

ottaa huomioon Euroopan unionin toiminnasta tehdyn sopimuksen,

ottaa huomioon oikeudesta harjoittaa luottolaitostoimintaa ja luottolaitosten ja sijoituspalveluyritysten vakavaraisuusvalvonnasta, direktiivin 2002/87/EY muuttamisesta sekä direktiivien 2006/48/EY ja 2006/49/EY kumoamisesta 26 päivänä kesäkuuta 2013 annetun Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2013/36/EU ([1]) ja erityisesti sen 78 artiklan 8 kohdan kolmannen alakohdan,

sekä katsoo seuraavaa:

(1) Direktiivin 2013/36/EU 78 artiklan 1 kohdan mukaan laitosten, jotka saavat käyttää sisäisiä menettelyjä, on toimitettava toimivaltaiselle viranomaiselleen asianmukaisin aikavälein, mutta vähintään vuosittain, sisäisten menettelyjensä mukaiset riskipainotettujen vastuuerien tai omien varojen vaatimusten laskelmien tulokset normisalkuissa olevien vastuidensa tai positioidensa osalta, jotta kyseinen toimivaltainen viranomainen voi arvioida kyseisten sisäisten menettelyjen laadun, jäljempänä 'menettelyvertailu'. Kyseisen direktiivin 78 artiklan 3 kohdan toisen alakohdan mukaan Euroopan pankkiviranomaisen, jäljempänä 'EPV', on laadittava menettelyvertailun tuloksiin perustuva raportti, joka auttaa toimivaltaisia viranomaisia arvioimaan laitosten sisäisten menettelyjen laatua. Menettelyvertailuja koskevat raportointivaatimukset määritellään komission täytäntöönpanoasetuksessa (EU) 2016/2070 ([2]), jota on muutettu useita kertoja. Jotta voidaan ottaa huomioon toimivaltaisten viranomaisten tekemien arviointien ja EPV:n laatimien kertomusten muuttunut painopiste sekä muutokset markkinariskiä koskevassa lainsäädännössä, on tarpeen päivittää uudelleen vertailusalkut ja kyseisessä täytäntöönpanoasetuksessa säädetyt raportointivaatimukset.

(2) Luottoriskin vertailun osalta ohjeita olisi muutettava siten, että niissä täsmennetään maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä (PD) ja tappio-osuutta (LGD) koskevien riskiparametrien raportoinnin pakollinen luonne varovaisuusmarginaalin, sääntelyn mukaisen lisäyksen ja laskusuhdanteen (DWT) komponenttien osalta, mikä voi aiheuttaa vaihtelua malleissa. Lisäksi olisi täsmennettävä, että laitosten on ilmoitettava toimivaltaisen viranomaisen antama mallien tunniste, jonka avulla yksinkertaistetaan raportoitavien tietojen kohdistamista.

(3) Markkinariskiä koskevien omien varojen uusien vaatimusten soveltamispäivää lykättiin komission delegoidulla asetuksella (EU) 2024/2795 ([3]). Sen vuoksi nykyisiä sisäisten mallien menetelmän lomakkeita ei korvata tässä menettelyssä. Samaan aikaan standardimenetelmän validointimalleja olisi laajennettava sisällyttämällä niihin uusia salkkuja verrattuna vuoden 2024 menettelyyn, jonka soveltamisalaan kuuluivat ainoastaan korkoinstrumentit. Tällä pyritään varmistamaan asianmukainen valvonta ja kokonaisriskipainolattian laskennassa käytettävän uuden standardimenetelmän sujuva käyttöönotto.

([1]) EUVL L 176, 27.6.2013, s. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj.

([2]) Komission täytäntöönpanoasetus (EU) 2016/2070, annettu 14 päivänä syyskuuta 2016, lomakkeiden, määritelmien ja tietotekniikkaratkaisujen teknisistä täytäntöönpanostandardeista, joita laitosten on käytettävä raportoidessaan Euroopan pankkiviranomaiselle ja toimivaltaisille viranomaisille Euroopan parlamentin ja neuvoston direktiivin 2013/36/EU 78 artiklan 2 kohdan mukaisesti (EUVL L 328, 2.12.2016, s. 1), ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Komission delegoitu asetus (EU) 2024/2795, annettu 24 päivänä heinäkuuta 2024, Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 575/2013 muuttamisesta markkinariskiä koskevien omien varojen vaatimusten soveltamispäivän osalta (EUVL L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) Sen vuoksi täytäntöönpanoasetusta (EU) 2016/2070 olisi muutettava.

(5) Tämä asetus perustuu teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksiin, jotka EPV on toimittanut komissiolle.

(6) EPV on järjestänyt avoimia julkisia kuulemisia niistä teknisten täytäntöönpanostandardien luonnoksista, joihin tämä asetus perustuu, analysoinut niihin mahdollisesti liittyviä kustannuksia ja hyötyjä sekä pyytänyt neuvoa Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 1093/2010 ([4]) 37 artiklan mukaisesti perustetulta pankkialan osallisryhmältä,

ON HYVÄKSYNYT TÄMÄN ASETUKSEN:

1 artikla

Muutetaan täytäntöönpanoasetus (EU) 2016/2070 seuraavasti:

1) Korvataan liite IV tämän asetuksen liitteessä I olevalla tekstillä.

2) Korvataan liite V tämän asetuksen liitteessä II olevalla tekstillä.

3) Korvataan liite VI tämän asetuksen liitteessä III olevalla tekstillä.

4) Korvataan liite VII tämän asetuksen liitteessä IV olevalla tekstillä.

5) Korvataan liite X tämän asetuksen liitteessä V olevalla tekstillä.

2 artikla

Tämä asetus tulee voimaan kahdentenakymmenentenä päivänä sen jälkeen, kun se on julkaistu *Euroopan unionin virallisessa lehdessä*.

Tämä asetus on kaikilta osiltaan velvoittava, ja sitä sovelletaan sellaisenaan kaikissa jäsenvaltioissa.

Tehty Brysselissä 26 päivänä helmikuuta 2025.

Komission puolesta
Puheenjohtaja
Ursula VON DER LEYEN

([4]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 1093/2010, annettu 24 päivänä marraskuuta 2010, Euroopan valvontaviranomaisen (Euroopan pankkiviranomainen) perustamisesta sekä päätöksen N:o 716/2009/EY muuttamisesta ja komission päätöksen 2009/78/EY kumoamisesta (EUVL L 331, 15.12.2010, s. 12), ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

LIITE I

”LIITE IV

VERTAILUSALKUT VALVONTATARKOITUKSIIN – TULOKSET

I OSA: YLEISET OHJEET

II OSA: LOMAKEKOHTAISET OHJEET

C 101 – Tiedot vastuueristä matalan maksukyvyttömyysosuuden salkuissa vastapuolen mukaan

C 102 – Tiedot vastuueristä matalan maksukyvyttömyysosuuden salkuissa

C 103 – Tiedot vastuueristä korkean maksukyvyttömyysosuuden salkuissa

C 105.01 – Sisäisten mallien määrittely

C 105.02 - Sisäisten mallien kohdennus salkkuihin

C 105.03 - Sisäisten mallien kohdennus maihin

I OSA: YLEISET OHJEET

1. Tiedot on ilmoitettava ainoastaan sellaisista vastapuolista ja salkuista, joiden osalta viitepäivänä on todellinen vastuu joko alkuperäisenä vastuuna tai luottoriskin vähentämismenetelmän jälkeisenä vastuuna. Vastapuolia ja salkkuja, joiden osalta viitepäivänä ei ole vastuuta, ei ilmoiteta.

2. Tiedot on ilmoitettava ainoastaan sellaisista vastuista, joiden osalta toimivaltainen viranomainen on hyväksynyt sisäisen mallin riskipainotettujen vastuuerien (RWA) laskemiseksi Lomakkeessa C 101 ei ilmoiteta ”STDA”:han päättyviä vastapuolitunnuksia. Liitteessä I olevan lomakkeen C 101 jäljelle jäävien vastapuolitunnuksien sekä lomakkeissa C 102 ja C 103 tarkoitettujen vertailusalkkujen osalta ei oteta huomioon standardimenetelmän mukaisia vastuita eikä vastuita, joiden osalta toimivaltainen viranomainen on sallinut standardimenetelmän väliaikaisen tai pysyvän osittaisen käytön.

3. Kentät, joilla kerätään sellaisia tietoja, joita ei sovelleta tai jotka on määritelty puutteellisesti, on joko jätettävä tyhjäksi tai niihin on tehtävä merkintä ”NULL” (”EI MITÄÄN”). Näin tehdään myös sellaisten EAD-painotettujen määrien osalta, joita ei voida laskea. Tietokentät, joita ei ole pakko ilmoittaa, voidaan jättää tyhjiksi, tai myös niihin voidaan tehdä merkintä ”NULL”. Arvoa nolla käytetään ainoastaan, kun tarkoituksena on ilmoittaa määrän tai parametrin olevan nolla. Kenttää ei saa jättää tyhjäksi eikä siihen saa lisätä merkintää ”NULL”, kun ilmoitettava määrä tai parametri on nolla.

4. Rahamäärät on ilmoitettava samalla tavoin kuin ne ilmoitetaan tietyn viitepäivän omien varojen vaatimusten laskennassa komission täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 ([1]) mukaisesti.

([1]) Komission täytäntöönpanoasetus (EU) 2021/451, annettu 17 päivänä joulukuuta 2020, teknisistä täytäntöönpanostandardeista Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 575/2013 soveltamiseksi laitosten vakavaraisuusvalvontaan liittyvän raportoinnin osalta ja täytäntöönpanoasetuksen (EU) N:o 680/2014 kumoamisesta (EUVL L 97, 19.3.2021, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

II OSA: LOMAKEKOHTAISET OHJEET

C 101 – Tiedot vastuueristä matalan maksukyvyttömyysosuuden salkuissa vastapuolen mukaan

Erityisrahoitusvastuita ei oteta huomioon.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Vastapuolitunnus	Liitteessä I olevan lomakkeen C 101 sarake 0010	Tässä ilmoitetaan liitteessä I olevan lomakkeen C 101 sarakkeessa 0010 oleva vastapuolitunnus, jolla määritetään matalan maksukyvyttömyysosuuden salkkujen salkkuotoksiin sisältyvä vastapuoli. Tämä tunnus on rivin tunniste, joka on yksilöllinen lomakkeen jokaiselle riville.
0020	Vastuuryhmä	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä II oleva 76 kohta	Jokainen vastapuoli on luokiteltava johonkin seuraavista vastuuryhmistä: a) keskuspankit ja valtiot; b) laitokset; c) yritykset – pk-yritykset (pienet ja keskisuuret yritykset); d) yritykset – erityisrahoitusvastuut; e) yritykset – muut; f) vähittäisvastuut – kiinteistövakuudelliset (pk-yritykset); g) vähittäisvastuut – kiinteistövakuudelliset (muut kuin pk-yritykset); h) vähittäisvastuut – uudistettavat vähittäisvastuut; i) vähittäisvastuut – muut (pk-yritykset); j) vähittäisvastuut – muut (muut kuin pk-yritykset); k) ei sovelleta. Vaihtoehtoa ”ei sovelleta” käytetään, kun mikään luettelon vastauksista ei ole sovellettavissa (esim. silloin, kun vastapuolen vastuut luokitellaan moniin vastuuryhmiin, joista mikään ei ole selkeästi hallitseva).
0040	Luokitus		Tässä ilmoitetaan vastapuolelle annettu laitoksen soveltaman sisäisen luokitusjärjestelmän luokka. Luokituksen on noudatettava numerojärjestystä 1, 2, 3 jne. pienimmästä riskistä suurimpaan riskiin, lukuun ottamatta tapauksia, joiden maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä kuvaava PD-luku on 100 prosenttia. Jos laitos käyttää jatkuvaa luokitusasteikkoa Euroopan parlamentin ja neuvoston asetuksen (EU) N:o 575/2013 ([2]) 169 artiklan 3 kohdan mukaisesti, on käytettävä täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.02 sarakkeessa 0005 ilmoitettuja luokkia. Jos vastapuolen vastuut on sijoitettu useisiin eri luokkiin asetuksen (EU) N:o 575/2013 172 artiklan 1 kohdan e alakohdan i tai iii alakohdan mukaisesti, on ilmoitettava luokitusluokka nolla (0).

([2]) Euroopan parlamentin ja neuvoston asetus (EU) N:o 575/2013, annettu 26 päivänä kesäkuuta 2013 , luottolaitosten ja sijoituspalveluyritysten vakavaraisuusvaatimuksista ja asetuksen (EU) N:o 648/2012 muuttamisesta (EUVL L 176, 27.6.2013, s. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0050	Vastapuolen viimeisimmän luokituksen päivämäärä		Tässä ilmoitetaan vastapuolen viimeisimmän luokituksen päivämäärä.
0060	Maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä kuvaava luku (PD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0010.	Tässä ilmoitetaan vastapuolelle annettu PD-luku. PD-luvun on oltava sama, jota käytetään riskipainotettujen vastuuerien laskennassa, lukuun ottamatta asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisten toimenpiteiden vaikutusta. PD-luku ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1.
0070	Maksukyvyttömyystilanne		Tässä ilmoitetaan vastapuolen maksukyvyttömyystilanne. Se on jompikumpi seuraavista asetuksen (EU) N:o 575/2013 178 artiklan mukaisesti: a) maksukyvyttömyystilassa; b) maksukykyinen.
0080	Alkuperäinen vastuu ennen luottovasta-arvokerrointen soveltamista	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0020.	Tässä ilmoitetaan alkuperäisen vastuun arvo, joka on laskettu ennen minkäänlaisten arvonoikaisujen, varausten, luottoriskin vähentämismenetelmistä aiheutuvien vaikutusten tai luottovasta-arvokertoimien huomioon ottamista.
0090	Vastuun määrä, josta on vähennetty luottoriskin vähentämismenetelmien substituutiovaikutuksista johtuvat erät, ennen luottovasta-arvokerrointen soveltamista	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0090.	Tässä ilmoitetaan määrä, johon luottovasta-arvokertoimia sovelletaan, jotta saadaan maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD) (sarake 0110). Siinä otetaan huomioon luottoriskin vähentämismenetelmät ja niihin liittyvät vastuuta koskevat substituutiovaikutukset.
0100	Luottovasta-arvokerroin	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohta	Tässä ilmoitetaan luottovasta-arvokerrointen (CF) painotettu keskiarvo. Painoina käytetään määriä, joihin luottovasta-arvokertoimia sovelletaan, jotta saadaan maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD). Niiden vastapuolten osalta, joiden järjestelyt vastaavat yksinomaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuja eriä, luottovasta-arvokerrointen painotetun keskiarvon on perustuttava kaikkiin järjestelyihin. Niiden vastapuolten osalta, joiden järjestelyt eivät kuulu asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, luottovasta-arvokerroin jätetään joko tyhjäksi tai kenttään lisätään merkintä ”NULL”.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Niiden vastapuolten osalta, joilla on asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuja eriä vastaavia järjestelyjä ja järjestelyjä, jotka eivät kuulu kyseisen asetuksen 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, luottovasta-arvokertoimen ilmoitetun painotetun keskiarvon on perustuttava ainoastaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuja eriä vastaaviin järjestelyihin. Erityisesti järjestelyitä, jotka vastaavat kyseisen asetuksen 166 artiklan 10 kohdassa tarkoitettuja eriä, ei oteta laskennassa huomioon. Jos laitos soveltaa omia luottovasta-arvokerroinestimaatteja asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, näitä luottovasta-arvokertoimia on käytettävä luottovasta-arvokerrointen painotetun keskiarvon laskemiseksi. Jos laitos ei sovella omia luottovasta-arvokerroinestimaatteja asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, on käytettävä asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa annettuja sääntelynmukaisia luottovasta-arvokertoimia. Luottovasta-arvokerroin ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1.
0110	Maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0110.	Tässä ilmoitetaan vastuuarvo.
0120	Vakuusarvo	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarakkeet 0150–0210.	Tässä ilmoitetaan vakuuksien markkina-arvo.
0130	Hypoteettiset tappio-osuusarvot (LGD-arvot) ylimmän etuoikeusluokan vakuudettomille vastuille, joissa ei ole vakuuden asettamiskieltoa	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 161 artikla	Hypoteettiset omat tappio-osuusestimaatit (LGD-estimaatit), joita laitos soveltaisi vastapuolen vastuisiin, on ilmoitettava seuraavasti: a) vastuiden laajuus on sama kuin sarakkeessa 0150 ilmoitetun LGD-arvon osalta; b) vastuut ovat ylimmän etuoikeusluokan vakuudettomia vastuita; c) vakuuden asettamiskieltoa ei sovelleta. Vakuuden asettamiskielto on lauseke, jossa todetaan, että lainaaja tai lainan myöntäjä ei anna varoistaan vakuutta toiselle osapuolelle.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0140	Hypoteettiset LGD-arvot ylimmän etuoikeusluokan vakuudettomille vastuille, joissa on vakuuden asettamiskielto	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 161 artikla	Hypoteettiset omat tappio-osuusestimaatit (LGD-estimaatit), joita laitos soveltaisi vastapuolen vastuisiin, on ilmoitettava seuraavasti: a) vastuiden laajuus on sama kuin sarakkeessa 0150 ilmoitetun LGD-arvon osalta; b) vastuut ovat ylimmän etuoikeusluokan vakuudettomia vastuita; c) vakuuden asettamiskieltoa sovelletaan. Vakuuden asettamiskielto on lauseke, jossa todetaan, että lainaaja tai lainan myöntäjä ei anna varoistaan vakuutta toiselle osapuolelle.
0150	Tappio-osuus (LGD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarakkeet 0230 ja 0240.	Tässä ilmoitetaan vastapuolen vastuiden LGD-lukujen EAD-painotettu keskiarvo. LGD-lukujen on oltava ne luvut, joita käytettiin riskipainotettujen vastuuerien laskennassa. Tarkemmin sanottuna, jos laitos on saanut toimivaltaiselta viranomaiseltaan luvan käyttää omia LGD-estimaattejaan, LGD-lukujen on perustuttava laitoksen omiin estimaatteihin. Muussa tapauksessa LGD-lukujen on perustuttava sääntelyn mukaisiin LGD-arvoihin, joissa otetaan huomioon sovellettava riskinhallinta. Suurten säänneltyjen finanssialan yhteisöjen ja sääntelemättömien finanssialan yhteisöjen LGD-luvut on otettava huomioon. Asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisesti käyttöön otettujen toimenpiteiden vaikutusta ei oteta huomioon. LGD on ilmaistava arvona välillä 0 ja 1.
0160	Maturiteetti	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0250.	Tässä ilmoitetaan EAD-painotettu vastapuolen vastuiden maturiteetti. Se ilmaistaan tiettynä määränä päiviä.
0170	Riskipainotetut vastuuerät (RWA)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0260.	Tässä ilmoitetaan riskipainotetut vastuuerät tukikerrointen (pk-yritysten ja infrastruktuurin tukikertoimet) soveltamisen jälkeen. Riskipainotettuihin vastuueriin ei sisällytetä mahdollisten asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisten toimenpiteiden vaikutusta.

C 102 – Tiedot vastuueristä matalan maksukyvyttömyysosuuden salkuissa

Liitteessä I tarkoitetuista salkuista, joilla on muu vakuustilanne kuin ”ei sovelleta”, ei tarvitse toimittaa seuraavia tietoja, jos hyväksyttyyn malliin ei kuulu erillisiä LGD-laskelmia vastuun vakuudellisille ja vakuudettomille osille: tappio-osuus (LGD) (sarake 0130), LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä (sarake 0131), LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä (sarake 0132), LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia (sarake 0133), odotetun tappion määrä (sarake 0150) ja riskipainotetut vastuuerät (RWA) (sarake 0170).

Salkuista, joiden osalta sovelletaan sääntelymenetelmää ”Erityisen luotonannon luokittelukriteerit”, ei ilmoiteta seuraavia tietoja: maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä kuvaava luku (PD) (sarake 0060), PD-luku ilman valvontatoimenpiteitä (sarake 0061), PD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä (sarake 0062), tappio-osuus (LGD) (sarake 0130), LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä (sarake 0131), LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä (sarake 0132), LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia (sarake 0133).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Salkun tunniste	Liitteessä I olevan lomakkeen C 102 sarake 0010	Tässä ilmoitetaan salkun määrittävä liitteessä I olevan lomakkeen C.102 sarakkeessa 0010 oleva salkun tunniste. Tämä on rivin tunniste, joka on yksilöllinen lomakkeen jokaiselle riville. Vastuiden osoittaminen salkun tunnisteisiin ei ole eksklusiivista: vastuut tai vastuiden osat on ilmoitettava kunkin sovellettavan salkun tunnisteen alla.
0040	Velallisten lukumäärä		Tässä ilmoitetaan velallisten lukumäärä. Sen on perustuttava velallisiin, joiden osalta joko sarakkeessa 0080 tai sarakkeessa 0090 on ilmoitettu positiivinen arvo. Jos sovelletaan luottoriskin vähentämistekniikasta johtuvaa täyttä substituutiota, alkuperäinen velallinen lisätään alkuperäisen salkun ”velallisten lukumäärään” ja takaaja lisätään takaajan salkun ”velallisten lukumäärään”.
0060	Maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä kuvaava luku (PD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0010	PD-luvun on oltava sama, jota käytetään riskipainotettujen vastuuerien laskennassa, lukuun ottamatta asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisesti käyttöön otettujen mahdollisten toimenpiteiden vaikutusta. Yksittäistä vastapuoliluokkaa tai -ryhmää vastaavien salkkujen osalta on ilmoitettava kullekin vastapuoliluokalle tai -ryhmälle annettu PD-luku. Kun on kyse salkuista, jotka vastaavat eri vastapuoliluokkien taikka -ryhmien yhteenlaskettua kokonaisuutta, on tällaiseen kokonaisuuteen kuuluville vastuille annetuista PD-luvuista ilmoitettava EAD-painotettu keskimääräinen arvo. PD-luku ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1.
0061	PD-luku ilman valvontatoimenpiteitä		PD-luku ilman valvontatoimenpiteitä on asetuksen (EU) N:o 575/2013 179 ja 180 artiklan säännöksiin perustuva PD-luku, joka sisältää laitoksen lisäämän varovaisuusmarginaalin mutta joka ei sisällä toimivaltaisten viranomaisten määräämiä toimenpiteitä (kuten kertoimia, korotustekijöitä, alarajoja tai muita vastaavia toimenpiteitä, jotka suoraan kasvattavat PD-lukua). Yksittäistä luokkaa tai ryhmää vastaavien salkkujen osalta ilmoitetaan kyseisen luokan PD-luku, joka sisältää varovaisuusmarginaalin mutta joka ei sisällä valvontatoimenpiteitä. Kun on kyse salkuista, jotka vastaavat eri vastapuoliluokkien taikka -ryhmien yhteenlaskettua kokonaisuutta, ilmoitetaan vastaavien vastuiden sellaisten PD-lukujen EAD-painotettu keskimääräinen arvo, jotka sisältävät varovaisuusmarginaalit mutta jotka eivät sisällä valvontatoimenpiteitä. PD-luku ilman valvontatoimenpiteitä ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Jos laitos ei pysty erittelemään asiaankuuluvia varovaisia mukautuksia, sovelletaan I osan 3 kohtaa.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0062	PD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä		PD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä on PD-luku, joka ei sisällä laitoksen asetuksen (EU) N:o 575/2013 179 artiklan 1 kohdan f alakohdan ja 180 artiklan 1 kohdan e alakohdan mukaisesti lisäämää varovaisuusmarginaalia eikä toimivaltaisten viranomaisten määräämien toimenpiteiden (kuten kerrointen, korotustekijöiden, alarajojen tai muiden vastaavien toimenpiteiden, jotka suoraan kasvattavat PD-lukua) vaikutusta. Yksittäistä luokkaa tai ryhmää vastaavien salkkujen osalta ilmoitetaan kyseisen luokan PD-luku, joka ei sisällä varovaisuusmarginaalia eikä valvontatoimenpiteitä. Kun on kyse salkuista, jotka vastaavat eri vastapuoliluokkien taikka -ryhmien yhteenlaskettua kokonaisuutta, ilmoitetaan vastaavien vastuiden sellaisten PD-lukujen EAD-painotettu keskimääräinen arvo, jotka eivät sisällä varovaisuusmarginaaleja eivätkä valvontatoimenpiteitä. PD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Jos laitos ei pysty erittelemään asiaankuuluvia varovaisia mukautuksia, sovelletaan I osan 3 kohtaa.
0080	Alkuperäinen vastuu ennen luottovasta-arvokerrointen soveltamista	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0020	Tässä ilmoitetaan alkuperäisen vastuun arvo, joka on laskettu ennen minkäänlaisten arvonoikaisujen, varausten, luottoriskin vähentämismenetelmistä aiheutuvien vaikutusten tai luottovasta-arvokertoimien huomioon ottamista.
0090	Vastuun määrä, josta on vähennetty luottoriskin vähentämismenetelmien substituutiovaikutuksista johtuvat erät, ennen luottovasta-arvokerrointen soveltamista	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0090	Tässä ilmoitetaan määrä, johon luottovasta-arvokertoimia sovelletaan, jotta saadaan maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD) (sarake 0110). Siinä otetaan huomioon luottoriskin vähentämismenetelmät ja niihin liittyvät vastuuta koskevat substituutiovaikutukset.
0100	Luottovasta-arvokerroin	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohta	Tässä ilmoitetaan luottovasta-arvokerrointen (CF) painotettu keskiarvo. Painoina käytetään määriä, joihin luottovasta-arvokertoimia sovelletaan, jotta saadaan maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD). Niiden salkkujen osalta, jotka sisältävät yksinomaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuja eriä vastaavia järjestelyitä, luottovasta-arvokerrointen painotetun keskiarvon on perustuttava kaikkiin järjestelyihin. Niiden salkkujen osalta, joihin sisältyvistä järjestelyistä mikään ei kuulu asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklassa tarkoitettujen erien piiriin, luottovasta-arvokerroin jätetään joko tyhjäksi tai kenttään lisätään merkintä ”NULL”. Sellaisten salkkujen osalta, joihin sisältyy asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuja eriä vastaavia järjestelyjä ja järjestelyjä, jotka eivät kuulu kyseisen asetuksen 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, luottovasta-arvokertoimen ilmoitetun painotetun keskiarvon on perustuttava ainoastaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuja eriä vastaaviin järjestelyihin. Erityisesti järjestelyitä, jotka vastaavat kyseisen asetuksen 166 artiklan 10

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			kohdassa tarkoitettuja eriä, ei oteta laskennassa huomioon. Jos laitos soveltaa omia luottovasta-arvokerroinestimaatteja asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, näitä luottovasta-arvokertoimia on käytettävä luottovasta-arvokerrointen painotetun keskiarvon laskemiseen. Jos laitos ei sovella omia luottovasta-arvokerroinestimaatteja asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa tarkoitettuihin eriin, on käytettävä asetuksen (EU) N:o 575/2013 166 artiklan 8 kohdassa annettuja sääntelynmukaisia luottovasta-arvokertoimia. Luottovasta-arvokerroin ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1.
0110	Maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0110	Tässä ilmoitetaan vastuuarvo.
0120	Vakuusarvo	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarakkeet 0150–0210.	Tässä ilmoitetaan vakuuksien markkina-arvo.
0130	Tappio-osuus (LGD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarakkeet 0230 ja 0240.	Tässä ilmoitetaan kyseisen salkun vastuiden LGD-lukujen EAD-painotettu keskiarvo. LGD-lukujen on oltava ne luvut, joita käytettiin riskipainotettujen vastuuerien laskennassa. Tarkemmin sanottuna, jos laitos on saanut toimivaltaiselta viranomaiseltaan luvan käyttää omia LGD-estimaattejaan, LGD-lukujen on perustuttava laitoksen omiin estimaatteihin. Muussa tapauksessa LGD-lukujen on perustuttava sääntelyn mukaisiin LGD-arvoihin, joissa otetaan huomioon sovellettava riskinhallinta. Suurten säänneltyjen finanssialan yhteisöjen ja sääntelemättömien finanssialan yhteisöjen vastuut ja niihin liittyvät LGD-luvut on otettava huomioon. Asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisesti käyttöön otettujen toimenpiteiden vaikutusta ei oteta huomioon. LGD on ilmaistava arvona välillä 0 ja 1.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0131	LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä		LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä on asetuksen (EU) N:o 575/2013 179 ja 181 artiklan säännöksiin perustuva LGD-luku, joka sisältää laitoksen lisäämän varovaisuusmarginaalin mutta joka ei sisällä toimivaltaisten viranomaisten määräämiä toimenpiteitä (kuten kertoimia, korotustekijöitä, alarajoja tai muita vastaavia toimenpiteitä, jotka suoraan kasvattavat LGD-lukua). Yksittäistä luokkaa tai ryhmää vastaavien salkkujen osalta ilmoitetaan kyseisen luokan LGD-luku, joka sisältää varovaisuusmarginaalin mutta joka ei sisällä valvontatoimenpiteitä. Kun on kyse salkuista, jotka vastaavat eri vastapuoliluokkien taikka -ryhmien yhteenlaskettua kokonaisuutta, ilmoitetaan vastaavien vastuiden sellaisten LGD-lukujen EAD-painotettu keskimääräinen arvo, jotka sisältävät varovaisuusmarginaalit mutta jotka eivät sisällä valvontatoimenpiteitä. LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Jos laitos ei pysty erittelemään asiaankuuluvia varovaisia mukautuksia, sovelletaan I osan 3 kohtaa.
0132	LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä		LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä on LGD-luku, joka ei sisällä laitoksen asetuksen (EU) N:o 575/2013 179 artiklan 1 kohdan f alakohdan ja 181 artiklan mukaisesti lisäämää varovaisuusmarginaalia eikä toimivaltaisten viranomaisten määräämien toimenpiteiden (kuten kerrointen, korotustekijöiden, alarajojen tai muiden vastaavien toimenpiteiden, jotka suoraan kasvattavat LGD-lukua) vaikutusta. Yksittäistä luokkaa tai ryhmää vastaavien salkkujen osalta ilmoitetaan kyseisen luokan LGD-luku, joka ei sisällä varovaisuusmarginaalia eikä valvontatoimenpiteitä. Kun on kyse salkuista, jotka vastaavat eri vastapuoliluokkien taikka -ryhmien yhteenlaskettua kokonaisuutta, ilmoitetaan vastaavien vastuiden sellaisten LGD-lukujen EAD-painotettu keskimääräinen arvo, jotka eivät sisällä varovaisuusmarginaaleja eivätkä valvontatoimenpiteitä. LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Jos laitos ei pysty erittelemään asiaankuuluvia varovaisia mukautuksia, sovelletaan I osan 3 kohtaa.
0133	LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia		LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia on LGD-luku, joka ei sisällä laitoksen asetuksen (EU) N:o 575/2013 179 artiklan 1 kohdan f alakohdan ja 181 artiklan mukaisesti lisäämää varovaisuusmarginaalia, toimivaltaisten viranomaisten määräämien toimenpiteiden (kuten kerrointen, korotustekijöiden, alarajojen tai muiden vastaavien toimenpiteiden, jotka suoraan kasvattavat LGD-lukua) vaikutusta eikä kyseisen asetuksen 181 artiklan 1 kohdan b alakohdassa vaadittua laskusuhdannekomponenttia. Yksittäistä luokkaa tai ryhmää vastaavien salkkujen osalta ilmoitetaan kyseisen luokan LGD-luku, joka ei sisällä varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä eikä laskusuhdannekomponenttia. Kun on kyse salkuista, jotka vastaavat eri vastapuoliluokkien taikka -ryhmien yhteenlaskettua kokonaisuutta, ilmoitetaan vastaavien vastuiden sellaisten LGD-lukujen EAD-painotettu keskimääräinen arvo, jotka eivät sisällä varovaisuusmarginaaleja, valvontatoimenpiteitä eivätkä laskusuhdannekomponenttia.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Jos laitos ei pysty erittelemään asiaankuuluvia varovaisia mukautuksia, sovelletaan I osan 3 kohtaa.
0140	Maturiteetti	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0250	Tässä ilmoitetaan EAD-painotettu maturiteetti. Se ilmaistaan tiettynä määränä päiviä. Näitä tietoja ei ilmoiteta sellaisista vastuista, joiden riskipainotettuja vastuueriä laskettaessa ei huomioida maturiteettia. Erityisesti maturiteettia ei ilmoiteta sellaisista salkuista, jotka kuuluvat vastuuryhmään ”vähittäisvastuut”.
0150	Odotetun tappion määrä	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0280	Tässä ilmoitetaan odotetun tappion määrä.
0160	Maksukyvyttömyystilassa olevia vastuita koskevat varaukset	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 09.02 sarakkeet 0050, 0055 ja 0060.	Tässä ilmoitetaan maksukyvyttömyystilassa olevia vastuita koskevat varaukset. Näitä ovat kaikki asetuksen (EU) N:o 575/2013 110 artiklassa tarkoitetut maksukyvyttömyystilassa olevia vastuita koskevat yleiset ja erityiset luottoriskioikaisut. (Kertaluonteiset) luottoriskioikaisut, joita laitos soveltaa maksukyvyttömyyden määritelmän täytäntöönpanon muutosten yhteydessä, on ilmoitettava kuten ne on kirjattu laitoksen tietokantaan.
0170	Riskipainotetut vastuuerät (RWA)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0260	Tässä ilmoitetaan riskipainotetut vastuuerät tukikerrointen (pk-yritysten ja infrastruktuurin tukikertoimet) soveltamisen jälkeen. Riskipainotettuihin vastuueriin ei sisällytetä mahdollisten asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisten toimenpiteiden vaikutusta.
0180	RWA, standardimenetelmä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 kolmannen osan II osaston 2 luku.	RWA, standardimenetelmä, on se hypoteettinen riskipainotettujen vastuuerien määrä, joka saadaan soveltamalla vastuisiin luottoriskin standardimenetelmää IBR-menetelmän sijasta.

C 103 – Tiedot vastuueristä korkean maksukyvyttömyysosuuden salkuissa

Liitteessä I tarkoitetuista salkuista, joilla on muu vakuustilanne kuin ”ei sovelleta”, ei tarvitse toimittaa seuraavia tietoja, jos hyväksyttyyn malliin ei kuulu erillisiä LGD-laskelmia vastuun vakuudellisille ja vakuudettomille osille: tappio-osuus (LGD) (sarake 0130), LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä (sarake 0131), LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä (sarake 0132), LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia (sarake 0133), odotetun tappion määrä (sarake 0150), riskipainotetut vastuuerät (RWA) (sarake 0170), viimeisimmän vuoden tappioaste (sarake 0210) ja tappioaste viiden vuoden ajalta (sarake 0220).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Salkun tunniste		Tässä ilmoitetaan salkun määrittävä liitteessä I olevan lomakkeen C 103 sarakkeessa 0010 oleva salkun tunniste. Tämä on rivin tunniste, joka on yksilöllinen lomakkeen jokaiselle riville. Vastuiden osoittaminen salkun tunnisteisiin ei ole eksklusiivista: vastuut tai vastuiden osat on ilmoitettava kussakin sovellettavassa salkun tunnisteessa.
0040	Velallisten lukumäärä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0040 koskevia ohjeita.
0060	Maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä kuvaava luku (PD)		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0060 koskevia ohjeita.
0061	PD-luku ilman valvontatoimenpiteitä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0061 koskevia ohjeita.
0062	PD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0062 koskevia ohjeita.
0080	Alkuperäinen vastuu ennen luottovasta-arvokerrointen soveltamista		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0080 koskevia ohjeita.
0090	Vastuun määrä, josta on vähennetty luottoriskin vähentämismenetelmien substituutiovaikutuksista johtuvat erät, ennen luottovasta-arvokerrointen soveltamista		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0090 koskevia ohjeita.
0100	Luottovasta-arvokerroin		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0100 koskevia ohjeita.
0110	Maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD)		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0110 koskevia ohjeita.
0120	Vakuusarvo		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0120 koskevia ohjeita.
0130	Tappio-osuus (LGD)		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0130 koskevia ohjeita.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0131	LGD-luku ilman valvontatoimenpiteitä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0131 koskevia ohjeita.
0132	LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia ja valvontatoimenpiteitä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0132 koskevia ohjeita.
0133	LGD-luku ilman varovaisuusmarginaalia, valvontatoimenpiteitä ja laskusuhdannekomponenttia		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0133 koskevia ohjeita.
0140	Maturiteetti		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0140 koskevia ohjeita.
0150	Odotetun tappion määrä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0150 koskevia ohjeita.
0160	Maksukyvyttömyystilassa olevia vastuita koskevat varaukset		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0160 koskevia ohjeita.
0170	Riskipainotetut vastuuerät (RWA)		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0170 koskevia ohjeita.
0180	RWA, standardimenetelmä		Sovelletaan liitteessä I olevan lomakkeen C 102 saraketta 0180 koskevia ohjeita.
0190	Viimeisimmän vuoden maksukyvyttömyysaste		Tässä ilmoitetaan viimeisimmän vuoden maksukyvyttömyysaste. Tällöin maksukyvyttömyysaste lasketaan seuraavien arvojen välisenä suhteena: a) niiden vastuiden summa (alkuperäinen vastuu, sarake 0080, mitattuna vuosi ennen viitepäivää), jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa tarkalleen vuosi ennen viitepäivää mutta jotka tulivat maksukyvyttömyystilaan viitepäivää edeltävän vuoden aikana, b) niiden vastuiden summalla (alkuperäinen vastuu, sarake 0080, mitattuna vuosi ennen viitepäivää), jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa vuosi ennen viitepäivää. Viitepäivää edeltävän vuoden aikana syntyneitä uusia vastuita ei oteta huomioon. Vastuut, jotka olivat maksukyvyttömyystilassa mutta tervehtyivät viitepäivää edeltävän vuoden aikana, otetaan huomioon sekä osoittajassa että nimittäjässä. Saman velallisen useat maksukyvyttömyystapaukset otetaan huomioon vain kerran.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Nämä tiedot ilmoitetaan vain sellaisten salkun tunnisteiden osalta, jotka koskevat muita kuin maksukyvyttömyystilassa olevia vastuita. Tiedot on ilmaistava arvona välillä 0 ja 1. Maksukyvyttömyystapauksia ja maksukyvyttömyyspäiviä käytetään kuten ne on kirjattu tapahtumahetkellä sovellettavan maksukyvyttömyyden määritelmän täytäntöönpanon mukaisesti, eli laitoksen on katsottava, että maksukyvyttömyys on tapahtunut laitoksen tapahtumahetkellä soveltaman maksukyvyttömyyden määritelmän mukaisesti. Maksukyvyttömyyden määritelmän muutokset otetaan huomioon vasta niiden täytäntöönpanopäivästä alkaen eikä maksukyvyttömyyden määritelmän muutoksia voida soveltaa takautuvasti tarkasteltava olevan maksukyvyttömyystapahtuman jälkeen (takautuva simulointi).
0200	Maksukyvyttömyysaste viiden vuoden ajalta		Tässä ilmoitetaan viitepäivää edeltävien viiden vuoden aikana havaittujen maksukyvyttömyysasteiden painotettu keskiarvo. On sovellettava sarakkeessa 0190 tarkoitettua maksukyvyttömyysasteen määritelmää. Painoina on käytettävä sarakkeen 0190 maksukyvyttömyysasteen laskennassa käytettyjä vastuita, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa. Jos laitoksen ei tarvitse asetuksen (EU) N:o 575/2013 180 artiklan 1 kohdan h alakohdan tai 180 artiklan 2 kohdan e alakohdan nojalla laskea maksukyvyttömyysastetta viideltä viitepäivää edeltäneeltä vuodelta, sen on laadittava arvio käyttämällä pisimmälle ulottuvia aiempia tietojaan viiteen viitepäivää edeltäneeseen vuoteen asti ja toimitettava toimivaltaiselle viranomaiselleen asiakirjat, joissa laskelmat selostetaan yksityiskohtaisesti. Nämä tiedot ilmoitetaan vain sellaisten salkun tunnisteiden osalta, jotka koskevat muita kuin maksukyvyttömyystilassa olevia vastuita. Tiedot on ilmaistava arvona välillä 0 ja 1. Maksukyvyttömyystapauksia ja maksukyvyttömyyspäiviä käytetään kuten ne on kirjattu tapahtumahetkellä sovellettavan maksukyvyttömyyden määritelmän täytäntöönpanon mukaisesti, eli laitoksen on katsottava, että maksukyvyttömyys on tapahtunut laitoksen tapahtumahetkellä soveltaman maksukyvyttömyyden määritelmän mukaisesti. Maksukyvyttömyyden määritelmän muutokset otetaan huomioon vasta niiden täytäntöönpanopäivästä alkaen eikä maksukyvyttömyyden määritelmän muutoksia voida soveltaa takautuvasti tarkasteltava olevan maksukyvyttömyystapahtuman jälkeen (takautuva simulointi).
0210	Viimeisimmän vuoden tappioaste		Viimeisimmän vuoden aikana havaittu tappioaste ilmoitetaan ainoastaan niiden salkun tunnisteiden osalta, jotka liittyvät ”maksukykyisiin” ja ”maksukyvyttömyystilassa oleviin” vastuisiin. Muiden kuin maksukyvyttömyystilassa olevien salkkujen tapauksessa tappioaste saadaan laskemalla yhteen niiden luottoriskioikaisujen ja lopullisten luottotappioiden summa, joita sovellettiin viitepäivää edeltävän vuoden kuluessa sellaisiin vastuisiin, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa tarkalleen vuosi ennen viitepäivää mutta jotka tulivat maksukyvyttömiksi viitepäivää edeltävän vuoden aikana, ja jakamalla tulos niiden vastuiden tarkalleen vuosi ennen viitepäivää mitatulla EAD-määrällä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa tarkalleen vuosi ennen viitepäivää mutta jotka tulivat maksukyvyttömiksi viitepäivää edeltävän vuoden aikana.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Tappioasteen osoittajaan on sisällytettävä kaikki viitepäivää edeltävänä vuonna maksukyvyttömiksi tulleisiin vastuisiin liittyvät luottoriskioikaisut ja lopulliset luottotappiot, mukaan lukien ennen maksukyvyttömyyspäivää sovelletut luottoriskioikaisut. Viitepäivää edeltävän vuoden aikana syntyneitä uusia vastuita ei oteta huomioon. Vastuut, jotka olivat maksukyvyttömyystilassa mutta tervehtyivät viitepäivää edeltävän vuoden aikana, otetaan huomioon tappioasteen nimittäjässä, ja kyseisiä vastuita koskevat luottoriskioikaisut ja lopulliset luottotappiot otetaan huomioon tappioasteen osoittajassa. Saman velallisen useat maksukyvyttömyystapaukset otetaan huomioon vain kerran. Maksukyvyttömyystilassa olevien salkkujen osalta tappioasteessa on otettava huomioon vastuut, jotka olivat maksukyvyttömyystilassa tarkalleen vuosi ennen viitepäivää. Se saadaan laskemalla yhteen a) kyseisiin vastuisiin tehdyt luottoriskioikaisut vuosi ennen viitepäivää ja b) viitepäivää edeltävän vuoden kuluessa sovelletut luottoriskioikaisut ja lopulliset luottotappiot, jaettuna tarkasteltavana olevien vastuiden tarkalleen vuosi ennen viitepäivää mitatulla EAD-määrällä. Viitepäivää edeltävän vuoden aikana syntyneitä uusia maksukyvyttömyystapauksia ei oteta huomioon. Vastuut, jotka tervehtyivät viitepäivää edeltävän vuoden aikana, otetaan huomioon tappioasteen nimittäjässä, ja kyseisiä vastuita koskevat luottoriskioikaisut ja lopulliset luottotappiot otetaan huomioon tappioasteen osoittajassa. Saman velallisen useat maksukyvyttömyystapaukset otetaan huomioon vain kerran. Tappioaste ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Maksukyvyttömyystapauksia ja maksukyvyttömyyspäiviä käytetään kuten ne on kirjattu tapahtumahetkellä sovellettavan maksukyvyttömyyden määritelmän täytäntöönpanon mukaisesti, eli laitoksen on katsottava, että maksukyvyttömyys on tapahtunut laitoksen tapahtumahetkellä soveltaman maksukyvyttömyyden määritelmän mukaisesti. Maksukyvyttömyyden määritelmän muutokset otetaan huomioon vasta niiden täytäntöönpanopäivästä alkaen eikä maksukyvyttömyyden määritelmän muutoksia voida soveltaa takautuvasti tarkasteltava olevan maksukyvyttömyystapahtuman jälkeen (takautuva simulointi).
0220	Tappioaste viiden vuoden ajalta		Viimeisimmän vuoden aikana havaittujen tappioasteiden EAD-painotettu keskiarvo ilmoitetaan ainoastaan niiden salkun tunnisteiden osalta, jotka liittyvät ”muihin kuin maksukyvyttömyystilassa oleviin” ja ”maksukyvyttömyystilassa oleviin” vastuisiin. On sovellettava sarakkeessa 0210 olevaa tappioasteen määritelmää. Tappioaste viiden vuoden ajalta perustuu viimeisten viiden vuoden vuotuisiin tappioasteisiin, kun vuotuiset tappioasteet määritellään sarakkeessa 0210 esitetyn tappioasteen määritelmän mukaisesti. Vuotuisiin tappioasteisiin ei saa sisällyttää luottoriskioikaisuihin ja lopullisiin luottotappioihin kunkin vuotuisen tappioasteen havainnointikauden (kalenterivuosi) jälkeen tehtyjä lisämuutoksia. Jos laitoksen ei tarvitse asetuksen (EU) N:o 575/2013 181 artiklan 2 kohdan viimeisen alakohdan nojalla käyttää tietoja viideltä viitepäivää edeltäneeltä vuodelta, sen on laadittava arvio käyttämällä pisimmälle ulottuvia aiempia tietojaan viiteen viitepäivää edeltäneeseen vuoteen asti ja toimitettava toimivaltaiselle viranomaiselleen asiakirjat, joissa laskelmat selostetaan yksityiskohtaisesti. Tappioaste ilmaistaan arvona välillä 0 ja 1. Maksukyvyttömyystapauksia ja maksukyvyttömyyspäiviä käytetään kuten ne on kirjattu tapahtumahetkellä sovellettavan maksukyvyttömyyden määritelmän täytäntöönpanon mukaisesti, eli laitoksen on katsottava, että maksukyvyttömyys on tapahtunut laitoksen tapahtumahetkellä soveltaman maksukyvyttömyyden määritelmän mukaisesti. Maksukyvyttömyyden määritelmän muutokset otetaan huomioon vasta niiden täytäntöönpanopäivästä alkaen eikä maksukyvyttömyyden määritelmän muutoksia voida soveltaa takautuvasti tarkasteltava olevan maksukyvyttömyystapahtuman jälkeen (takautuva simulointi).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0250	Riskipainotetut vastuuerät (RWA-)		Laitosten on laskettava ja ilmoitettava RWA- liitteen I lomakkeessa 103 tarkoitetuille salkuille, joiden salkun tunnisteet ovat seuraavat: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA- tarkoittaa hypoteettista riskipainotettujen vastuuerien määrää tukikerrointen soveltamisen jälkeen. Hypoteettinen määrä saadaan soveltamalla jokaiseen vastuuseen jäljempänä määriteltyjä lukuja, jotka ovat tyyppiä PD-, laitoksen PD-lukujen sijasta. Muut laskentaparametrit pysyvät muuttumattomina. PD-:n on perustuttava kullekin vastapuoliluokalle erikseen suoritettuun laskentaan. On käytettävä niitä vastapuoliluokkia, jotka ilmoitetaan komission täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.02 sarakkeessa 0005 (ks. ohjeet kyseisen asetuksen liitteessä II olevissa lomakkeissa C 08.01 (sarake 0010) ja C 08.02). Kunkin vastapuoliluokan osalta p^{-} on pienin positiivinen arvo, joka toteuttaa yhtälön $$p^{-} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{-} \cdot (1 - p^{-})}{n}} \geq DR_{1y}$$ jossa $DR_{1y} > 0$, ja $p^{-} = 0$ jos $DR_{1y} = 0$. Tässä yhtälössä Φ^{-1} = tavanomaisen (kumulatiivisen) normaalijakauman käänteisfunktio; q = luotettavuustaso 90 %; DR_{1y} = viitepäivää edeltävän vuoden tapauskohtaisesti painotettu maksukyvyttömyysaste, toisin sanoen niiden velallisten määrä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää ja tulivat maksukyvyttömiksi viimeisimmän vuoden aikana, jaettuna niiden velallisten määrällä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää; n = niiden velallisten määrä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää. Kunkin velallisen osalta PD- on yhtä suuri kuin p^{-}, jolloin p^{-} on laskettava neljännessä alakohdassa esitetyn kaavan mukaisesti sille vastapuoliluokalle, johon velallinen kuuluu.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0260	Riskipainotetut vastuuerät (RWA+)		Laitosten on laskettava ja ilmoitettava RWA+ liitteen I lomakkeessa 103 tarkoitetuille salkuille, joiden salkun tunnisteet ovat seuraavat: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA+ tarkoittaa hypoteettista riskipainotettujen vastuuerien määrää tukikerrointen soveltamisen jälkeen. Hypoteettinen määrä saadaan soveltamalla jokaiseen vastuuseen jäljempänä määriteltyjä lukuja, jotka ovat tyyppiä PD+, laitoksen PD-lukujen sijasta. Muut laskentaparametrit pysyvät muuttumattomina. PD+:n on perustuttava kullekin vastapuoliluokalle erikseen suoritettuun laskentaan. On käytettävä niitä vastapuoliluokkia, jotka ilmoitetaan komission täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.02 sarakkeessa 0005 (ks. ohjeet kyseisen asetuksen liitteessä II olevissa lomakkeissa C 08.01 (sarake 0010) ja C 08.02). Kunkin vastapuoliluokan osalta p^+ on suurin positiivinen arvo, joka toteuttaa yhtälön $$p^+ - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^+ \bullet (1-p^+)}{n}} \leq DR_{1y}$$ Tässä yhtälössä Φ^{-1} = tavanomaisen (kumulatiivisen) normaalijakauman käänteisfunktio; q = luotettavuustaso 90 %; DR_{1y} = viitepäivää edeltävän vuoden tapauskohtaisesti painotettu maksukyvyttömyysaste, toisin sanoen niiden velallisten määrä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää ja tulivat maksukyvyttömiksi viimeisimmän vuoden aikana, jaettuna niiden velallisten määrällä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää; n = niiden velallisten määrä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää. Kunkin velallisen osalta PD+ on yhtä suuri kuin p^+, jolloin p^+ on laskettava neljännessä alakohdassa esitetyn kaavan mukaisesti sille vastapuoliluokalle, johon velallinen kuuluu.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0270	Riskipainotetut vastuuerät (RWA–)		Laitosten on laskettava ja ilmoitettava RWA– liitteen I lomakkeessa 103 tarkoitetuille salkuille, joiden salkun tunnisteet ovat seuraavat: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA– tarkoittaa hypoteettista riskipainotettujen vastuuerien määrää tukikerrointen soveltamisen jälkeen. Hypoteettinen määrä saadaan soveltamalla jokaiseen vastuuseen jäljempänä määriteltyjä lukuja, jotka ovat tyyppiä PD--, laitoksen PD-lukujen sijasta. Muut laskentaparametrit pysyvät muuttumattomina. PD--:n on perustuttava kullekin vastapuoliluokalle erikseen suoritettuun laskentaan. On käytettävä niitä vastapuoliluokkia, jotka ilmoitetaan komission täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.02 sarakkeessa 0005 (ks. ohjeet kyseisen asetuksen liitteessä II olevissa lomakkeissa C 08.01 (sarake 0010) ja C 08.02). Kunkin vastapuoliluokan osalta p^{--} on pienin positiivinen arvo, joka toteuttaa yhtälön $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ jossa $DR_{5y} > 0$, ja $p^{--} := 0$ jos $DR_{5y} = 0$. Tässä yhtälössä Φ^{-1} = tavanomaisen (kumulatiivisen) normaalijakauman käänteisfunktio; q = luotettavuustaso 90 %; DR_{5y} = vastapuoliluokan viiden edeltävän vuoden maksukyvyttömyysaste, laskettuna yksinkertaisena keskiarvona viidestä yhden vuoden tapauskohtaisesti painotetusta maksukyvyttömyysasteesta; n = niiden velallisten määrä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää. Kunkin velallisen osalta PD-- on yhtä suuri kuin p^{--}, jolloin p^{--} on laskettava edellä neljännessä alakohdassa esitetyn kaavan mukaisesti sille vastapuoliluokalle, johon velallinen kuuluu.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0280	Riskipainotetut vastuuerät (RWA++)		Laitosten on laskettava ja ilmoitettava RWA++ liitteen I lomakkeessa 103 tarkoitetuille salkuille, joiden salkun tunnisteet ovat seuraavat: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RWA++ tarkoittaa hypoteettista riskipainotettujen vastuuerien määrää tukikerrointen soveltamisen jälkeen. Hypoteettinen määrä saadaan soveltamalla jokaiseen vastuuseen jäljempänä määriteltyjä lukuja, jotka ovat tyyppiä PD++, laitoksen PD-lukujen sijasta. Muut laskentaparametrit pysyvät muuttumattomina. PD++ lasketaan erikseen kullekin vastapuoliluokalle. On käytettävä niitä vastapuoliluokkia, jotka ilmoitetaan komission täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.02 sarakkeessa 0005 (ks. ohjeet kyseisen asetuksen liitteessä II olevissa lomakkeissa C 08.01 (sarake 0010) ja C 08.02). Kunkin vastapuoliluokan osalta p^{++} on suurin positiivinen arvo, joka toteuttaa yhtälön $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{++} \cdot (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ jossa: Φ^{-1} = tavanomaisen (kumulatiivisen) normaalijakauman käänteisfunktio; q = luotettavuustaso 90 %; DR_{5y} = vastapuoliluokan viiden edeltävän vuoden maksukyvyttömyysaste, laskettuna yksinkertaisena keskiarvona viidestä yhden vuoden tapauskohtaisesti painotetusta maksukyvyttömyysasteesta; n = niiden velallisten määrä, jotka eivät olleet maksukyvyttömyystilassa ja jotka kuuluivat tarkasteltavana olevaan vastapuoliluokkaan tarkalleen vuosi ennen viitepäivää. Kunkin velallisen osalta PD++ on yhtä suuri kuin p^{++}, jolloin p^{++} on laskettava neljännessä alakohdassa esitetyn kaavan mukaisesti sille vastapuoliluokalle, johon velallinen kuuluu.

C 105.01 – Sisäisten mallien määrittely

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Sisäisen mallin tunniste		Laitoksen on ilmoitettava toimivaltaisen viranomaisen antama sisäisen mallin tunniste. Jos tätä ei ole saatavilla, laitoksen on ilmoitettava itse antamansa sisäisen mallin tunniste. Sisäisen mallin tunniste on yksilöllinen sisäiselle mallille, jonka toimivaltainen viranomainen on hyväksynyt ja jota käytetään riskipainotettujen vastuuerien laskennassa. Se on rivin tunniste, joka on yksilöllinen lomakkeen jokaiselle riville.
0020	Mallin nimi		Tässä ilmoitetaan mallin nimi, jonka raportoiva laitos on antanut sisäiselle mallille.
0030	IRB-menetelmän riskiparametri		IRB-menetelmän riskiparametri on jokin seuraavista: a) maksukyvyttömyyden todennäköisyyttä kuvaava luku (PD); b) tappio-osuus (LGD); c) luottovasta-arvokerroin (CF). Asetuksen (EU) N:o 575/2013 153 artiklan 5 kohdan mukaisten yritysten erityiskohteiden rahoitusvastuiden sisäisen mallin osalta (”Erityisen luotonannon luokittelukriteerit”) kenttä jätetään tyhjäksi tai siihen lisätään merkintä ”NULL”.
0040	Maksukyvyttö-myystilassa oleva vastuu (EAD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0110	Tässä ilmoitetaan luokitusmallin soveltamisalaan kuuluvien vastuiden yhteenlaskettu vastuuarvo.
0050	EAD-painotettu keskimääräinen maksukyvyttö-myysaste tarkistusta varten		Tässä ilmoitetaan PD-mallien tarkistuksessa käytettävä vuotuisten maksukyvyttömyysasteiden EAD-painotettu keskiarvo. Nämä tiedot on täytettävä ainoastaan PD-mallien osalta. On käytettävä malliparametrien tarkistuksessa käytettyjä tietoja. Jos sisäisiä tietoja ei ole ja tarkistus perustuu ulkoisiin tietoihin, on ilmoitettava ulkoiset tiedot.
0060	Tapauskohtaisesti painotettu keskimääräinen maksukyvyttö-myysaste tarkistusta varten		Tässä ilmoitetaan PD-mallien tarkistuksessa käytettävä vuotuisten maksukyvyttömyysasteiden tapauskohtaisesti painotettu keskiarvo. Nämä tiedot on täytettävä ainoastaan PD-mallien osalta. On käytettävä malliparametrien tarkistuksessa käytettyjä tietoja. Jos sisäisiä tietoja ei ole ja tarkistus perustuu ulkoisiin tietoihin, on ilmoitettava ulkoiset tiedot.
0070	Pitkän aikavälin PD-luku		Tässä ilmoitetaan laitoksen mallien tarkistuksessa käyttämä yleinen suuntaus, joka sisältää kaikki varovaiset oikaisut PD-mallien tarkistuksessa käytettävien maksukyvyttömyysasteiden tapauskohtaisesti painotettuun yksinkertaiseen keskiarvoon. Nämä tiedot on täytettävä ainoastaan PD-mallien osalta.
0080	Tervehtymisaste maksukyvyttö-myysaineistossa		Tervehtymisaste maksukyvyttömyysaineistossa on prosenttiosuus maksukyvyttömistä jäljellä olevista positioista, jotka palaavat ”maksukykyisiksi” 12 kuukauden aikana. Laitoksen, joka ei laske tervehtymisasteita kyseiselle mallille, on laskettava niitä koskeva arvio ottamalla huomioon annettu määritelmä. Laitoksen on ilmoitettava arvion käyttämisestä toimivaltaiselle viranomaiselle. Nämä tiedot on täytettävä ainoastaan LGD-mallien osalta.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0090	Muun kuin tervehtyneen maksukyvyttömyysaineiston ulosmitattujen varojen palautumisaste		Tässä ilmoitetaan muun kuin tervehtyneen maksukyvyttömyysaineiston tapauskohtaisesti painotettu keskimääräinen palautumisaste, joka sisältyy laitoksen maksukykyisten varojen LGD-mallien tarkistamisessa käyttämään aikasarjaan. On käytettävä malliparametrien tarkistuksessa käytettyjä tietoja. Jos sisäisiä tietoja ei ole ja tarkistus perustuu ulkoisiin tietoihin, on ilmoitettava ulkoiset tiedot. Laitoksen, jolla ei ole käytettävissään erityistä muun kuin tervehtyneen maksukyvyttömyysaineiston palautumisastetta puutteellisen palautumismenettelyn vuoksi, on laskettava arvio ottamalla huomioon havaitut palautumiset ja arviot palautumisesta keskeneräisissä lainajärjestelyissä. Laitoksen on ilmoitettava arvion käyttämisestä toimivaltaiselle viranomaiselle. Nämä tiedot on täytettävä ainoastaan LGD-mallien osalta.
0100	Muun kuin tervehtyneen maksukyvyttömyysaineiston ulosmitattujen varojen palautumisjakso		Tässä ilmoitetaan muun kuin tervehtyneen maksukyvyttömyysaineiston palautumisjakson tapauskohtaisesti painotettu keskimääräinen pituus (maksukyvyttömyystilan alusta palautumismenettelyjen päättämiseen), joka sisältyy laitoksen maksukykyisten varojen LGD-mallien tarkistamisessa käyttämään aikasarjaan. Tapauskohtaisesti painotettu keskimääräinen pituus on ilmaistava päivien lukumääränä. On käytettävä malliparametrien tarkistuksessa käytettyjä tietoja. Jos sisäisiä tietoja ei ole ja tarkistus perustuu ulkoisiin tietoihin, on ilmoitettava ulkoiset tiedot. Laitoksen, jolla ei ole käytettävissään erityistä muun kuin tervehtyneen maksukyvyttömyysaineiston palautumisjakson pituutta puutteellisen palautumismenettelyn vuoksi, on laskettava arvio ottamalla huomioon annettu määritelmä. Laitoksen on ilmoitettava arvion käyttämisestä toimivaltaiselle viranomaiselle. Nämä tiedot on täytettävä ainoastaan LGD-mallien osalta.
0110	Yhteinen päätös	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 20 artiklan 2 kohdan a alakohta	Laitoksen on ilmoitettava, onko konsolidointiryhmän ja vastaanottavan jäsenvaltion toimivaltaisen viranomaisen välillä tehty vakavaraisuusvaatimuksia koskevaa yhteistä päätöstä luvasta käyttää IRB-menetelmää vakavaraisuusvaatimusten laskemiseen laitoksen tytäryhtiöiden hallussa ilmoitetuissa vertailusalkuissa olevista vastuista.
0120	Konsolidointiryhmän valvoja	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 20 artikla	Tässä ilmoitetaan IRB-menetelmää käyttävän laitoksen konsolidointiryhmän valvonnasta vastaavan toimivaltaisen viranomaisen alkuperämaan ISO-koodi.
0130	Riskipainotetut vastuuerät (RWA)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0260	Tässä ilmoitetaan luokitusmallin soveltamisalaan kuuluvien vastuiden yhteenlasketut riskipainotetut vastuuerät tukikerrointen (pk-yritysten ja infrastruktuurin tukikertoimet) soveltamisen jälkeen.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0140	Riskipainotettujen vastuuerien (RWA) korotustekijät		Riskipainotettujen vastuuerien korotustekijät on riskipainotettujen vastuuerien (lomakkeen C 105.01 sarake 0130) alakohta (”joista”), ja niihin on sisällytettävä a) riskipainotettuihin vastuueriin lisätyt riskipainotetut vastuuerät, jotka on saatu soveltamalla mallin riskiparametreja, jotka johtuvat mahdollisista suoraan riskipainotettuihin vastuueriin sovellettavista varovaisuutta koskevista sisäisistä lisätoimenpiteistä; b) riskipainotettuihin vastuueriin lisätyt riskipainotetut vastuuerät, jotka on saatu soveltamalla mallin riskiparametreja, jotka johtuvat mahdollisista suoraan riskipainotettuihin vastuueriin sovellettavista valvontatoimenpiteistä. Edellä a ja b alakohdassa tarkoitettuihin määriin ei sisällytetä toimenpiteitä, jotka on jo otettu huomioon PD-luvussa (lomakkeiden C 102 ja C 103 sarake 0060), luottovasta-arvokertoimessa (lomakkeiden C 102 ja C 103 sarake 0100) tai LGD-arvossa (lomakkeiden C 102 ja C 103 sarake 0130), vaan ne on rajoitettava toimenpiteisiin, joita sovelletaan suoraan riskipainotettuihin vastuueriin ja mahdollisten riskiparametreja lisäävien varovaisuusmarginaalien ja valvontatoimenpiteiden (kuten kerrointen, korotustekijöiden, alarajojen tai muiden vastaavien toimenpiteiden) lisäksi. Riskipainotettujen vastuuerien korotustekijöihin ei sisällytetä mahdollisten asetuksen (EU) N:o 575/2013 458 artiklan mukaisten toimenpiteiden vaikutusta. Jos laitos ei pysty erittelemään asiaankuuluvia varovaisia mukautuksia, sovelletaan I osan 3 kohtaa.

C 105.02 – Sisäisten mallien kohdennus salkkuihin

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Salkun tunniste	Lomakkeen C 102 sarake 0010 ja lomakkeen C 103 sarake 0010	Tässä ilmoitetaan salkun yksilöivä salkun tunniste liitteessä I olevien lomakkeiden C 102 ja C 103 mukaisesti. Sarakkeet 0010 ja 0020 muodostavat yhdistetyn rivitunnisteen ja ovat yhdessä yksilöllisiä tämän lomakkeen kunkin rivin osalta.
0020	Sisäisen mallin tunniste	Lomakkeen C 105.01 sarake 0010	Tässä ilmoitetaan raportoivan laitoksen antama sisäisen mallin tunniste. Sarakkeet 0010 ja 0020 muodostavat yhdistetyn rivitunnisteen ja ovat yhdessä yksilöllisiä kunkin rivin osalta lomakkeessa C 105.02.
0030	Maksukyvyttömyystilassa oleva vastuu (EAD)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0110	Tässä ilmoitetaan sarakkeessa 0010 määriteltyyn salkkuun sisältyvien ja sarakkeessa 0020 määritellyn luokitusmallin soveltamisalaan kuuluvien vastuiden yhteenlaskettu vastuuarvo. Jos kaikkia tietyn salkun vastuita käsitellään saman mallin mukaisesti, vastuuarvo on yhtä kuin määrä, joka saman salkun osalta ilmoitetaan tapauksen mukaan lomakkeen C 102 tai C 103 sarakkeessa 0110.
0040	Riskipainotetut vastuuerät (RWA)	Täytäntöönpanoasetuksen (EU) 2021/451 liitteessä I olevan lomakkeen C 08.01 sarake 0260	Tässä ilmoitetaan sarakkeessa 0010 määriteltyyn salkkuun sisältyvien ja sarakkeessa 0020 määritellyn luokitusmallin soveltamisalaan kuuluvien vastuiden yhteenlasketut riskipainotetut vastuuerät tukikerrointen soveltamisen jälkeen. Jos kaikkia tietyn salkun vastuita käsitellään saman mallin mukaisesti, riskipainotettujen vastuuerien määrä on yhtä kuin määrä, joka saman salkun osalta ilmoitetaan tapauksen mukaan lomakkeen C 102 tai C 103 sarakkeessa 0170.

C 105.03 – Sisäisten mallien kohdennus maihin

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0005	Rivin tunnus		Tämä tunnus on rivin tunniste, joka on yksilöllinen lomakkeen jokaiselle riville. Se noudattaa numerojärjestystä 1, 2, 3 jne.
0010	Sisäisen mallin tunniste	Lomakkeen C 105.01 sarake 0010	Tässä ilmoitetaan raportoivan laitoksen antama sisäisen mallin tunniste. Jos yksi sisäisen mallin tunniste liittyy moneen maahan, jokaisesta ”sisäisen mallin tunnisteen” ja ”laitoksen sijainnin” yhdistelmästä on ilmoitettava erillisillä riveillä. Sarakkeet 0010 ja 0020 muodostavat yhdistetyn rivitunnisteen, ja niiden yhdistelmä on yksilöllinen kunkin taulukkorivin osalta.
0020	Laitoksen sijainti	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 20 artikla	Tässä ilmoitetaan kunkin sellaisen tytäryrityksen kotipaikan ISO-maakoodi, jossa IRB-vastuut kustakin vertailusalkusta on kirjattu, riippumatta siitä, onko IRB-menetelmän soveltamiseen vastaanottavan jäsenvaltion valvojan myöntämää lupaa.”

LIITE II

“”LIITE V

MARKKINARISKIÄ KOSKEVAT VERTAILUINSTRUMENTIT JA -SALKUT

1 jakso: Ohjeet

2 jakso: Instrumentit

3 jakso: Yksittäiset salkut – yksi väline

4 jakso: Yksittäiset salkut – Useita välineitä

5 jakso: Yhdistetyt salkut

6 jakso: Instrumentteja koskevat lisäeritelmät

7 jakso: SBM:n validointisalkut

1 jakso: Ohjeet

a) Tässä liitteessä sovelletaan seuraavia määritelmiä:

i) 'kirjauspäivällä' tarkoitetaan päivää ja kellonaikaa, jona laitokset kirjaavat liiketoimet vertailua varten;

ii) 'IMV-arvolla' (Initial Market Valuation) tarkoitetaan tämän liitteen 2 jaksossa tarkoitettujen instrumenttien markkina-arvoa IMV-viitepäivänä ja -aikana;

iii) 'IMV-viitepäivällä' tarkoitetaan päivämäärää ja kellonaikaa, jonka perusteella laitosten on määritettävä vertailusalkkuun sisältyvien liiketoimien IMV-arvo;

iv) 'IMV-ilmoituspäivällä' tarkoitetaan päivämäärää, johon mennessä laitosten on toimitettava vertailusalkkuun sisältyvien liiketoimien IMV-arvon määrittämisen tulokset;

v) 'VaR:llä' tarkoitetaan Value at Risk -arvoa;

vi) 'sVaR:llä' tarkoitetaan stressitestattua VaR-arvoa;

vii) 'IRC:llä' (Incremental Risk Charge) tarkoitetaan pääomavaatimusta lisäriskien kattamiseksi;

viii) 'CTP:llä' tarkoitetaan korrelaatiokaupankäyntisalkkua;

ix) 'APR:llä' (All Price Risk) tarkoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artiklan 2 kohdan mukaisesti laskettuja kaikkia hintariskejä;

x) 'riskimitoilla' tarkoitetaan salkkujen VaR:n, sVaR:n ja tarvittaessa IRC:n ja APR:n, kuten tämän liitteen 3, 4 ja 5 jaksossa vahvistetaan, arvoa riskimittojen ensimmäisen ja viimeisen viitepäivän välillä;

xi) 'riskimittojen ensimmäisellä viitepäivällä' tarkoitetaan päivää, jona laitosten on aloitettava riskimitta-arvojen laskeminen;

xii) 'riskimittojen viimeisellä viitepäivällä' tarkoitetaan päivää, jona laitosten on lopetettava riskimitta-arvojen laskeminen;

xiii) 'riskimittojen ilmoituspäivällä' tarkoitetaan päivää, johon mennessä laitosten on toimitettava vertailusalkkuun sisältyvien liiketoimien riskimittojen tulokset;

xiv) 'nykyarvolla' tarkoitetaan tämän liitteen 3 jaksossa lueteltujen salkkujen markkina-arvoa riskimittojen viimeisenä viitepäivänä;

xv) 'ATM:llä' (At The Money) tarkoitetaan tasaoptiota suhteessa johdannaisen kohde-etuuden tämänhetkisen tai tulevan hinnan suhteelliseen asemaan verrattuna johdannaisen toteutushintaan;

xvi) 'OTM:llä' (Out of The Money) tarkoitetaan miinusoptiota suhteessa johdannaisen kohde-etuuden tämänhetkisen tai tulevan hinnan suhteelliseen asemaan verrattuna johdannaisen toteutushintaan;

xvii) 'ITM:llä' (In The Money) tarkoitetaan plusoptiota suhteessa johdannaisen kohde-etuuden tämänhetkisen tai tulevan hinnan suhteelliseen asemaan verrattuna johdannaisen toteutushintaan;

xviii) 'pitkällä' tarkoitetaan ostettua ja 'lyhyellä' tarkoitetaan myytyä;

xix) 'CDS:llä' tarkoitetaan luottoriskinvaihtosopimuksia;

xx) luottoriskinvaihtosopimuksissa 'pitkällä' tarkoitetaan ostettua suojausta ja 'lyhyellä' myytyä suojausta;

xxi) 'MLN:llä' tarkoitetaan englanninkielisessä tekstissä miljoonia;

xxii) 'OTC:llä' tarkoitetaan pörssin ulkopuolista kaupankäyntiä;

xxiii) 'ASA:lla' tarkoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 kolmannen osan IV osaston 1 a luvun 1 jaksossa tarkoitettua vaihtoehtoista standardimenetelmää;

xxiv) 'SBM:llä' tarkoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 kolmannen osan IV osaston 1 a luvun 2 jaksossa tarkoitettua herkkyysperusteista menetelmää;

xxv) 'DRC:llä' tarkoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 kolmannen osan IV osaston 1 a luvun 5 jaksossa tarkoitettua maksukyvyttömyysriskiä koskevaa omien varojen vaatimusta;

xxvi) 'RRAO:lla' tarkoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 kolmannen osan IV osaston 1 a luvun 4 jaksossa tarkoitettua jäännösriskiä koskevaa korotusta.

b) Vertailussa sovelletaan seuraavia päivämääriä:

i) kirjauspäivä on 30. tammikuuta 2025;

ii) IMV-viitepäivä (ja ensimmäinen SBM-viitepäivä) on 6. helmikuuta 2025 (klo 17.30 CET);

iii) IMV-ilmoituspäivä (ja ensimmäinen SBM-ilmoituspäivä ja SBM-validointipäivä) on 28. helmikuuta 2025;

iv) riskimittojen ensimmäinen viitepäivä on 2. kesäkuuta 2025;

v) riskimittojen viimeinen viitepäivä (ja viimeinen ASA-viitepäivä) on 13. kesäkuuta 2025;

vi) riskimittojen viimeinen ilmoituspäivä (ja viimeinen ASA-ilmoituspäivä) on 18. heinäkuuta 2025.

c) Jollei tämän liitteen 2 jaksossa nimenomaisesti toisin mainita, kaikki positiot on kirjattava tämän jakson b kohdan i alakohdassa tarkoitettuna kirjauspäivänä. Kun positiot on kirjattu, kukin salkku ikääntyy vertailuanalyysin keston ajan ja lasketaan olettaen, että laitos ei toteuta mitään toimia salkun hoitamiseksi millään tavalla vertailuanalyysin aikana. Ellei tietyn instrumentin eritelmässä nimenomaisesti toisin määrätä, optiopositioiden toteutushinnat on määritettävä suhteessa kohde-etuuden hintoihin markkinoiden sulkeutuessa kirjauspäivänä.

d) IMV-arvon määrittämistä varten kunkin instrumentin arvostustiedot on toimitettava laitoksen toimivaltaiselle viranomaiselle viimeistään IMV-ilmoituspäivänä. Kyseiseen päivämäärään mennessä laitoksen on toimitettava tuloksiin liittyvä selittävä asiakirja e alakohdan mukaisesti. IMV-arvo on ilmoitettava mahdollisuuksien mukaan laitoksen front office -yksikön arvostuksen mukaisesti. Jos laitoksen front office ei toimita IMV-arvoja, laitoksen on ilmoitettava selittävässä asiakirjassa, mistä IMV-tiedot ovat peräisin.

e) Selittävän asiakirjan, joka laitosten on toimitettava yhdessä IMV-arvon kanssa, on sisällettävä kunkin instrumentin osalta kaikki seuraavat tiedot:

i) riskitekijät, joita käytetään instrumentin IMV-arvon laskemisessa;

ii) instrumentin IMV-arvon laskemisessa käytetty hinnoittelumalli ja kuvaus tästä hinnoittelumallista;

iii) instrumentin VaR-malliin sisältyvät riskitekijät;

iv) VaR-malliin sisältyvät riskitekijät, jotka ovat myös instrumentin IMV-arvostuksen syötetietoja;

v) VaR-mallin erityispiirteet suhteessa instrumenttiin;

vi) instrumentin saatavilla olevat viitetiedot laitoksen omassa muodossa;

vii) tämän jakson h, i, k, m, n, o, v, w, y, gg ja kk alakohdassa tarkoitetut seikat.

f) Sovellettaessa e alakohdan v alakohtaa on ilmoitettava kaikki seuraavat tiedot:

i) VaR-mallin lyhyt kuvaus;

ii) sovelletut arvostusmenetelmät;

iii) funktionaalinen kaava, jota käytetään palautusten mallintamiseen (kuten absoluuttinen, relatiivinen, muut menetelmät);

iv) laadulliset tiedot aikasarjoista, joita on käytetty VaR-mallin kalibroinnissa instrumenttiin nähden (kuten lähde, normalisointimenetelmä, sovelletut alaluokat, muut tiedot, joita laitokset pitävät merkityksellisinä toimitettujen tulosten selittämiseksi).

g) Edellä d alakohdassa tarkoitettua selittävää asiakirjaa on päivitettävä minkä tahansa arvon uudelleentoimittamisen yhteydessä siten, että siinä otetaan huomioon toimitusten välissä tapahtuneet muutokset. Selittävässä asiakirjassa on oltava yksi jakso, jossa luetellaan kaikki toimituspäivät ja syyt uudelleentoimittamiseen.

h) Positioiden riskit on laskettava ottamatta huomioon rahoituskuluja. Tarvittaessa laitosten on käytettävä instrumenttivaluutan yliyön korkoa diskonttokorkona. Tämän liitteen jaksossa 2 tarkoitetuilla johdannaisinstrumenteilla on katsottava olevan vakuussopimus. Jos tämä ei ole mahdollista, perustelut on esitettävä d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

i) Vastapuoliluottoriskiä ja vastuun arvonoikaisuriskiä ei oteta huomioon arvioitaessa salkkujen riskejä. Jos tämä ei ole mahdollista, perustelut on esitettävä tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa. Laitosten on ilmoitettava tapaukset, joissa muita arvonoikaisujen typologioita sisältyy IMV:hen, ja selitettävä kunkin rahoitusinstrumentin osalta menetelmät ja vaikutukset tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

j) Transaktioissa, jotka sisältävät pitkiä positioita luottoriskinvaihtosopimuksissa (CDS), laitosten on oletettava, että maksetaan välitön ennakkomaksu (up-front fee) position tekemiseksi markkinastandardien ja -käytäntöjen mukaisesti. Kaikkien luottoriskinvaihtosopimusten maturiteettipäivän on vastattava tavanomaisia neljännesvuosittaisia erääntymispäiviä.

k) Luottoriskinvaihtosopimuksia koskevien positioiden hinnoittelulaskelmien tekemiseksi tarvittavien lisäeritelmien on oltava yleisesti käytettyjen markkinastandardien ja -käytäntöjen mukaisia, ja ne on selitettävä tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

l) Maturiteettipäivän on varmistettava, että transaktio on lähinnä määritettyä erääntymisaikaa yleisten markkinastandardien ja -käytäntöjen mukaisesti.

m) Niiden instrumenttien osalta, joita ei tarkoiteta tämän liitteen 2 jaksossa, laitosten on ilmoitettava käytetyt oletukset, mukaan lukien koronlaskukäytäntö ja – jos se on sallittua – valittu markkinakelpoinen ja likvidi instrumentti yhdessä tulosten kanssa tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

n) Laitosten, jotka katsovat, että muut kuin tässä jaksossa esitetyt oletukset ovat myös merkityksellisiä vertailun tulosten tulkinnan kannalta, esimerkiksi kaupankäyntiajan päättyminen, coupon rolls -toimet, vertailu indekseihin jne., on toimitettava kuvaus näistä oletuksista tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

o) Tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa on selostettava riskit, joita ei ole otettu huomioon tämän liitteen 2 jaksossa tarkoitettujen instrumenttien mallissa.

p) Kaikkia optioita on kohdeltava kuin niillä käytäisiin kauppaa pörssin ulkopuolella (OTC), ellei nimenomaisesti määritellä muuta.

q) OTC-optioiden normaaleja ajoituskäytäntöjä on noudatettava. n kuukauden pituisen option erääntymisaika on n kuukautta. Jos optiot erääntyvät muuna kuin kaupankäyntipäivänä, laitosten on mukautettava eräpäivä kaupankäyntipäivään yleisten markkinastandardien ja -käytäntöjen mukaisesti.

r) Kaikkia OTC-optioita on kohdeltava seuraavasti:

   i) amerikkalaisina, jos ne koskevat yksittäisiä osakkeita ja hyödykkeitä

   ii) eurooppalaisina, jos ne koskevat indeksejä, ulkomaanvaluuttaa ja swaptioita.

s) Kaikkia OTC-optioita on pidettävä ”kattamattomina” eli preemio on jätettävä huomiotta alkuperäisessä markkina-arvossa.

t) Korrelaatiokaupankäyntisalkkujen (CTP) osalta laitosten, joilla on lupa käyttää APR-mallia korrelaatiokaupankäyntisalkkuun, on toimitettava yksityiskohtaisia tietoja tämän liitteen 2 jaksossa tarkoitettuja CTP-instrumentteja koskevista keskeisimmistä oletuksistaan sekä markkinastandardeista ja -käytännöistä, myös deltakertoimista, jotka ne ovat laskeneet, jotta CTP-instrumenttien CS01 olisi neutraali kirjauspäivänä.

u) Kunkin instrumentin IMV-arvo on ilmoitettava kyseiselle instrumentille tämän liitteen 2 jaksossa määritetyn EPV:n instrumentin valuutan määräisenä.

v) Kun on kyse salkuista, jotka koostuvat yhdestä tai useammasta instrumentista, jotka ovat EPV:n instrumenttien valuuttojen mutta eivät kyseisen EPV:n salkun valuutan määräisiä, tulos muunnetaan ilmoitetuksi EPV:n salkun valuutaksi käyttäen EKP:n kyseisen päivän avistakurssia. Muunnettua tulosta on selitettävä tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

w) Positioita kirjatessaan laitosten on noudatettava asianmukaisia markkinakäytäntöjä, jollei näissä ohjeissa instrumenttien kuvauksissa toisin määritellä (tämän liitteen 2 jakso).

x) Jos instrumentti tai johdannaisen kohde-etuutena oleva instrumentti on vertailuun vaikuttavan yhtiötapahtuman kohteena (esim. liikkeeseenlaskijan osto-optio, maksukyvyttömyys tai samankaltaiset tapahtumat), laitosten on poistettava kyseinen instrumentti ja kaikki siihen liittyvät luottoriskinvaihtosopimukset tai optiot vertailusta.

y) Indeksisarjan osalta ”on-the-run” tarkoittaa kyseisen indeksin likvideintä ja kaupankäyntikelpoisinta markkinoilla saatavilla olevaa sarjaa. Laitosten on selitettävä ”on-the-run”-sarjan valintaa ja siihen liittyviä tuloksia tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

z) Jollei toisin täsmennetä, laitosten on sovellettava koron osalta EU:n vertailuarvoasetusta kirjatakseen tämän liitteen 2 jaksossa mainitut instrumentit. Laitosten on täsmennettävä sovellettava korko, lukuun ottamatta tämän liitteen 2 jaksossa määritettyjä korkoja, näiden ohjeiden d kohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

aa) Riskimitat ja nykyarvot 3, 4 ja 5 jaksossa tarkoitetuille salkuille on laskettava riskimittojen ensimmäisestä viitepäivästä alkaen riskimittojen viimeiseen viitepäivään. Kaupankäyntivaraston perusteellisen tarkistuksen mukaiset ASA:ssa käytettävät riskimitat (SBM, DRC ja RRAO) lasketaan riskimittojen viimeiselle viitepäivälle. Laitosten on toimitettava näiden laskelmien tulokset toimivaltaiselle viranomaiselleen viimeistään riskimittojen ilmoituspäivänä. IMV-arvo ja SBM on ilmoitettava kullekin instrumentille. Kunkin salkun, sekä yksittäisten että yhdistettyjen salkkujen, riskimitat, SBM, DRC, RRAO ja tarvittaessa nykyarvo on ilmoitettava. SBM, DRC ja tarvittaessa RRAO on ilmoitettava ainakin niiden salkkujen osalta, joista riskimitat ilmoitetaan.

bb) Laitosten on ilmoitettava 7 jaksossa tarkoitettujen salkkujen osalta SBM-tulokset ja toimitettava ne IMV-tietojen toimittamista koskevien raportointipäivien mukaisesti.

cc) Ainoastaan laitosten, joille on myönnetty lupa velkainstrumenttien erityisriskin mallintamiseen, on ilmoitettava luottomarginaalisalkut. Sellaisten korkosalkkujen osalta, joihin sisältyy riski osana tiettyjä instrumentteja, yksittäisiä salkkuja ja yhdistettyjä salkkuja mallintavat sellaiset laitokset, joille on myönnetty lupa yleisen korkoriskin mallintamiseen, sekä laitokset, joille on myönnetty lupa yleisen ja erityisen korkoriskin mallintamiseen.

dd) Sekä yksittäisiä että yhdistettyjä salkkuja koskevat tulokset toimitetaan ainoastaan, jos myös kyseisiin salkkuihin sisältyvien instrumenttien tulokset toimitetaan.

ee) Tämän liitteen 2 jaksossa (Instrumentit) ’vuosi T’ tarkoittaa vuotta 2025 ja ’vuosi T + X’ tarkoittaa vuotta 2025 + X, jossa oleva X täsmennetään 2 jaksossa.

ff) Tämän liitteen 2 jaksossa (Instrumentit) laitosten on määritettävä erä-/maturiteettipäivä seuraavien ohjeiden mukaisesti:

i) jos päivämäärä on ilmoitettu, on käytettävä kyseistä päivämäärää;

ii) jos päivämäärää ei ole ilmoitettu, on käytettävä markkinakäytäntöä, jos sellainen on olemassa. Jos on esimerkiksi markkinakäytäntö, jonka mukaan erä-/maturiteettipäivä on kuukauden kolmas perjantai, silloin ilmaisulla ”Kesäkuu vuosi T” tarkoitetaan vuoden T kuukauden kolmatta perjantaita;

iii) ilmaisulla kuukauden ”lopussa” tarkoitetaan kuukauden viimeistä kalenteripäivää;

iv) kirjauspäivän jälkeisen kiinteän ajanjakson osalta, jos ajanjakso määritellään päivien lukumääränä, se on jakson viimeinen päivä. Jos ajanjakso määritellään viikkoina, kuukausina tai vuosina, se on kirjauspäivään nähden seuraavan viikon, kuukauden tai vuoden sama päivä, tai, jos ajanjakson viimeinen kuukausi tai vuosi on lyhyempi, kyseisen kuukauden tai vuoden viimeinen päivä. Jos ”kirjauspäivä + x ajanjakso” on yleinen vapaapäivä, on valittava seuraava työpäivä.

v) Jollei nimenomaisesti toisin mainita, on käytettävä seuraavia oletuksia: Koronlaskukäytäntö: Act/360, vapaapäivät: Target2.

gg) Jollei nimenomaisesti toisin mainita, tämän liitteen 2 jaksossa (Instrumentit) sovelletaan kaikkiin luottoriskinvaihtosopimuksiin seuraavia vaatimuksia:

i) Kupongin maksuväli: neljännesvuosittain

ii) Kuponki (peruspistettä): 100

iii) Koronlaskukäytäntö: ACT/360

iv) ISDA:n määritelmien vuosi: 2014

v) Uudelleenjärjestelylauseke: Modified-Modified Restructuring (MMR)

vi) Maturiteettipäivä: joulukuu vuosi T+4

vii) Velkatyyppi: seniori

viii) Kesto: 5 vuotta

ix) Voimaantulopäivä kirjauspäivänä

x) Käytetty diskonttokorkokäyrä ja palautusaste on selitettävä tämän liitteen d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa.

hh) Joukkolainainstrumenttien IMV-arvoon sisällytetään kertyneet korot.

ii) Laitosten on annettava tiedot nykyarvon määrityksen ajankohdasta ja mainittava aika tämän jakson d alakohdassa tarkoitetussa selittävässä asiakirjassa. Mahdollisuuksien mukaan nykyarvo on laskettava pankkipäivän päättyessä.

jj) Salkkujen riskimitat on laskettava salkun valuutan määräisenä ilman valuuttariskiä, joka liittyy myös laitosten raportointivaluuttaan. Valuuttariski otetaan huomioon vain, jos se sisältyy sisäisesti instrumentteihin. Jos vertailussa ilmoitetaan tuloksia sekä raportointivaluutassa että salkun valuutassa, laitoksen raportointivaluutassa lasketut tulokset muunnetaan EPV:n salkun valuutaksi käyttäen laskentapäivään liittyvää EKP:n avistakurssia. Muuntaminen EPV:n salkun valuuttaan ei muuta valuuttariskitekijöitä.

kk) Sovellettaessa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artiklan 7 kohtaa (perusvaluuttamenetelmä) laitosten on SBM-laskelmia tehdessään ja SBM-herkkyyksistä ilmoittaessaan otettava huomioon perusvaluuttamenetelmän soveltamisesta johtuvat valuuttariskitekijät. Ilmoitettuja arvoja ei saa ilmaista valitussa perusvaluutassa vaan laitoksen raportointivaluutassa käyttämällä muuntamiseen kyseiseen päivään liittyvää EKP:n avistakurssia.

2 jakso: Instrumentit

Laitosten on ilmoitettava IMV-tiedot tämän liitteen 1 jaksossa annettujen ohjeiden mukaisesti seuraavien rahoitusvälineiden osalta, ja niiden on esitettävä 3 ja 4 jaksossa täsmennettyjen salkkujen riskimitat ja nykyarvo:

OSAKETUOTTEET

101. Pitkä positio, EURO STOXX 50 -indeksiin (Tunnus: FESX) perustuvat futuurit.

Nimellisarvo: vastaa indeksin arvoa kerrottuna 1 000 eurolla

Pörssi: Eurex

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

102. Pitkä positio, 10 000 BAYER (Tunnus: BAYN GR) -osaketta.

Pörssi: Xetra

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

103. Lyhyt positio, BAYER (Tunnus: BAYN GR) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Pörssi: Eurex

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

104. Lyhyt positio, STELLANTIS (Tunnus: STLA FP) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Pörssi: Euronext

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

105. Lyhyt positio, ALLIANZ (Tunnus: ALV GR) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Pörssi: Eurex

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

106. Lyhyt positio, BARCLAYS (Tunnus: BARC LN) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Pörssi: Eurex

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: GBP

107. Lyhyt positio, DEUTSCHE BANK (Tunnus: DBK GR) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Pörssi: Eurex

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

108. Lyhyt positio, CRÉDIT AGRICOLE (Tunnus: ACA FP) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Pörssi: Euronext

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

109. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus BAYER (Tunnus: BAYN GR), tasaoptio (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

110. Lyhyet osto-optiot. Kohde-etuus BAYER (Tunnus: BAYN GR), tasaoptio (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Joulukuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

111. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus PFIZER (Tunnus: PFE US) 10 %:n miinusoptio, (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: USD

112. Pitkät myyntioptiot. Kohde-etuus PFIZER (Tunnus: PFE US) 10 %:n miinusoptio, (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: USD

113. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus BAYER (Tunnus: BAYN GR), 10 %:n miinusoptio (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Joulukuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

114. Lyhyet osto-optiot. Kohde-etuus BAYER (Tunnus: BAYN GR), 10 %:n miinusoptio (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

115. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus AVIVA (Tunnus: AV/LN), 10 %:n miinusoptio (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Joulukuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: GBP

116. Pitkät myyntioptiot. Kohde-etuus AVIVA (Tunnus: AV/LN), 10 %:n miinusoptio (1 sopimus = 100 osaketta).

Nimellisarvo: vastaa kohde-etuuden 10 000 osakkeen arvoa

Eräpäivä: Joulukuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: GBP

117. Lyhyt positio, NIKKEI 225 (Tunnus: NKY) -futuurit.

Nimellisarvo: vastaa indeksin arvoa kerrottuna 20 000 jenillä

Pörssi: CME

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: JPY

118. Automaattisesti erääntyvä (auto-callable) osaketuote.

Pitkä positio

Kirjaus kirjauspäivänä

Nimellisarvo (”pääoma”): 1 000 000 EUR

Kohde-etuus: EURO STOXX 50 -indeksi (Tunnus: SX5E)

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Maturiteettipäivä: 5 vuotta

Vuotuinen maksatus ja vuotuinen tarkastelu (”kirjauspäivä + 1 vuosi”, ”kirjauspäivä + 2 vuotta”, ”kirjauspäivä + 3 vuotta”, ”kirjauspäivä + 4 vuotta”, ”kirjauspäivä + 5 vuotta”). Maksu suoritetaan 10 päivän kuluttua viitepäivästä.

Kuponki: 6 %

Automaattisen erääntymisen aiheuttava taso (’alkuperäinen arvo’): Päätöshinta kirjauspäivä + 1 kuukausi

Kupongin maksuedellytys on 60 % automaattisen erääntymisen aiheuttavasta tasosta.

Suojaukselle määritetty taso: 55 % automaattisen erääntymisen aiheuttavasta tasosta

— Pääoma ei ole turvattu, jos indeksi on alle suojaukselle määritetyn tason (protection barrier) (viidentenä vuonna takaisinmaksettava pääoma on päätösarvon ja alkuperäisen arvon suhteellinen osuus (pro rata), jos taso on alle suojauksen määritetyn tason: esimerkiksi jos SX5E = 40 % sen alkuperäisestä arvosta, niin takaisinmaksettava pääoma on 40 %);

— Jos SX5E ≥ 60 % (kupongin maksuedellytys) alkuperäisestä arvosta minkä tahansa vuoden lopussa, maksetaan 6 %:n kuponki;

— Jos SX5E ≥ 100 % alkuarvosta minkä tahansa vuoden lopussa, tuote peruutetaan, ja maksu on kuponki ja pääoma (100 %);

— Jos SX5E < 60 % (kupongin maksuedellytys) alkuperäisestä arvosta minkä tahansa vuoden lopussa, kuponkia ei makseta;

— Jos SX5E < 55 % (suojaukselle määritetty taso) alkuperäisestä arvosta viidennen vuoden lopussa, pääoma maksetaan määräsuhteessa. Tai jos SX5E > = 55 % (suojaukselle määritetty taso) alkuperäisestä arvosta viidennen vuoden lopussa, pääoma maksetaan kokonaisuudessaan.

119. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus EURO STOXX 50 -indeksi (Tunnus: SX5E), tasaoptio.

Nimellisarvo: vastaa indeksin arvoa kerrottuna 1 000 eurolla

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

120. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus EURO STOXX 600 -indeksi (Tunnus: SXXP), tasaoptio.

Nimellisarvo: vastaa indeksin arvoa kerrottuna 10 000 eurolla

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

121. Pitkät osto-optiot. Kohde-etuus VIX (CBOE), tasaoptio.

Nimellisarvo: vastaa indeksin arvoa kerrottuna 100 000 Yhdysvaltain dollarilla

Eräpäivä: Kesäkuu vuosi T

EPV:n instrumentin valuutta: USD

KOROT

201. Viiden vuoden IRS EUR – saadaan kiinteää korkoa ja maksetaan vaihtuvaa korkoa.

Kiinteäkorkoinen puoli: saadaan vuosittain

Vaihtuva korko: kuuden kuukauden euribor, maksetaan puolivuosittain. Koronlaskutapa: ACT/360

Nimellisarvo: 10 000 000 EUR

Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen

Voimaantulopäivä kirjauspäivänä (ts. käytetään kirjauspäivän kursseja markkinoiden sulkeutuessa)

Maturiteettipäivä: Syyskuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

202. Kahden vuoden euroswaptio viiden vuoden koronvaihtosopimuksella (IRS EUR) – maksetaan kiinteää korkoa ja saadaan vaihtuvaa korkoa.

Nimellisarvo: 10 000 000 EUR

Laitos on swapia koskevan option myyjä. Laitoksen vastapuoli ostaa oikeuden tehdä swap laitoksen kanssa. Jos vastapuoli käyttää oikeuttaan, vastapuoli saa kiinteää korkoa samalla kun laitos saa vaihtuvaa korkoa.

Swaptio kahden vuoden maturiteetilla (kirjauspäivä + 2 vuotta) seuraavasti määritellyllä koronvaihtosopimuksella: Kiinteäkorkoinen puoli – maksetaan vuosittain; Vaihtuva korko: kuuden kuukauden euribor, maksetaan puolivuosittain; Nimellisarvo: 10 000 000 EUR; Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen; Kohde-etuutena olevan vaihtosopimuksen voimaantulopäivä: kirjauspäivä + 2 vuotta.

Kohde-etuutena olevan vaihtosopimuksen erääntymispäivä: kirjauspäivä + 7 vuotta

Preemio maksettu kirjauspäivänä (kirjauspäivä). Käteissuoritus

Toteutushinnan perustana tässä instrumentissa määritellyn myöhennetyn swap-sopimuksen (forward starting swap) ATM-kurssi.

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

203. Viiden vuoden koronvaihtosopimus (USD). Saadaan kiinteää korkoa ja maksetaan vaihtuvaa korkoa.

Kiinteä korko: saadaan vuosittain

Vaihtuva korko: kolmen kuukauden USD SOFR-korko, maksetaan neljännesvuosittain

Nimellisarvo: 1 000 000 USD

Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen

Voimaantulopäivä kirjauspäivänä (ts. käytetään kirjauspäivän kursseja markkinoiden sulkeutuessa)

Maturiteettipäivä: Syyskuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: USD

204. Kahden vuoden koronvaihtosopimus (GBP). Saadaan kiinteää korkoa ja maksetaan vaihtuvaa korkoa.

Kiinteä korko: saadaan vuosittain

Vaihtuva korko: SONIA-korko (yön yli) koronkorkona laskettuna ja maksettuna neljännesvuosittain. Koronlaskutapa: ACT/365

Nimellisarvo: 10 000 000 GBP

Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen

Voimaantulopäivä kirjauspäivänä (ts. käytetään kirjauspäivän kursseja markkinoiden sulkeutuessa)

Maturiteettipäivä: kirjauspäivä + 2 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta GBP

205. UBS:n myymä 10 vuoden korkoputkellinen vaihtuvakorkoinen velkakirja.

Nimellinen (pääoma)määrä: 1 000 000 USD

Vaihtuvakorkoiset velkakirjat ovat UBS AG:n (UBS) etuoikeutettuja vakuudettomia sitoumuksia.

EPV:n instrumentin valuutta USD

— Velkakirjoista maksetaan vuosikorkoa, joka vastaa kolmen kuukauden USD SOFR-korkoa + 1,5 % vuosittain (’vaihtuva korko’), johon sovelletaan 7,5 prosentin vuotuista enimmäiskorkoa (’korkokatto’) ja 2,5 prosentin vuotuista vähimmäiskorkoa (’korkolattia’).

— Velkakirjoista maksettaviin maksuihin, myös maturiteettipäivänä maksettaviin korkoihin ja pääomaan, on sovellettava UBS AG -luottokelpoisuutta. Laitoksia pyydetään käyttämään asianmukaista diskonttokorkokäyrää ja perustelemaan sitä selittävässä asiakirjassa.

— Tulot: Velkakirjoista maksetaan neljännesvuosittain korkoa, joka vastaa vaihtuvaa korkoa, jos jonakin kupongin määräytymispäivänä i) vaihtuva korkotaso on alle vähimmäiskoron, sovellettava korkotaso kyseisellä korkokaudella on yhtä suuri kuin vähimmäiskorko, tai ii) vaihtuva korko on korkeampi kuin enimmäiskorko, sovellettava korkokanta kyseisellä korkokaudella on yhtä suuri kuin enimmäiskorko.

Koron määrä	Velkakirjoista maksettavan koron määrä korkokaudella lasketaan seuraavien tekijöiden perusteella: a) velkakirjojen pääoman määrä, b) kyseisellä korkokaudella sovellettava korkokanta ja c) kerroin, jonka osoittajana on korkokauden päivien määrä (laskutapa, jossa vuodessa katsotaan olevan 360 päivää ja jokaisessa kuukaudessa 30 päivää) ja nimittäjänä 360.
Kaupanteko- ja suorituspäivä	Kirjauspäivä
Koronmaksupäivät	Neljännesvuosittain ajankohtana kirjauspäivä + 3 kuukautta, kirjauspäivä + 6 kuukautta, kirjauspäivä + 9 kuukautta ja kirjauspäivä + 1 vuosi, alkaen ajankohdasta kirjauspäivä + 3 kuukautta, laina-ajan kuluessa (voidaan tehdä mukautuksia niissä kuvatulla tavalla).
Maturiteettipäivä	kirjauspäivä + 10 vuotta
Valuutta	USD
Koronlaskutapa	30/360
Pankkipäiväkäytäntö	Seuraava (Following Unadjusted)
Kupongin määräytymispäivä Päivämäärät	Jokaisen korkokauden osalta asianmukaista koronmaksupäivää välittömästi edeltävä toinen Lontoon pankkipäivä. 'Lontoon pankkipäivällä' tarkoitetaan mitä tahansa päivää, jona pankit ovat auki yleistä liiketoimintaa varten (mukaan lukien ulkomaanvaluuttatoimet ja talletukset ulkomaisissa valuutoissa) Lontoossa ja kaupankäyntiä Yhdysvaltain dollareissa tapahtuu Lontoon pankkien välisillä markkinoilla.

206. Pitkä positio GERMANY GOVT (inflaatio) EUR 1 000 000 (ISIN DE0001030583).

Maturiteettipäivä: 15. huhtikuuta 2033

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

207. Lyhyt positio GERMANY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN DE0001030708).

Maturiteettipäivä: 15. elokuuta 2030

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

208. Pitkä positio ITALY GOVT (inflaatio) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828).

Maturiteettipäivä: 15. syyskuuta 2032

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

209. Pitkä positio ITALY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN IT0005340929).

Maturiteettipäivä: 1. joulukuuta 2028

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

210. Pitkä positio SPAIN GOVT EUR 1 000 000 (ISIN ES00000127A2).

Maturiteettipäivä: 30. heinäkuuta 2030

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

211. Lyhyt positio FRANCE GOVT EUR 1 000 000 (ISIN FR0012993103).

Maturiteettipäivä: 25. toukokuuta 2031
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

212. Lyhyt positio GERMANY GOVT EUR 1 000 000 (ISIN DE0001135176).

Maturiteettipäivä: 4. tammikuuta 2031
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

213. Pitkä positio UNITED KINGDOM GOVT GBP 1 000 000 (ISIN GB0004893086).

Maturiteettipäivä: 7. kesäkuuta 2032
EPV:n instrumentin valuutta: GBP

214. Pitkä positio PORTUGAL GOVT EUR 1 000 000 (ISIN PTOTEXOE0024).

Maturiteettipäivä: 15. kesäkuuta 2029
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

215. Lyhyt positio UNITED STATES GOVT USD 1 000 000 (ISIN US91282CAV37).

Maturiteettipäivä: 15. marraskuuta 2030
EPV:n instrumentin valuutta USD

216. Pitkä positio BRAZIL GOVT (lunastettavissa) 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).

Maturiteettipäivä: 13. tammikuuta 2028
EPV:n instrumentin valuutta: USD

217. Pitkä positio BRAZIL GOVT (lunastettavissa) 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).

Maturiteettipäivä: 19. toukokuuta 2033
EPV:n instrumentin valuutta USD

218. 10 vuoden IRS EURO – saadaan vaihtuvaa korkoa ja maksetaan kiinteää korkoa.

Kiinteäkorkoinen puoli: maksetaan vuosittain
Vaihtuva korko: kolmen kuukauden Euribor-korko, saadaan neljännesvuosittain. Koronlaskutapa: ACT/360
Nimellisarvo: 10 000 000 EUR
Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen
Voimaantulopäivä kirjauspäivänä (ts. käytetään kirjauspäivän kursseja markkinoiden sulkeutuessa).
Maturiteettipäivä: kirjauspäivä + 10 vuotta
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

219. 5 vuoden IRS EURO – saadaan vaihtuvaa korkoa ja maksetaan kiinteää korkoa.

Kiinteäkorkoinen puoli: maksetaan vuosittain
Vaihtuva korko: kuuden kuukauden Euribor-korko, saadaan joka kuudes kuukausi Koronlaskutapa: ACT/360
Nimellisarvo: 10 000 000 EUR
Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen
Voimaantulopäivä kirjauspäivänä (ts. käytetään kirjauspäivän kursseja markkinoiden sulkeutuessa).
Maturiteettipäivä: kirjauspäivä + 5 vuotta
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

220. Viiden vuoden markkinahintaan arvostettu EUR/USD-swapsopimus. Saadaan Yhdysvaltain dollareita ja maksetaan euroja.

EUR: kolmen kuukauden ESTER-korko, maksetaan neljännesvuosittain koronkorkona 2 päivän maksuviiveellä. Koronlaskutapa: ACT/360

USD: kolmen kuukauden SOFR-korko, saadaan neljännesvuosittain koronkorkona 2 päivän maksuviiveellä. Koronlaskutapa: ACT/360

Osa 1 – USD: Nimellisarvo 10 000 000 euroa vastaava, mukautetaan neljännesvuosittain.

Osa 2 – EUR: Nimellisarvo 10 000 000 EUR

Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen

Voimaantulopäivä kirjauspäivä + 6 kuukautta

Maturiteettipäivä: kirjauspäivä + 5,5 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Ks. myös tämän liitteen 6 jakso – Instrumentteja koskevat lisäeritelmät

221. 10 vuoden IRS EURO – saadaan ESTER-korkoa ja maksetaan Euribor-korkoa.

ESTER-puoli: saadaan vuosittain. Koronlaskutapa: ACT/360

Euribor-puoli: kolmen kuukauden Euribor + peruspisteet, maksetaan neljännesvuosittain. Koronlaskutapa: ACT/360

Nimellisarvo: 10 000 000 EUR

Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen

Voimaantulopäivä kirjauspäivänä (ts. käytetään kirjauspäivän kursseja markkinoiden sulkeutuessa)

Maturiteettipäivä: Syyskuu vuosi T + 9 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

222. Pitkä positio ITALY GOVT (inflaatio) 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052).

Maturiteettipäivä: 15. toukokuuta 2030

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

223. Viiden vuoden nollakuponki-inflaatioswap EUR – saadaan inflaatioindeksiin sidottua tuottoa ja maksetaan kiinteää korkoa (r).

Inflaatioindeksi: KHI (HICPxT)

Kiinteäkorkoinen puoli (kiinteä maksu): $[(1 + r)^5 - 1]$

Saatava inflaatioindeksiin sidottu tuotto: $\left[\left(\frac{CPI \text{ at the end (maturity) date}}{CPI \text{ at the start date}}\right) - 1\right]$

Nimellisarvo: 10 000 000 EUR

Koronmäärityspäivä: kesäkuu vuosi T-1

Viimeinen tarkistus: elokuu vuosi T+4

Maturiteettipäivä: Syyskuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

224. Kahden vuoden euroswaptio viiden vuoden koronvaihtosopimuksella (IRS EUR) – saadaan kiinteää korkoa ja maksetaan vaihtuvaa korkoa.

Nimellisarvo: 10 000 000 EUR

Laitos on swapia koskevan option myyjä. Laitoksen vastapuoli ostaa oikeuden tehdä swap laitoksen kanssa. Jos vastapuoli käyttää oikeuttaan, vastapuoli saa vaihtuvaa korkoa samalla kun laitos saa kiinteää korkoa.

Swaptio kahden vuoden maturiteetilla (kirjauspäivä + 2 vuotta) seuraavasti määritellyllä koronvaihtosopimuksella: Kiinteäkorkoinen puoli – saadaan vuosittain; Vaihtuva korko: kuuden kuukauden Euribor, maksetaan joka kuudes kuukausi; Nimellisarvo: 10 000 000 EUR; Uusintakäytäntö ja kalenteri: tavanomainen; Kohde-etuutena olevan vaihtosopimuksen voimaantulopäivä: kirjauspäivä + 2 vuotta.

Kohde-etuutena olevan vaihtosopimuksen erääntymispäivä: kirjauspäivä + 7 vuotta

Preemio maksettu kirjauspäivänä (kirjauspäivä). Käteissuoritus

Toteutushinnan perustana tässä instrumentissa määritellyn myöhennetyn swap-sopimuksen (forward starting swap) ATM-kurssi + 100 peruspistettä.

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Ulkomaanvaluutta

301. Kuuden kuukauden USD/EUR-termiinisopimus. Käteissuoritus. Pitkä positio USD – lyhyt positio EUR; Nimellisarvo 10 000 000 USD; myöhennetyn swap-sopimuksen toteutusarvo (forward strike): 100 % asiaankuuluvasta EKP:n avistakurssista kirjauspäivän lopussa.

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

302. Kuuden kuukauden EUR/GBP-termiinisopimus. Käteissuoritus. Pitkä positio EUR – lyhyt positio GBP; Nimellisarvo 10 000 000 GBP; myöhennetyn swap-sopimuksen toteutusarvo (forward strike): 100 % asiaankuuluvasta EKP:n avistakurssista kirjauspäivän lopussa.

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

303. Pitkä positio 10 000 000 USD käteinen.

Käteispositio. Katsotaan sisältävän kk kohdassa kuvatun sisäisen valuuttariskin

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

304. Pitkä EUR/USD-osto-optio (pitkä EUR, lyhyt USD). Käteissuoritus. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR Vastaava määrä EKP:n EUR/USD-avistakurssin mukaan kirjauspäivän lopussa.

Toteutushinta: 110 % EKP:n EUR/USD-viitekurssin perusteella kirjauspäivän lopussa.

Eräpäivä: kirjauspäivä + 1 vuosi

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

305. Pitkä EUR/USD-osto-optio (pitkä EUR, lyhyt USD). Käteissuoritus. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR Vastaava määrä EKP:n EUR/USD-avistakurssin mukaan kirjauspäivän lopussa.

Toteutushinta: 90 % EKP:n EUR/USD-viitekurssin perusteella kirjauspäivän lopussa.

Eräpäivä: kirjauspäivä + 1 vuosi

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

306. Lyhyt EUR/USD-osto-optio (pitkä EUR, lyhyt USD). Käteissuoritus. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR Vastaava määrä EKP:n EUR/USD-avistakurssin mukaan kirjauspäivän lopussa.

Toteutushinta: 100 % EKP:n EUR/USD-viitekurssin perusteella kirjauspäivän lopussa.

Eräpäivä: kirjauspäivä + 1 vuosi

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

307. Lyhyt EUR/GBP-osto-optio (pitkä EUR, lyhyt GBP). Käteissuoritus. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR Vastaava määrä EKP:n EUR/GBP-avistakurssin mukaan kirjauspäivän lopussa.

Toteutushinta: 110 % EKP:n EUR/GBP-viitekurssin perusteella kirjauspäivän lopussa.

Eräpäivä: kirjauspäivä + 1 vuosi

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

308. Pitkä EUR/JPY-myyntioptio (pitkä EUR, lyhyt JPY). Käteissuoritus. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR Vastaava määrä EKP:n EUR/JPY-avistakurssin mukaan kirjauspäivän lopussa.

Toteutushinta: 110 % EKP:n EUR/JPY-viitekurssin perusteella kirjauspäivän lopussa.

Eräpäivä: kirjauspäivä + 1 vuosi

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

309. Pitkä EUR/AUD-myyntioptio (pitkä EUR, lyhyt AUD). Käteissuoritus. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR Vastaava määrä EKP:n EUR/AUD-avistakurssin mukaan kirjauspäivän lopussa.

Toteutushinta: 110 % EKP:n EUR/AUD-viitekurssin perusteella kirjauspäivän lopussa.

Eräpäivä: kirjauspäivä + 1 vuosi

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

310. Kuuden kuukauden EUR/DKK-termiinisopimus (pitkä EUR, lyhyt DKK). Käteissuoritus; Nimellisarvo 10 000 000 EUR; EKP:n EUR/DKK-avistakurssi kirjauspäivän lopussa termiinikurssin määrittämiseksi.

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

311. Kuuden kuukauden netotettava EUR/BRL-termiinisopimus (pitkä EUR, lyhyt BRL); Nimellisarvo 10 000 000 EUR; EKP:n EUR/BRL-avistakurssi kirjauspäivän lopussa termiinikurssin määrittämiseksi.

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

HYÖDYKKEET

401. Lyhyt positio:
3 500 troy-unssia kuuden kuukauden London Gold -termiinisopimuksia (pitkä Gold, lyhyt USD). Käteissuoritus. Toteutushinta: päivän lopun 6 kuukauden termiinihinta kirjauspäivänä

EPV:n instrumentin valuutta: USD

402. Lyhyt positio: 3 500 troy-unssia 12 kuukauden London Gold -termiinisopimuksia (lyhyt Gold, pitkä USD). Käteissuoritus. Toteutushinta: päivän lopun 12 kuukauden termiinihinta kirjauspäivänä

EPV:n instrumentin valuutta: USD

403. Pitkä osto-optio: 30 000 barrelia, Brent Crude Oil (pitkä WTI, lyhyt USD). Käteissuoritus. Toteutushinta: päivän lopun 12 kuukauden termiinihinta kirjauspäivänä. Eräpäivä: kirjauspäivä + 6 kuukautta

EPV:n instrumentin valuutta USD

404. Lyhyt myyntioptio: 30 000 barrelia, Brent Crude Oil (pitkä WTI, lyhyt USD). Käteissuoritus. Toteutushinta: päivän lopun 12 kuukauden termiinihinta kirjauspäivänä. Eräpäivä: kirjauspäivä + 6 kuukautta

EPV:n instrumentin valuutta USD

405. Pitkä osto-optio: 5 000 troy-unssia, London Gold (pitkä Gold, lyhyt USD). Käteissuoritus. Toteutushinta: päivän lopun 18 kuukauden termiinihinta kirjauspäivänä. Eräpäivä: kirjauspäivä + 18 kuukautta

EPV:n instrumentin valuutta: USD

LUOTTOMARGINAALI (credit spread)

501. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Portugalille.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL

EPV:n instrumentin valuutta: USD

502. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Italialle.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL
EPV:n instrumentin valuutta: USD

503. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Espanjalle.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL
EPV:n instrumentin valuutta: USD

504. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Meksikolle.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL
EPV:n instrumentin valuutta: USD

505. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Brasilialle.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL
EPV:n instrumentin valuutta: USD

506. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Yhdistyneelle kuningaskunnalle.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL
EPV:n instrumentin valuutta: USD

507. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Telefonicalle (Tunnus: TEF SM).

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

508. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Telefonicalle (Tunnus: TEF SM).

Maturiteettipäivä: joulukuu vuosi T+2
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

509. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Avivalle (Tunnus: AV LN).

ISDA:n määritelmät vuosi 2003
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

510. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Avivalle (Tunnus: AV LN)

ISDA:n määritelmät vuosi 2003
Maturiteettipäivä: joulukuu vuosi T+2
EPV:n instrumentin valuutta: EUR

511. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Vodafonelle (Tunnus: VOD LN).

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

512. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus ENI SpA:lle (Tunnus: ENI IM).

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

513. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Eli Lillylle (Tunnus: LLY US).

Uudelleenjärjestelylauseke: Ei uudelleenjärjestelyä (XR14)
EPV:n instrumentin valuutta: USD

514. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Unileverille (Tunnus: UNA NA).

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

515. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Total SA:lle (Tunnus: FP FP).

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

516. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus Volkswagen Groupille (Tunnus: VOW GR).

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

517. Pitkä positio Turkin valtion velkakirjoissa, 1 000 000 USD (ISIN US900123CT57).

Maturiteettipäivä: 26. huhtikuuta 2029

EPV:n instrumentin valuutta: USD

518. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Turkille Voimaantulopäivä kirjauspäivänä.

Uudelleenjärjestelylauseke: FULL

EPV:n instrumentin valuutta: USD

519. Pitkä positio Telefonican velkakirjoissa, 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081).

Maturiteettipäivä: 12. tammikuuta 2028

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

520. Pitkä positio Volkswagen Groupin velkakirjoissa, 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233).

Maturiteettipäivä: 22. syyskuuta 2028

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

521. Lyhyt positio Volkswagen Groupin velkakirjoissa, 1 000 000 EUR (ISIN XS1167667283).

Maturiteettipäivä: 16. tammikuuta 2030

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

522. Pitkä positio Total SA:n velkakirjoissa, 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834).

Maturiteettipäivä: 11. heinäkuuta 2033

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

523. Pitkä positio AUSTRIA GOVT EUR 1 000 000 (ISIN AT0000A04967).

Maturiteettipäivä: 15. maaliskuuta 2037

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

524. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Itävallalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+15

EPV:n instrumentin valuutta: USD

525. Pitkä positio NETHERLANDS GOVT EUR 1 000 000 (ISIN NL0013552060).

Maturiteettipäivä: 15. tammikuuta 2040

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

526. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Alankomaille.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+20

EPV:n instrumentin valuutta: USD

527. Pitkä positio BELGIUM GOVT EUR 1 000 000 (ISIN BE0000348574).

Maturiteettipäivä: 22. kesäkuuta 2050

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

528. Pitkä positio (eli suojauksen osto): 1 000 000 USD luottoriskinvaihtosopimus Belgialle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+30

EPV:n instrumentin valuutta: USD

529. Pitkä positio (suojauksen osto) 10 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus iTraxx Europe -indeksin on-the-run-sarjalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

530. Lyhyt myynti-optio. 10 000 000 EUR Kohde-etuus iTraxx Europe -indeksin on-the-the-run-sarja (sama instrumentti kuin 529).

Toteutushinta: tasaoptio

Eräpäivä: kirjauspäivä + 6 kuukautta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

531. Pitkä positio AXA SA (lunastettavissa) 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642).

Maturiteettipäivä: 28. toukokuuta 2049

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

532. Pitkä positio AT&T Bond (lunastettavissa) 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79).

Maturiteettipäivä: 15. elokuuta 2037

EPV:n instrumentin valuutta: USD

533. Pitkä positio BAYER AG (lunastettavissa) 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268).

Maturiteettipäivä: 6. tammikuuta 2030

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

534. Pitkä positio ORANGE SA Bond (lunastettavissa) 1 000 000 USD (ISIN FR0013323870).

Maturiteettipäivä: 20. maaliskuuta 2028

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Korrelaatiokaupankäyntisalkku

601. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti) iTraxx Europe -indeksin on-the-run-sarjassa.

Kiinnittämispiste: 3 %

Irrottamispiste: 6 %

Nimellisarvo: 5 000 000 EUR

Maturiteetti: 5 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

602. Pitkä positio (eli suojauksen osto) 5 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus iTraxx Europe -indeksin viimeisimmälle on-the-run-sarjalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Nimellisarvo mukautettu suojaamaan 601:n CS01 ilman uudelleensuojausvaatimusta

603. Pitkä positio (eli suojauksen osto) iTraxx Europe -indeksin on-the-run-sarjassa.

Kiinnittämispiste: 3 %

Irrottamispiste: 6 %

Nimellisarvo: 5 000 000 EUR

Maturiteetti: 5 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

604. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti) 5 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus iTraxx Europe -indeksin viimeisimmälle on-the-run-sarjalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Nimellisarvo mukautettu suojaamaan 603:n CS01 ilman uudelleensuojausvaatimusta

605. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti) iTraxx Europe -indeksin on-the-run-sarjassa.

Kiinnittämispiste: 12 %

Irrottamispiste: 100 %

Nimellisarvo: 5 000 000 EUR

Maturiteetti: 5 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

606. Pitkä positio (eli suojauksen osto) 5 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus iTraxx Europe -indeksin viimeisimmälle on-the-run-sarjalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Nimellisarvo mukautettu suojaamaan 605:n CS01 ilman uudelleensuojausvaatimusta

607. Pitkä positio (eli suojauksen osto) iTraxx Europe -indeksin on-the-run-sarjassa.

Kiinnittämispiste: 12 %

Irrottamispiste: 100 %

Nimellisarvo: 5 000 000 EUR

Maturiteetti: 5 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

608. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti) 5 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus iTraxx Europe -indeksin viimeisimmälle on-the-run-sarjalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Nimellisarvo mukautettu suojaamaan 607:n CS01 ilman uudelleensuojausvaatimusta

609. Lyhyt positio (eli suojauksen myynti) iTraxx Europe -indeksin on-the-run-sarjassa.

Kiinnittämispiste: 3 %

Irrottamispiste: 6 %

Nimellisarvo: 5 000 000 EUR

Maturiteetti: 5 vuotta

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Palautusaste: 40 % kiinteä.

610. Pitkä positio (eli suojauksen osto) 5 000 000 EUR luottoriskinvaihtosopimus iTraxx Europe -indeksin viimeisimmälle on-the-run-sarjalle.

Maturiteettipäivä: kesäkuu vuosi T+4

EPV:n instrumentin valuutta: EUR

Nimellisarvo mukautettu suojaamaan 609:n CS01 ilman uudelleensuojausvaatimusta

3 jakso: Yksittäiset salkut – yksi väline

Laitosten on esitettävä seuraavien yksittäisten salkkujen tarvittavat riskimitat yhdessä nykyarvon kanssa:

Salkku	*Instrumenttien yhdistelmät:* Ensimmäisenä on instrumentin numero (tämän liitteen 2 jakson mukaisesti). Toinen numero esittää kunkin instrumentin lukumäärän tai sopimusten lukumäärän tapauksen mukaan.	EPV:n salkun valuutta	Tarvittavat riskimitat
1001	101 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 instrumentti	GBP	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 instrumentti	GBP	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 instrumentti	GBP	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 instrumentti	JPY	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO

1019	119 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1020	120 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1021	121 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2001	201 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2002	202 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2003	203 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2004	204 – 1 instrumentti	GBP	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2005	205 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2006	206 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2007	207 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2008	208 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2009	209 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2010	210 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2011	211 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2012	212 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2013	213 – 1 instrumentti	GBP	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2014	214 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2015	215 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2016	216 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2017	217 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2018	218 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2019	219 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2020	220 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2021	221 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2022	222 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

2023	223 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2024	224 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3001	301 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3002	302 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3003	303 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3004	304 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3005	305 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3006	306 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3007	307 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3008	308 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3009	309 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3010	310 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3011	311 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4001	401 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4002	402 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4003	403 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4004	404 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4005	405 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
5001	501 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5002	502 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5003	503 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5004	504 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5005	505 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5006	506 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5007	507 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5008	508 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5009	509 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5010	510 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5011	511 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5012	512 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5013	513 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5014	514 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5015	515 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5016	516 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5017	517 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5018	518 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5019	519 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5020	520 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5021	521 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5022	522 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5023	523 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5024	524 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5025	525 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5026	526 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5027	527 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5028	528 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5029	529 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5030	530 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5031	531 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5032	532 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5033	533 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5034	534 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
6001	601 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6002	602 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6003	603 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6004	604 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6005	605 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6006	606 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6007	607 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6008	608 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6009	609 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6010	610 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

4 jakso: Yksittäiset salkut – Useita välineitä

Laitosten on esitettävä seuraavien yksittäisten salkkujen tarvittavat riskimitat yhdessä nykyarvon kanssa:

Salkku	*Instrumenttien yhdistelmät:* Ensimmäisenä on instrumentin numero (tämän liitteen 2 jakson mukaisesti). Toinen numero esittää kunkin instrumentin lukumäärän tai sopimusten lukumäärän tapauksen mukaan.	EPV:n salkun valuutta	Tarvittavat riskimitat
1101	103 – 1 instrumentti 104 – 1 instrumentti 105 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 instrumentti 110 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 instrumentti 116 – 1 instrumentti	GBP	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 instrumentti 110 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO

1105	111 – 1 instrumentti 112 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1106	102 – 1 instrumentti 114 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1107	106 – 1 instrumentti 107 – 1 instrumentti 108 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1108	101 – 1 instrumentti 103 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1109	101 – 1 instrumentti 103 – 1 instrumentti 104 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
1110	102 – 1 instrumentti 104 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2201	206 – 1 instrumentti 207 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2202	206 – 1 instrumentti 207 – 1 instrumentti 208 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2203	206 – 1 instrumentti 207 – 1 instrumentti 208 – 1 instrumentti 209 – 1 instrumentti 210 – 1 instrumentti 211 – 1 instrumentti 212 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2204	201 – 1 instrumentti 218 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2205	201 – 1 instrumentti 219 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2206	218 – 1 instrumentti 219 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2207	201 – 1 instrumentti 202 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
2208	215 – 1 instrumentti 216 – 1 instrumentti 217 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2209	203 – 1 instrumentti 215 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO

2210	208 – 1 instrumentti 209 – 1 instrumentti 210 – 1 instrumentti 214 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2211	209 – 1 instrumentti 219 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
2212	201 – 1 instrumentti 223 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3301	301 – 1 instrumentti 302 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3302	303 – 1 instrumentti 304 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3303	304 – 1 instrumentti 305 – 1 instrumentti 306 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
3304	307 – 1 instrumentti 308 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4401	401 – 1 instrumentti 402 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4402	403 – 1 instrumentti 404 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
4403	401 – 1 instrumentti 404 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
5501	501 – 1 instrumentti 502 – 1 instrumentti 503 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5502	504 – 1 instrumentti 505 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5503	507 – 1 instrumentti 508 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5504	503 – 1 instrumentti 504 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5505	509 – 1 instrumentti 510 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5506	511 – 1 instrumentti 512 – 1 instrumentti 514 – 1 instrumentti 515 – 1 instrumentti 516 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5507	517 – 1 instrumentti 518 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5508	519 – 1 instrumentti 520 – 1 instrumentti 522 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5509	520 – 1 instrumentti 521 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5510	519 – 1 instrumentti 508 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5511	515 – 1 instrumentti 522 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5512	520 – 1 instrumentti 521 – 1 instrumentti 516 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5513	506 – 1 instrumentti 503 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5514	502 – 1 instrumentti 209 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5515	504 – 1 instrumentti 217 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5516	505 – 1 instrumentti 216 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5517	504 – 1 instrumentti 217 – 1 instrumentti 505 – 1 instrumentti 216 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5518	502 – 1 instrumentti 209 – 1 instrumentti 219 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5519	523 – 1 instrumentti 525 – 1 instrumentti 527 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5520	524 – 1 instrumentti 526 – 1 instrumentti 528 – 1 instrumentti	USD	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
5521	523 – 1 instrumentti 524 – 1 instrumentti 525 – 1 instrumentti 526 – 1 instrumentti 527 – 1 instrumentti 528 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO

5522	529 – 1 instrumentti 530 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
6601	601 – 1 instrumentti 602 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6602	603 – 1 instrumentti 604 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6603	605 – 1 instrumentti 606 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6604	607 – 1 instrumentti 608 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO
6605	609 – 1 instrumentti 610 – 1 instrumentti	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

5 jakso: Yhdistetyt salkut

Laitosten on esitettävä seuraavien yhdistettyjen rahoitussalkkujen tarvittavat riskimitat yhdessä nykyarvon kanssa:

Kumul. Salkku	Kuvaus	*Yksittäisten salkkujen yhdistäminen* (yksittäiset salkut tämän liitteen 3 ja 4 jaksossa esitetyillä numeroilla)	EPV:n salkun valuutta	Tarvittavat riskimitat
10000	Korrelaatioon perustumaton All-in-salkku	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
11000	OSAKETUOTTEET (kumulatiivinen)	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
12000	Korot (kumulatiivinen)	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
13000	Ulkomaanvaluutta (kumulatiivinen)	3301, 3303, 3304	EUR	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
14000	Hyödyke (kumulatiivinen)	4401, 4402	USD	VaR; stressitestattu VaR; SBM; DRC; RRAO
15000	Luottomarginaali (kumulatiivinen)	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR; stressitestattu VaR; IRC; SBM; DRC; RRAO
16000	Korrelaatiokaupankäyntisalkku EUR (kumulatiivinen)	6601, 6602	EUR	VaR; stressitestattu VaR; APR; SBM; DRC; RRAO

6 jakso: Instrumentteja koskevat lisäeritelmät

Laitosten on sovellettava tämän liitteen 2 jaksossa kuvattuihin rahoitusvälineisiin seuraavia lisäeritelmiä:

Instrumentti:	220
Kuvaus:	Viiden vuoden markkinahintaan arvostettu EUR/USD-swapsopimus Saadaan Yhdysvaltain dollareita ja maksetaan euroja. Nimellisarvo: 10 000 000 EUR, USD (10 000 000 EUR * FX USD/EUR)
Maksetaan:	vaihtuvakorkoinen osa 2
Saadaan:	vaihtuvakorkoinen osa 1
Nimellisarvon vaihto ja uudelleenmääritys:	Voimaantulopäivänä ja maturiteettipäivänä. Lisäksi jokaisena kuponkikoron maksupäivänä suoritetaan lisämaksu, joka vastaa Yhdysvaltain dollarin määräisen nimellisarvon mukautusta vaihtuvakorkoisessa osassa 2. Yhdysvaltain dollarin määräistä nimellisarvoa mukautetaan vastaamaan 10 000 000:aa euroa avistakurssia käyttäen kaksi pankkipäivää ennen kutakin maksupäivää.
Käteissaldo	Sisällytetään
Vaihtuvakorkoinen osa 1	
Nimellisarvo:	10 000 000 EUR vastaava, muunnettuna Yhdysvaltain dollareiksi avistakurssia käyttäen voimaantulopäivänä, mukautetaan neljännesvuosittain
Voimaantulopäivä:	kirjauspäivä + 6 kuukautta
Maturiteettipäivä:	kirjauspäivä + 5,5 vuotta
Maksupäivä:	Voimaantulopäivästä eteenpäin
Kuponkimaksuväli:	Neljännesvuosittain
Kuponkikorko:	kolmen kuukauden SOFR-korko + 0 peruspistettä.
Kuponkikoron tarkistusväli:	Neljännesvuosittain
Kuponkikoron laskemiskäytäntö:	Yhteenlaskettu päivittäin kolmen kuukauden jakson aikana
Kuponkikoron laskentatiheys:	Yksinkertainen korko
Koronlaskukäytäntö:	ACT/360
Maksun pankkipäivä:	LON, NYC, TARGET
Maksun pankkipäiväkäytäntö:	Sovellettu seuraava (Modified Following)
Nimellisarvon uudelleenmäärityksen pankkipäivä:	LON, NYC, TARGET
Nimellisarvon uudelleenmäärityksen pankkipäiväkäytäntö:	Edeltävä
Kuponkikoron uudelleenmäärityksen pankkipäivä:	LON, NYC, TARGET
Kuponkikoron uudelleenmäärityksen pankkipäiväkäytäntö:	Edeltävä

Vaihtuvakorkoinen osa 2	
Nimellisarvo:	10 000 000 EUR
Voimaantulopäivä:	kirjauspäivä + 6 kuukautta
Maturiteettipäivä:	kirjauspäivä + 5,5 vuotta
Maksupäivä:	Voimaantulopäivästä eteenpäin
Kuponkimaksuväli:	Neljännesvuosittain
Kuponkikorko:	kolmen kuukauden ESTER-korko + 0 peruspistettä.
Kuponkikoron uudelleenmäärityksen tiheys:	Neljännesvuosittain
Kuponkikoron laskemiskäytäntö:	Yhteenlaskettu päivittäin kolmen kuukauden jakson aikana
Kuponkikoron laskentatiheys:	Yksinkertainen korko
Koronlaskukäytäntö:	ACT/360
Maksun pankkipäivä:	LON, NYC, TARGET
Maksun pankkipäivä:	Sovellettu seuraava (Modified Following)
Nimellisarvon uudelleenmäärityksen pankkipäivä:	LON, NYC, TARGET
Nimellisarvon uudelleenmäärityksen pankkipäiväkäytäntö:	Edeltävä
Kuponkikoron uudelleenmäärityksen pankkipäivä:	LON, NYC, TARGET
Kuponkikoron uudelleenmäärityksen pankkipäiväkäytäntö:	Edeltävä”

7 jakso: SBM:n validointisalkut

a) Laitosten on ilmoitettava liitteessä X määriteltyjen salkkujen SBM-riskimitta (SBM:n validointisalkut) osana IMV-tietoja ja toimitettava ne IMV-tietojen toimittamista koskevien raportointipäivien mukaisesti.

b) SBM:n validointisalkkuja vastaavien tulosten toimittamiseen sovelletaan seuraavaa:

i. Laitosten on ilmoitettava ainoastaan lomake C120.02 ja rajattava tässä lomakkeessa ilmoittaminen raportointivaluutan tuloksiin (eli lomakkeen C120.02 sarake 0060 jätetään täyttämättä ja lomakkeita C 106.00 ja C 106.01 ei ilmoiteta SBM:n validointisalkkujen osalta);

ii. Laitosten on oletettava, että liitteessä X luetelluilla instrumenteilla määritellyt riskiherkkyydet ja kaarevuusriskipositiot ilmaistaan laitoksen raportointivaluutassa ja että tiedot annetaan lomakkeita C 106.01/C 120.01 koskevissa raportointiohjeissa ja liitteessä VI (malliohjeet) olevassa vastaavassa taulukossa, jossa on ohjeet näiden lomakkeiden raportointia varten.””

LIITE III

”LIITE VI

VERTAILUSALKUT VALVONTATARKOITUKSIIN – TULOKSET

LOMAKEKOHTAISET OHJEET

C 106.00 – IMV-arvo (Initial Market Valuation) ja poissulkemisperusteet 57
C 106.01 – Herkkyysperusteinen menetelmä (SBM). Riskiherkkyydet instrumenteittain 57
C 107.01 – VaR ja sVaR-luvut, korrelaatioon perustumattomat kaupankäyntisalkut. Yksityiskohtainen kuvaus. 61
C 107.02 – VaR, sVaR ja nykyarvo – Korrelaatioon perustumattomat kaupankäyntisalkut. EPV:n salkun valuutan tulokset. 63
C 108.00 – Voittojen ja tappioiden aikasarjat 64
C 109.01 – IRC (incremental risk charge). Mallin tiedot 65
C 109.02 – IRC (incremental risk charge). Salkkukohtaiset tiedot 65
C 109.03 – IRC (incremental risk charge). Salkku-/päivämääräkohtainen määrä 66
C 110.01 – Korrelaatiokaupankäynti (CT). Mallin tiedot 67
C 110.02 – Korrelaatiokaupankäynti (CT). Salkkukohtaiset tiedot 68
C 110.03 – Korrelaatiokaupankäynti (CT). Salkku-/päivämääräkohtainen kaikkien hintojen riski (APR) 69
C 120.01 – Herkkyysperusteinen menetelmä (SBM). RISKIHERKKYYDET INSTRUMENTEITTAIN/SALKUITTAIN 69
C 120.02 – Herkkyysperusteinen menetelmä (SBM). OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN 72
C 120.04 – MAKSUKYVYTTÖMYYSRISKIÄ KOSKEVA OMIEN VAROJEN VAATIMUS (DRC). MARKKINA-ARVOT JA ÄKILLISESTÄ MAKSUKYVYTTÖMYYDESTÄ (JTD) AIHEUTUVAT BRUTTOMÄÄRÄT INSTRUMENTEITTAIN/SALKKUITTAIN 74
C 120.05 – MAKSUKYVYTTÖMYYSRISKIÄ KOSKEVA OMIEN VAROJEN VAATIMUS (DRC). OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN 80
C 120.06 – VAIHTOEHTOINEN STANDARDIMENETELMÄ (ASA). Omien varojen vaatimus (OFR) 82

LOMAKEKOHTAISET OHJEET

C 106.00 – IMV-arvo (Initial Market Valuation) ja poissulkemisperusteet

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Instrumentin numero	Liite V, 2 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu instrumentin numero.
0020	VaR- ja sVaR-lukuja varten mallinnettu instrumentti (KYLLÄ/EI)		Tässä ilmoitetaan joko KYLLÄ tai EI.
0030	IRC-arvoa varten mallinnettu instrumentti (KYLLÄ/EI)		Tässä ilmoitetaan joko KYLLÄ tai EI.
0040	Korrelaatiokaupan-käyntiä varten mallinnettu instrumentti (KYLLÄ/EI)		Tässä ilmoitetaan joko KYLLÄ tai EI.
0050	Poissulkemisen perusteet	3 artiklan 2 kohta	Ilmoitetaan jokin seuraavista: (a) malli ei ole sääntelyviranomaisen hyväksymä; (b) instrumenttia tai kohde-etuutta ei ole hyväksytty sisäisesti; (c) kohde-etuutta tai mallintavaa ominaisuutta ei ole huomioitu sisäisesti; (d) muut perusteet poissulkemiselle. Muuta perustetta koskeva selitys ilmoitetaan sarakkeessa 0060.
0060	Vapaa tekstikenttä		Laitos voi tässä sarakkeessa antaa mitä tahansa lisätietoja.
0070	IMV-arvo (Initial Market Valuation)		Kunkin instrumentin markkinahintaan arvostettu arvo viitepäivänä klo 17.30 CET (kuten liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa on täsmennetty). Solu jätetään tyhjäksi, jos laitos ei halua ilmoittaa IMV-arvoa tietylle salkulle (toisin sanoen nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on nolla).

C 106.01 – Herkkyysperusteinen menetelmä (SBM). Riskiherkkyydet instrumenteittain

Laitosten on ilmoitettava herkkyydet riskitekijöille, joille instrumentti on alttiina. Kukin riskitekijä/herkkyys ilmoitetaan yhdellä rivillä. Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 g artiklassa määritelty kyseisen riskitekijän nouseva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVRk+) tai kyseisen riskitekijän laskeva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVRk-) ilmoitetaan erillisillä riveillä. Kaikkien arvojen on viitattava tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b kohdan ii alakohdassa täsmennettyyn IMV-viitepäivään (ja ensimmäiseen SBM-viitepäivään). Laitosten on ilmoitettava kukin instrumentin numeron, riskitekijän tunnisteen (sarake 0010), alaluokan (sarake 0020) ja lisätunnisteen (sarake 0030) yhdistelmä vain kerran.

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Instrumentin numero	Liite V, 2 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu instrumentin numero.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Riskitekijän tunniste	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l, 325 m, 325 n, 325 o, 325 p ja 325 q artikla	Ilmoitetaan riskitekijän tunniste tämän liitteen lopussa olevan taulukon mukaisesti.
0020	Alaluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 3 kohta	Ilmoitetaan alaluokka. Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa — yleinen korkoriski, vastaus on valuutan nimi asiaankuuluvassa riskittömässä korossa tai inflaatio- tai valuuttojen välisessä korkoperusteriskitekijässä (ISO 4217 -valuuttakoodien mukaisesti, esim. ”EUR”). — muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski, vastaus on alaluokan numero asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 ah artiklan 1 kohdan taulukossa 4. — arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun ulkopuolinen luottomarginaaliriski (non-ACTP CSR), vastaus on kyseisen asetuksen 325 am artiklan 1 kohdan taulukossa 7 oleva alaluokan numero. — arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun luottomarginaaliriski (ACTP CSR), vastaus on kyseisen asetuksen 325 ak artiklan taulukossa 6 oleva alaluokan numero. — osakeriski, vastaus on kyseisen asetuksen 325 ap artiklan 1 kohdan taulukossa 8 oleva alaluokan numero. — hyödykeriski, vastaus on kyseisen asetuksen 325 as artiklan taulukossa 9 oleva alaluokan numero. — valuuttariski ja delta- tai kaarevuuskomponentit, vastaus on valuutan nimi (esim. ”USD”, ilmoitettujen valuuttakoodien on oltava ISO 4217 -valuuttakoodien mukaisia). — valuuttariski ja vegakomponentti, vastaus on valuuttaparin nimi (esim. ”EUR_USD”, ilmoitettujen valuuttakoodien on oltava ISO 4217 -valuuttakoodien mukaisia).
0030	Lisätunniste1	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325l–325 q ja 325 ai artikla	Ilmoitetaan seuraavat tiedot, joissa riskitekijä eritellään alaluokkatasolla. Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa — yleinen korkoriski ja deltakomponentti, vastaus on riskittömien korkojen käyrän nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste. — muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski tai riskiluokka arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun luottomarginaaliriski (ACTP CSR), vastaus on liikkeeseenlaskijan nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste, ja sen on oltava sama kahdelle ilmoitetulle herkkyydelle kahden riskitekijän osalta, joiden

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			korrelaatioparametri $\rho_{kl}^{(name)}$ on 1 asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 ai artiklan 1 kohdan mukaisesti. — arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun ulkopuolinen luottomarginaaliriski (non-ACTP CSR), vastaus on etuoikeusluokan nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste. — osakeriski, vastaus on osakkeiden liikkeeseenlaskijan nimi tai vastaava yksilöllinen tunniste. — hyödykeriski, vastaus on hyödykkeen nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste. Jos mikään näistä tapauksista ei ole sovellettavissa, laitosten on ilmoitettava tyhjä arvo (NULL) tämän ilmaisemiseksi.
0050	Riskiherkkyys (raportointivaluutan tulokset)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 2 kohta ja 325 g, 325 r, 325 s, 325 t ja 325 ax artikla	Riskiherkkyydet (delta-/vegaherkkyydet ja kaarevuusriskipositiot) ilmoitetaan kunkin instrumentin tasolla kaikkien asiaankuuluvien riskitekijöiden osalta sarakkeiden 0010–0030 mukaisesti. Arvot ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutassa. Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa — herkkyysperusteisen menetelmän deltariskikomponenttia, ilmoitetaan nettoherkkyys asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 r artiklassa määritetylle riskitekijälle (S_k). Jos laitokset ovat saaneet toimivaltaiselta viranomaiseltaan luvan käyttää vaihtoehtoisia deltariskiherkkyyksien määritelmiä kyseisen asetuksen 325 t artiklan 5 kohdan mukaisesti, niiden on viitattava näihin vaihtoehtoisiin määritelmiin raportoinnissa. — herkkyysperusteisen menetelmän vegariskikomponenttia, ilmoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 s artiklassa määritelty option vegariskiherkkyys tietylle riskitekijälle (S_k). Jos laitokset ovat saaneet toimivaltaiselta viranomaiseltaan luvan käyttää vaihtoehtoisia vegariskiherkkyyksien laskelmia kyseisen asetuksen 325 t artiklan 6 kohdan mukaisesti, niiden on viitattava näihin vaihtoehtoisiin laskelmiin raportoinnissa. Riippumatta siitä, käyttääkö laitos kyseisen asetuksen 325 s artiklan määritelmää tai 325 t artiklan 6 kohdan mukaista vaihtoehtoista laskentaa, herkkyys ilmoitetaan sen jälkeen, kun se on painotettu vastaavalla implisiittisellä volatiliteetilla. — herkkyysperusteisen menetelmän kaarevuusriskikomponenttia, asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 g artiklassa määritelty kyseisen riskitekijän nouseva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVR_k^+) tai kyseisen riskitekijän laskeva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVR_k^-) ilmoitetaan erillisillä riveillä. Ilmoitettava luku on ilmaistava vähintään kahden desimaalin tarkkuudella. Nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on todella nolla.
0060	Raportointivaluutta		Ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutan nimi (ilmoitetun arvon on oltava ISO 4217 -standardin mukainen valuuttakoodi, esim. ”EUR”).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0070	Riskiherkkyys (EPV:n instrumentin valuutan tulokset)	Tämän asetuksen liitteessä V oleva 2 jakso ja Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 2 kohta ja 325 g, 325 r ja 325 s artikla	Arvot ilmoitetaan sarakkeessa 0050 annettujen ohjeiden mukaisesti, mutta ne on muunnettava käyttämällä tämän asetuksen liitteessä V olevassa 2 jaksossa määriteltyä instrumentin valuuttaan liittyvää EKP:n avistakurssia.
0080	Hinnoittelumalli	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 t artikla	Laitoksen on täsmennettävä herkkyyksien johtamiseen sovellettava hinnoittelumalli. Ilmoitetaan yksi seuraavista: a) ”laitoksen hinnoittelumallit, joiden perusteella se raportoi toimivalle johdolle voitoista ja tappioista” (asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 t artiklan 1 kohdan ensimmäinen alakohta); b) ”laitoksen sisäisten mallien menetelmä” (kyseisen asetuksen 325 t artiklan 1 kohdan toinen alakohta).
0090	Herkkyyksien määritelmä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 r, 325 s ja 325 t artikla	Laitoksen on täsmennettävä omien varojen vaatimusten laskennassa sovellettava herkkyyksien määritelmä. Ilmoitetaan yksi seuraavista: a) ”herkkyyksien määritelmä asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 r ja 325 s artiklassa”; b) ”herkkyyksien määritelmä asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 t artiklan 5 ja 6 kohdan mukaisesti”. Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa herkkyysperusteisen menetelmän kaarevuusriskikomponenttia, ilmoitetaan edellä b alakohdassa tarkoitettu arvo, jos jokin ilmoitetun kaarevuusriskiposition laskennassa käytetyistä herkkyyksistä perustuu asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 t artiklan 5 ja 6 kohdan mukaiseen herkkyyksien määritelmään, ja muissa tapauksissa ilmoitetaan a alakohdassa tarkoitettu arvo.
0100	Vapaa tekstikenttä		Laitos voi tässä sarakkeessa antaa lisätietoja hinnoittelumallista ja sovelletusta herkkyyksien määritelmästä.
0110	Lisätunniste2	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artiklan 2 kohta	Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa hyödykeriski ja herkkyysperusteisen menetelmän deltariskikomponenttia, tässä ilmoitetaan toimituspaikkaa koskevat oikeudelliset käsitteet tai muu vastaavaa yksilöllinen tunniste. Jos mikään näistä tapauksista ei ole sovellettavissa, laitosten on ilmoitettava tyhjä arvo (NULL) tämän ilmaisemiseksi.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0120	Luottoluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artiklan 1 kohta ja 325 ah artiklan 1 kohta	Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski ja herkkyysperusteisen menetelmän deltariskikomponenttia, ilmoitetaan yksi seuraavista: a) ”LL 1”; b) ”LL 2”; c) ”LL 3”; d) ”LL 4”; e) ”LL 5”; f) ”LL 6”; g) ”Ei luottoluokkaa (luokittelematon)”. Jos mikään näistä tapauksista ei ole sovellettavissa, laitosten on ilmoitettava tyhjä arvo (NULL) tämän ilmaisemiseksi.

C 107.01 – VaR ja sVaR-luvut, korrelaatioon perustumattomat kaupankäyntisalkut. Yksityiskohtainen kuvaus.

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010–0060	VaR-luku		
0010	Menetelmä		Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) aikaisempi simulaatio; b) Monte Carlo-simulaatio; c) parametrimenetelmä; d) yhdistelmä / muu menetelmä (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto d, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot sarakkeessa 0020.
0020	Laskenta 10 päivän aikavälillä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artiklan 1 kohta	Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) 1 päivä mitoitettuna uudelleen 10 päivään; b) 10 päivää päällekkäisillä ajanjaksoilla; c) 10 päivää muilla menetelmillä. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0030	Havaintojakson pituus	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artiklan 1 kohdan d alakohta	Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) enintään 1 vuosi; b) enemmän kuin 1 vuosi mutta enintään 2 vuotta; c) enemmän kuin 2 vuosi mutta enintään 3 vuotta; d) enemmän kuin 3 vuotta. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0040	Tietojen painottaminen	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artiklan 1 kohdan d alakohta	Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) painottamaton (VaR-tietojen painottaminen); b) painotettu (VaR-tietojen painottaminen); c) painottamaton (a alakohta) tai painotettu (b alakohta) (VaR-tietojen painottaminen) sen mukaan, kumpi näistä on suurempi. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0050	Toteutumatestauslisäys	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 366 artiklan 2 kohta	Toteutumatestauslisäyksellä tarkoitetaan lisäkerrointa, jonka arvo on välillä 0 ja 1 asetuksen (EU) N:o 575/2013 366 artiklan 2 kohdassa olevan taulukon 1 mukaisesti. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0060	Sääntelyn mukainen VaR-lisäys	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 366 artiklan 2 kohta (”vähintään 3”)	Sääntelyn mukaisella VaR-lisäyksellä tarkoitetaan toimivaltaisen viranomaisen edellyttämää lisäystä VaR-lukua koskevaan kertoimeen (vähintään 3) asetuksen (EU) N:o 575/2013 366 artiklan 2 kohdan mukaisesti. Sääntelyn mukainen VaR-lisäys on toteutumatestauslisäyksen ja tapauksen mukaan laadullisen lisäyksen summa, joka lisätään lukuun 3. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0070–0100	SVaR (eli stressitestattu VaR)		
0070	Menetelmä		Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) aikaisempi simulaatio; b) Monte Carlo-simulaatio; c) parametrimenetelmä; d) yhdistelmä / muu menetelmä (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto d, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot sarakkeessa 0020.
0080	Laskenta 10 päivän aikavälillä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artiklan 1 kohta	Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) 1 päivä mitoitettuna uudelleen 10 päivään; b) 10 päivää päällekkäisillä ajanjaksoilla; c) 10 päivää muilla menetelmillä. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0090	Sääntelyn mukainen SVaR-lisäys	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 366 artiklan 2 kohta	Sääntelyn mukaisella lisäyksellä tarkoitetaan toimivaltaisen viranomaisen edellyttämää lisäystä SVaR-lukua koskevaan kertoimeen (vähintään 3) asetuksen (EU) N:o 575/2013 366 artiklan 2 kohdan mukaisesti. Sääntelyn mukainen lisäys on luvun 3, toteutumatestauslisäyksen ja (tapauksen mukaan) laadullisen lisäyksen summa

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0100	SVaR-luvun ajanjakso	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artiklan 2 kohta	Sarakkeessa 0010 ilmoitetaan jokin seuraavista: a) stressitestatun VaR-luvun päivittäinen laskenta kalibroituna yhdelle keskeytymättömälle 12 kuukauden ajanjaksolle, joka alkaa sarakkeessa 0020 ilmoitetusta päivästä; b) stressitestatun VaR-luvun viikoittainen laskenta kalibroituna yhdelle keskeytymättömälle 12 kuukauden ajanjaksolle, joka alkaa sarakkeessa 0020 ilmoitetusta päivästä; c) stressitestatun VaR-luvun päivittäinen laskenta kalibroituna eri keskeytymättömille 12 kuukauden ajanjaksoille lomakkeen C107.02 sarakkeessa 0010 ilmoitettuina stressitestatun VaR-luvun raportointipäivinä sarakkeessa 0020 ilmoitetuista päivistä alkaen; d) stressitestatun VaR-luvun viikoittainen laskenta kalibroituna eri keskeytymättömille 12 kuukauden ajanjaksoille lomakkeen C107.02 sarakkeessa 0010 ilmoitettuina stressitestatun VaR-luvun raportointipäivinä sarakkeessa 0020 ilmoitetuista päivistä alkaen; e) stressitestatun VaR-luvun laskennan päivittäinen enimmäismäärä kalibroituna useammalle kuin yhdelle 12 kuukauden ajanjaksolle; f) stressitestatun VaR-luvun laskennan viikoittainen enimmäismäärä kalibroituna useammalle kuin yhdelle 12 kuukauden ajanjaksolle; g) muut stressitestatun VaR-luvun kalibrointivaihtoehdot (täsmennetään). Laitoksen on ilmoitettava sarakkeessa 0020 stressitestatun VaR-luvun laskennassa käytetty alkamispäivämäärä muodossa ”pp/kk/vvvv”, kun kyse on sarakkeessa 0010 annetusta vaihtoehdosta a tai b, ja kussakin stressitestatun VaR-luvun laskennassa käytetyt alkamispäivämäärät muodossa ”pp/kk/vvvv”, kun kyse on sarakkeessa 0010 annetusta vaihtoehdosta c tai d. Laitoksen on myös käytettävä saraketta 0020 antaakseen tarkemmat tiedot 12 kuukauden ajanjaksosta, jota on käytetty kussakin stressitestatun VaR-luvun laskennassa sarakkeessa 0010 annettujen vaihtoehtojen e, f ja g tapauksessa.

C 107.02 – VaR, sVaR ja nykyarvo – Korrelaatioon perustumattomat kaupankäyntisalkut. EPV:n salkun valuutan tulokset.

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Päivämäärä		VaR-lukua, sVaR-lukua ja nykyarvoa koskevat tulokset ilmoitetaan kaikilta 10 kaupankäyntipäivältä ajanjaksolla, joka alkaa riskimittojen ensimmäisestä viitepäivästä ja päättyy riskimittojen viimeiseen viitepäivään (ja viimeiseen ASA-viitepäivään), kuten liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa on täsmennetty. Päivämäärät ilmoitetaan muodossa ”pp/kk/vvvv”.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0020	VaR-luku	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artikla	Ilmoitetaan jokaiselle salkulle saatu sääntelyn mukainen 10 päivän VaR-luku soveltamatta sääntelyn mukaista kerrointa ”vähintään 3”. Luvut ilmoitetaan jokaiselle sarakkeessa 0010 annetulle päivämäärälle. Solu jätetään tyhjäksi, jos laitos ei laske VaR-lukua sarakkeessa 0010 ilmoitetulla päivämäärällä (toisin sanoen nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on nolla).
0030	sVaR-luku	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artikla	Ilmoitetaan jokaiselle salkulle saatu sääntelyyn perustuva 10 päivän sVaR-luku soveltamatta sääntelyyn perustuvaa kerrointa ”vähintään 3”. Luvut ilmoitetaan jokaiselle sarakkeessa 0010 annetulle päivämäärälle. Solu jätetään tyhjäksi, jos laitos ei laske sVaR-lukua sarakkeessa 0010 ilmoitetulla päivämäärällä (toisin sanoen nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on nolla).
0040	Nykyarvo		Kunkin salkun nykyarvo (PV) on ilmoitettava. Luvut ilmoitetaan jokaiselle sarakkeessa 0010 annetulle päivämäärälle. Solu jätetään tyhjäksi, jos laitos ei laske nykyarvoa sarakkeessa 0010 ilmoitetulla päivämäärällä (toisin sanoen nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on nolla).

C 108.00 – Voittojen ja tappioiden aikasarjat

Lomakkeen C 108.00 (Voittojen ja tappioiden aikasarjat) täyttävät vain laitokset, jotka laskevat VaR-luvun käyttämällä historiallista simulaatiota.

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Päivämäärä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 365 artiklan 1 kohdan d alakohta	Laitosten on jokaisena laitoksen lainkäyttöalueen kaupankäyntipäivänä toimitettava voittoja ja tappioita koskevat aikasarjat, joita on käytetty VaR-luvun laskemiseksi lomakkeen C 107.02 sarakkeessa 0010; havaintoja on oltava vähintään 250 alkaen liitteessä V olevan 1 jakson b kohdan v alakohdassa täsmennetystä riskimittojen viimeisestä viitepäivästä (ja viimeisestä ASA-viitepäivästä) siten, että ajassa siirrytään taaksepäin.
0020	Päivittäiset voitot ja tappiot		Laitosten, jotka laskevat VaR-luvun käyttäen aikaisempiin tietoihin perustuvaa historiallista simulaatiota, on täytettävä laitoksen käyttämät aikaisemmat aikasarjat kokonaisuudessaan siten, että tietosarjat ovat vähintään yhden vuoden jaksolta ja salkun arvostuksen muutokset (eli päivittäiset voitot ja tappiot) laskettuina käyttämällä historiallisesti simuloituja päivittäisiä riskitekijämuutoksia (eli päivittäisiä voittoja ja tappioita koskevia aikasarjoja, joita on käytetty sääntelyn mukaisen yhden päivän VaR-luvun johtamiseksi).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Tämä solu jätetään tyhjäksi, jos tietty päivä on yleinen vapaapäivä kyseisellä lainkäyttöalueella (eli voittojen ja tappioiden arvona ilmoitetaan nolla vain, jos salkun hypoteettisessa arvossa ei tiettynä kaupankäyntipäivänä ollut minkäänlaista muutosta).

C 109.01 – IRC (incremental risk charge). Mallin tiedot

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Mallinnustekijöiden määrä		EPV/GL/2012/3 Ilmoitetaan mallinnustekijöiden määrä IRC-mallissa kokonaistasolla. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) 1 mallintamistekijä; b) 2 mallintamistekijää; c) enemmän kuin 2 mallintamistekijää. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen.
0020	LGD-lukujen lähde		EPV/GL/2012/3 Ilmoitetaan LGD-lukujen lähteet IRC-mallissa kokonaistasolla. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) markkinakäytäntö; b) IRB-menetelmässä käytetty LGD-luku; c) muu LDG-luvun lähde (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto c, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot tässä sarakkeessa.

C 109.02 – IRC (incremental risk charge). Salkkukohtaiset tiedot

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu salkun numero vain niille salkuille, joilta vaaditaan IRC.

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Likviditeettihorisontti	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 374 artiklan 5 kohta	EPV/GL/2012/3 Ilmoitetaan salkkutasolla sovellettu likviditeettihorisontti. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) enintään 3 kuukautta; b) enemmän kuin 3 kuukautta mutta enintään 6 kuukautta; c) enemmän kuin 6 kuukautta mutta enintään 9 kuukautta; d) enemmän kuin 9 kuukautta mutta enintään 12 kuukautta.
0020	PD-lukujen lähde		EPV/GL/2012/3 Ilmoitetaan salkkutasolla sovellettujen PD-lukujen lähde. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) luottoluokituslaitokset; b) IRB; c) markkinoiden implikoimat PD-luvut; d) muu PD-lukujen lähde (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto d, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot sarakkeessa 0020.
0030	Siirtymämatriisien lähde		EPV/GL/2012/3 Ilmoitetaan salkkutasolla sovellettujen siirtymämatriisien lähde. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) luottoluokituslaitokset; b) IRB; c) markkinoiden implikoimat siirtymämatriisit; d) muut siirtymämatriisien lähteet (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto d, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot sarakkeessa 0020.

C 109.03 – IRC (incremental risk charge). Salkku-/päivämääräkohtainen määrä

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu salkun numero vain niille salkuille, joilta vaaditaan IRC.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Päivämäärä		IRC-luku ilmoitetaan kaikilta 10 kaupankäyntipäivältä ajanjaksolla, joka alkaa riskimittojen ensimmäisestä viitepäivästä ja päättyy riskimittojen viimeiseen viitepäivään (ja viimeiseen ASA-viitepäivään), kuten liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa on täsmennetty. Päivämäärät ilmoitetaan muodossa ”pp/kk/vvvv”.
0020	IRC (incremental risk charge)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 372–376 artikla	EPV/GL/2012/3 Ilmoitetaan jokaiselle yksittäiselle salkulle saatu sääntelyn mukainen IRC-luku. Luvut ilmoitetaan jokaiselle sarakkeessa 0010 annetulle päivämäärälle. Solu jätetään tyhjäksi, jos laitos ei laske IRC-lukua sarakkeessa 0010 ilmoitetulla päivämäärällä (toisin sanoen nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on nolla).

C 110.01 – Korrelaatiokaupankäynti (CT). Mallin tiedot

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Mallinnustekijöiden määrä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artikla	Ilmoitetaan mallinnustekijöiden määrä korrelaatiokaupankäyntimallissa kokonaistasolla. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) 1 mallintamistekijä; b) 2 mallintamistekijää; c) enemmän kuin 2 mallintamistekijää. Laitoksen on käytettävä saraketta 0020, jos se haluaa selventää sarakkeessa 0010 annettua vastausta.
0020	LGD-lukujen lähde	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artikla	Ilmoitetaan LGD-lukujen lähteet korrelaatiokaupankäyntimallissa kokonaistasolla. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) markkinakäytäntö; b) IRB-menetelmässä käytetty LGD-luku; c) muut LDG-luvun lähteet (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto c, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot tässä sarakkeessa.

C 110.02 – Korrelaatiokaupankäynti (CT). Salkkukohtaiset tiedot

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu salkun numero vain niiden salkkujen osalta, joilta vaaditaan kaikkien hintojen riskiä kuvaava luku (APR).

Rivi	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Likviditeettihorisontti	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artiklan 2 kohta	Ilmoitetaan salkkutasolla sovellettu likviditeettihorisontti. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) enintään 3 kuukautta; b) enemmän kuin 3 kuukautta mutta enintään 6 kuukautta; c) enemmän kuin 6 kuukautta mutta enintään 9 kuukautta; d) enemmän kuin 9 kuukautta mutta enintään 12 kuukautta.
0020	PD-lukujen lähde	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artikla	Ilmoitetaan salkkutasolla sovellettujen PD-lukujen lähde. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) luottoluokituslaitokset; b) IRB; c) markkinoiden implikoimat PD-luvut; d) muu PD-lukujen lähde (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto d, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot sarakkeessa 0020.
0030	Siirtymämatriisien lähde	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artikla	Ilmoitetaan salkkutasolla sovellettujen siirtymämatriisien lähde. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) luottoluokituslaitokset; b) IRB; c) markkinoiden implikoimat siirtymämatriisit; d) muut siirtymämatriisien lähteet (täsmennetään). Laitoksen on käytettävä saraketta 0020 sarakkeessa 0010 annetun vastauksen selventämiseen. Jos sarakkeessa 0010 on valittu vaihtoehto d, laitoksen on annettava yksityiskohtaiset tiedot sarakkeessa 0020.

C 110.03 – Korrelaatiokaupankäynti (CT). Salkku-/päivämääräkohtainen kaikkien hintojen riski (APR)

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu salkun numero vain niiden salkkujen osalta, joilta vaaditaan kaikkien hintojen riskiä kuvaava luku (APR).

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Päivämäärä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artikla	APR-luku (kaikkien hintojen riski) ilmoitetaan kaikilta 10 kaupankäyntipäivältä ajanjaksolla, joka alkaa riskimittojen ensimmäisestä viitepäivästä ja päättyy riskimittojen viimeiseen viitepäivään (ja viimeiseen ASA-viitepäivään), kuten liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa on täsmennetty. Päivämäärät ilmoitetaan muodossa ”pp/kk/vvvv”.
0060	Kaikkien hintojen riski (APR)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 377 artikla	Ilmoitetaan sovelletulla sääntelyn mukaisella korrelaatiokaupankäynnin mallilla kullekin salkulle saadut tulokset. Luvut ilmoitetaan jokaiselle sarakkeessa 0010 annetulle päivämäärälle. Solu jätetään tyhjäksi, jos laitos ei käytä korrelaatiokaupankäynnin mallia sarakkeessa 0010 ilmoitetulla päivämäärällä (toisin sanoen nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on nolla).

C 120.01 – Herkkyysperusteinen menetelmä (SBM). RISKIHERKKYYDET INSTRUMENTEITTAIN/SALKUITTAIN

Laitosten on ilmoitettava instrumenttikohtaisesti herkkyydet riskitekijöille, joille instrumentti on alttiina. Kukin riskitekijä/herkkyys ilmoitetaan yhdellä rivillä. Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 g artiklassa määritelty kyseisen riskitekijän nouseva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVR_k^+) tai kyseisen riskitekijän laskeva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVR_k^-) ilmoitetaan erillisillä riveillä. Kaikkien arvojen on viitattava tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b kohdan v alakohdassa täsmennettyyn riskimittojen viimeiseen viitepäivään (ja viimeiseen ASA-viitepäivään). Laitosten on ilmoitettava kukin salkun, instrumentin numeron (sarake 0010), riskitekijän tunnisteen (sarake 0020), alaluokan (sarake 0030) ja lisätunnisteen (sarake 0040) yhdistelmä vain kerran.

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Instrumentin numero	Liite V, 2 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu instrumentin numero.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0020	Riskitekijän tunniste	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l, 325 m, 325 n, 325 o, 325 p ja 325 q artikla	Ilmoitetaan riskitekijän tunniste tämän liitteen lopussa olevan taulukon mukaisesti.
0030	Alaluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 3 kohta	Ilmoitetaan alaluokka. Jos sarakkeessa 0020 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa — yleinen korkoriski, vastaus on valuutan nimi asiaankuuluvassa riskittömässä korossa tai inflaatio- tai valuuttojen välisessä korkoperusteriskitekijässä (ISO 4217 -valuuttakoodien mukaisesti, esim. ”EUR”). — muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski, vastaus on alaluokan numero asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 ah artiklan 1 kohdan taulukossa 4. — arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun ulkopuolinen luottomarginaaliriski (non-ACTP CSR), vastaus on kyseisen asetuksen 325 am artiklan 1 kohdan taulukossa 7 oleva alaluokan numero. — arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun luottomarginaaliriski (ACTP CSR), vastaus on kyseisen asetuksen 325 ak artiklan taulukossa 6 oleva alaluokan numero. — osakeriski, vastaus on kyseisen asetuksen 325 ap artiklan 1 kohdan taulukossa 8 oleva alaluokan numero. — hyödykeriski, vastaus on kyseisen asetuksen 325 as artiklan taulukossa 9 oleva alaluokan numero. — valuuttariski ja delta- tai kaarevuuskomponentit, vastaus on valuutan nimi (esim. ”USD”, ilmoitettujen valuuttakoodien on oltava ISO 4217 -valuuttakoodien mukaisia). — valuuttariski ja vegakomponentti, vastaus on valuuttaparin nimi (esim. ”EUR_USD”, ilmoitettujen valuuttakoodien on oltava ISO 4217 -valuuttakoodien mukaisia).
0040	Lisätunniste1	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325l–325 q ja 325 ai artikla	Ilmoitetaan seuraavat tiedot, joissa riskitekijä eritellään alaluokkatasolla. Jos sarakkeessa 0020 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa — yleinen korkoriski ja deltakomponentti, vastaus on riskittömien korkojen käyrän nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste. — muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski tai riskiluokka arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun luottomarginaaliriski (ACTP CSR), vastaus on liikkeeseenlaskijan nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste, ja $\rho_{kl}^{(name)}$ on yhtä kuin 1 asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 ai artiklan 1 kohdan mukaisesti. — arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun ulkopuolinen luottomarginaaliriski (non-ACTP CSR), vastaus on etuoikeusluokan nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste. — osakeriski, vastaus on osakkeiden liikkeeseenlaskijan nimi tai vastaava yksilöllinen tunniste.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			— hyödykeriski, vastaus on hyödykkeen nimi tai muu vastaava yksilöllinen tunniste. Jos mikään näistä tapauksista ei ole sovellettavissa, laitosten on ilmoitettava tyhjä arvo (NULL) tämän ilmaisemiseksi.
0060	Riskiherkkyys (raportointivaluutan tulokset)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 2 kohta ja 325 g, 325 r, 325 s, 325 t ja 325 ax artikla	Riskiherkkyydet (delta-/vegaherkkyydet ja kaarevuusriskipositiot) ilmoitetaan kunkin instrumentin tasolla kaikkien asiaankuuluvien riskitekijöiden osalta sarakkeiden 0020–0040 mukaisesti. Arvot ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutassa. Jos sarakkeessa 0020 valittu riskitekijä vastaa — herkkyysperusteisen menetelmän deltariskikomponenttia, ilmoitetaan nettoherkkyys asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 r artiklassa määritetylle riskitekijälle (S_k). Jos laitokset ovat saaneet toimivaltaiselta viranomaiseltaan luvan käyttää vaihtoehtoisia deltariskiherkkyyksien laskelmia kyseisen asetuksen 325 t artiklan 5 kohdan mukaisesti, niiden on viitattava näihin vaihtoehtoisiin määritelmiin raportoinnissa. — herkkyysperusteisen menetelmän vegariskikomponenttia, ilmoitetaan asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 s artiklassa määritelty option vegariskiherkkyys tietylle riskitekijälle (S_k). Jos laitokset ovat saaneet toimivaltaiselta viranomaiseltaan luvan käyttää vaihtoehtoisia vegariskiherkkyyksien laskelmia kyseisen asetuksen 325 t artiklan 6 kohdan mukaisesti, niiden on viitattava näihin vaihtoehtoisiin laskelmiin raportoinnissa. Riippumatta siitä, käyttääkö laitos kyseisen asetuksen 325 s artiklan laskentaa tai 325 t artiklan 6 kohdan mukaista vaihtoehtoista laskentaa, herkkyys ilmoitetaan sen jälkeen, kun se on painotettu vastaavalla implisiittisellä volatiliteetilla. — herkkyysperusteisen menetelmän kaarevuusriskikomponenttia, asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 g artiklassa määritelty kyseisen riskitekijän nouseva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVR_k^+) tai kyseisen riskitekijän laskeva nettomääräinen kaarevuusriskipositio (CVR_k^-) ilmoitetaan erillisillä riveillä. Ilmoitettava luku on ilmaistava vähintään kahden desimaalin tarkkuudella. Nolla-arvot ilmoitetaan vain, jos laskennan tulos on todella nolla.
0070	Raportointivaluutta		Ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutan nimi (ilmoitetun arvon on oltava ISO 4217 -standardin mukainen valuuttakoodi, esim. ”EUR”).
0080	Riskiherkkyys (EPV:n salkun valuutan tulokset)	Tämän asetuksen liitteessä V olevat 3 ja 4 jakso ja asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 2 kohta ja 325 g, 325 r, 325 s, 325 t ja 325 ax artikla	Arvot ilmoitetaan sarakkeessa 0060 annettujen ohjeiden mukaisesti, mutta ne on muunnettava käyttämällä tämän asetuksen liitteessä V olevassa 3 ja 4 jaksossa määriteltyä salkun valuuttaan liittyvää EKP:n avistakurssia.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0090	Riskipaino	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 kolmannen osan IV osaston 1 a luvun 6 jakso	Ilmoitetaan riskipaino, joka vastaa sarakkeissa 0020–0040 määritettyä riskitekijää. Jos sarakkeessa 0020 valittu riskitekijä vastaa kaarevuusriskikomponenttia, ilmoitetaan sovellettavan suhteellisen siirtymän määrittämisessä käytetty riskipaino. Ilmoitettava luku on ilmaistava vähintään neljän desimaalin tarkkuudella.
0110	Lisätunniste2	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artiklan 2 kohta	Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa hyödykeriski ja herkkyysperusteisen menetelmän deltariskikomponenttia, tässä ilmoitetaan toimituspaikkaa koskevat oikeudelliset käsitteet tai muu vastaavaa yksilöllinen tunniste. Jos mikään näistä tapauksista ei ole sovellettavissa, laitosten on ilmoitettava tyhjä arvo (NULL) tämän ilmaisemiseksi.
0120	Luottoluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artiklan 1 kohta ja 325 ah artiklan 1 kohta	Jos sarakkeessa 0010 valittu riskitekijä vastaa riskiluokkaa muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski ja herkkyysperusteisen menetelmän deltariskikomponenttia, ilmoitetaan yksi seuraavista: a) ”LL 1”; b) ”LL 2”; c) ”LL 3”; d) ”LL 4”; e) ”LL 5”; f) ”LL 6”; g) ”Ei luottoluokkaa (luokittelematon)”. Jos mikään näistä tapauksista ei ole sovellettavissa, laitosten on ilmoitettava tyhjä arvo (NULL) tämän ilmaisemiseksi.

C 120.02 – Herkkyysperusteinen menetelmä (SBM). OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Riskiluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 1 kohta	Ilmoitetaan riskiluokka. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) ”yleinen korkoriski (GIRR)” b) ”luottomarginaaliriski, muun kuin arvopaperistamisen luottomarginaaliriski” (arvopaperistamiseen liittymätön luottomarginaaliriski (CSR)) c) ”luottomarginaaliriski, non-ACTP CSR” (arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun ulkopuolinen luottomarginaaliriski (non-ACTP CSR)) d) ”luottomarginaaliriski, ACTP CSR” (arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun luottomarginaaliriski (ACTP CSR)) e) ”osakeriski” f) ”hyödykeriski” g) ”valuuttakurssiriski”.
0020	Osatekijä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 e artiklan 1 kohta	Ilmoitetaan herkkyysperusteisen menetelmän osatekijä. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) ”deltariski” b) ”vegariski” c) ”kaarevuusriski”.
0030	Korrelaatioiden skenaario	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 h artikla	Ilmoitetaan korrelaatioiden skenaario. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) ”keskikokoisten korrelaatioiden skenaario” b) ”suurten korrelaatioiden skenaario” c) ”pienten korrelaatioiden skenaario”.
0040	Omien varojen vaatimukset (raportointivaluutan tulokset)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 h artikla	Omien varojen vaatimusten arvot ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle kaikkien riskiluokkien, osatekijöiden ja korrelaatioiden skenaarioiden asiaankuuluvien yhdistelmien osalta. Arvot ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutassa ja vähintään kahden desimaalin tarkkuudella.
0050	Raportointivaluutta		Ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutta (ilmoitetun arvon on oltava ISO 4217 -standardin mukainen valuuttakoodi).
0060	Omien varojen vaatimukset (EPV:n salkun valuutan tulokset)	Tämän asetuksen liitteessä V olevat 3 ja 4 jakso ja asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 h artikla	Arvot ilmoitetaan sarakkeessa 0040 annettujen ohjeiden mukaisesti, mutta ne on muunnettava käyttämällä tämän asetuksen liitteessä V olevassa 3 ja 4 jaksossa määriteltyä salkun valuuttaan liittyvää EKP:n avistakurssia.
0070	Positiot, joihin ei liity valinnaisuutta ja joihin sovelletaan kaarevuusriskiä koskevia omien varojen vaatimuksia	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 e artiklan 3 kohta	Jos sarakkeen 0020 komponentti vastaa kaarevuusriskiä: a) ilmoitetaan ”KYLLÄ”, jos laitos soveltaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 e artiklan 3 kohdan ensimmäisessä alakohdassa säädettyä menetelmää laskiessaan sarakkeissa 0040 ja 0060 ilmoitettavaa tulosta. b) muussa tapauksessa ilmoitetaan ”EI”. ”EI” ilmoitetaan myös silloin, jos mikään mainituista tapauksista ei päde.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0080	Perusvaluuttamenetelmä, jota sovelletaan valuuttakurssiriskin delta- ja kaarevuuskomponentteihin	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artiklan 7 kohta	Jos sarakkeen 0010 riskiluokka vastaa valuuttakurssiriskiä ja sarakkeen 0020 komponentti vastaa delta- tai kaarevuusriskiä: a) ilmoitetaan ”KYLLÄ”, jos laitos soveltaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artiklan 7 kohdassa säädettyä menetelmää laskiessaan sarakkeissa 0040 ja 0060 ilmoitettavaa tulosta. b) muussa tapauksessa ilmoitetaan ”EI”. ”EI” ilmoitetaan myös silloin, jos mikään mainituista tapauksista ei päde.
0090	Valuuttakurssiriskin kaarevuusriskikomponenttien jakautuminen skalaarin mukaan	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artiklan 6 kohta	Jos sarakkeen 0010 riskiluokka vastaa valuuttakurssiriskiä ja sarakkeen 0020 komponentti vastaa kaarevuusriskiä: a) ilmoitetaan ”KYLLÄ”, jos laitos soveltaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artiklan 6 kohdassa säädettyä menetelmää laskiessaan sarakkeissa 0040 ja 0060 ilmoitettavaa tulosta. b) muussa tapauksessa ilmoitetaan ”EI”. ”EI” ilmoitetaan myös silloin, jos mikään mainituista tapauksista ei päde.
0095	Tulosten toimittaminen SBM:n validointisalkkujen osalta	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 e artiklan 1 kohta	Jos salkku, josta tiedot ilmoitetaan, on liitteessä V olevassa 7 jaksossa tarkoitettu SBM:n validointisalkku: a) ”Toimitettu” ilmoitetaan, jos laitos toimittaa tätä salkkua vastaavat tulokset; b) ”Ei toimitettu – ei altistumista riskitekijälle” ilmoitetaan, jos laitos päättää olla toimittamatta asianomaisen SBM:n validointisalkun tuloksia, koska laitoksen johto ei ole antanut sisäistä hyväksyntää sellaisten instrumenttien käytölle, jotka aiheuttaisivat altistumista asiaankuuluvalle riskitekijälle. Ilmoitetaan ”ei sovelleta”, jos salkku, josta tietoja ilmoitetaan, on liitteessä V olevassa 3, 4 tai 5 jaksossa tarkoitettu salkku.
0100	Vapaa tekstikenttä		Laitos voi tässä sarakkeessa antaa mitä tahansa lisätietoja.

C 120.04 – MAKSUKYVYTTÖMYYSRISKIÄ KOSKEVA OMIEN VAROJEN VAATIMUS (DRC). MARKKINA-ARVOT JA ÄKILLISESTÄ MAKSUKYVYTTÖMYYDESTÄ (JTD) AIHEUTUVAT BRUTTOMÄÄRÄT INSTRUMENTEITTAIN/SALKKUITTAIN

Laitosten on ilmoitettava instrumenttikohtaisesti instrumenttia vastaavat vastuut. Kukin vastuu ilmoitetaan yhdellä rivillä. Kaikkien arvojen on viitattava tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b kohdan v alakohdassa täsmennettyyn riskimittojen viimeiseen viitepäivään (ja viimeiseen ASA-viitepäivään). Vastuut on ilmoitettava ennen kuittauksia mutta replikointi- tai eriyttämisvaiheiden (asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 z ja 325 ac artiklan määritelmien mukaisesti) jälkeen soveltuvin osin.

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Instrumentin numero	Liite V, 2 jakso	Ilmoitetaan liitteestä V saatu instrumentin numero.
0020	Riskiluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 2 kohta	Ilmoitetaan riskiluokka, jonka osalta maksukyvyttömyysriskiä koskeva omien varojen vaatimus (DRC) ilmoitetaan sarakkeissa 0030 ja 0040. Vastauksen on oltava jokin seuraavista instrumenttityypeistä: a) ”Muut instrumentit kuin arvopaperistamispositiot”; b) ”Arvopaperistamispositiot, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”; c) ”Arvopaperistamispositiot, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”.
0030	Alaluokka1	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 y artiklan 3 kohta, 325 aa artiklan 4 kohta ja 325 ad artiklan 2 kohta	Ilmoitetaan alaluokka. Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita kuin arvopaperistamisia”, vastaus on yksi seuraavista: a) ”Yritykset”; b) ”Valtiot”; c) ”Paikallishallinnot/kunnat”. Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamisia, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on edellä mainittu a) tai yksi seuraavista: d) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – Aasia”; e) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – Eurooppa”; f) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – Pohjois-Amerikka”; g) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – muu maailma”; h) ”Autolainat/-leasingsopimukset – Aasia”; i) ”Autolainat/-leasingsopimukset – Eurooppa”; j) ”Autolainat/-leasingsopimukset – Pohjois-Amerikka”; k) ”Autolainat/-leasingsopimukset – muu maailma”; l) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – Aasia”; m) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – Eurooppa”; n) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – Pohjois-Amerikka”; o) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – muu maailma”; p) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – Aasia”; q) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – Eurooppa”; r) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – Pohjois-Amerikka”; s) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – muu maailma”; t) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – Aasia”; u) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – Eurooppa”; v) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – Pohjois-Amerikka”; w) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – muu maailma”; x) ”Luottokortit – Aasia”; y) ”Luottokortit – Eurooppa”; z) ”Luottokortit – Pohjois-Amerikka”; aa) ”Luottokortit – muu maailma”; bb) ”Muut vähittäislainat – Aasia”; cc) ”Muut vähittäislainat – Eurooppa”; dd) ”Muut vähittäislainat – Pohjois-Amerikka”;

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			ee) ”Muut vähittäislainat – muu maailma”; ff) ”Muut tukkulainat – Aasia”; gg) ”Muut tukkulainat – Eurooppa”; hh) ”Muut tukkulainat – Pohjois-Amerikka”; ii) ”Muut tukkulainat – muu maailma”; jj) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – Aasia”; kk) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – Eurooppa”; ll) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – Pohjois-Amerikka”; mm) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – muu maailma”; nn) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – Aasia”; oo) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – Eurooppa”; pp) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – Pohjois-Amerikka”; qq) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – muu maailma”; rr) ”Opintolainat – Aasia”; ss) ”Opintolainat – Eurooppa”; tt) ”Opintolainat – Pohjois-Amerikka”; uu) ”Opintolainat – muu maailma”. Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamisia, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on ”Arvopaperistamiset, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”.
0040	Alaluokka2	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 ad artiklan 2 kohta	Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamisia, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on indeksin nimi, muissa tapauksissa ilmoitetaan (NULL).
0050	Velallinen	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 2 kohta, 325 x artiklan 1 kohta ja 325 z ja 325 ac artikla	Laitosten on ilmoitettava vastapuolta koskevat tiedot. Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa — ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita”, vastaus on vastapuolen nimi; — ”arvopaperistamispositioita, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on vastapuolen nimi tai yksilöllinen tunniste, joka ilmaisee kohde-etuutena olevan varojen poolin ja etuoikeusluokan; — ”arvopaperistamispositioita, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on yksilöllinen tunniste, joka ilmaisee indeksiperheen, -sarjan ja -etuoikeusluokan.
0060	Luottoluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 y artiklan 1 ja 2 kohta, 325 aa artiklan 1 kohta ja 325 ad artiklan 1 kohta	Laitosten on ilmoitettava luottoluokka. Vastauksen on oltava jokin seuraavista: a) ”LL 1”; b) ”LL 2”; c) ”LL 3”; d) ”LL 4”; e) ”LL 5”; f) ”LL 6”; g) ”Ei luottoluokkaa (luokittelematon)”;

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			h) ”Ei luottoluokkaa (maksukyvyttömyystilassa)”; i) ”Ei luottoluokkaa (0 % riskipaino)”. Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamisia, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, tai ”arvopaperistamisia, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on jokin edellä mainituista tai yksi seuraavista: j) ”LL 7”; k) ”LL 8”; l) ”LL 9”; m) ”LL 10”; n) ”LL 11”; o) ”LL 12”; p) ”LL 13”; q) ”LL 14”; r) ”LL 15”; s) ”LL 16”; t) ”LL 17”; u) ”Kaikki muut luottoluokat”;
0070	Maksukyvyttömyyden riskipaino	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 1 kohdan f alakohta, 325 y artiklan 1 ja 2 kohta, 325 aa artiklan 1 kohta ja 325 ad artiklan 1 kohta	Laitosten on ilmoitettava sovellettava riskipaino. Arvopaperistettuihin vastuisiin sovellettavat riskipainot ilmoitetaan sen jälkeen, kun ne on kerrottu 8 prosentilla asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 aa artiklan 1 kohdan mukaisesti.
0080	Etuoikeusasema	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 3 ja 6 kohta	Tässä ilmoitetaan vastuun etuoikeusasema. Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita”, tai ”arvopaperistamispositioita, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on yksi seuraavista: a) ”Oman pääoman ehtoiset rahoitusvälineet”; b) ”Muut kuin etuoikeutetut velkainstrumentit”; c) ”Etuoikeutetut velkainstrumentit”; d) ”Katetut joukkolainat”. Solu jätetään tyhjäksi, jos mikään mainituista tapauksista ei päde.
0090	Maturiteetti	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 x, 325 z ja 325 ac artikla	Tässä ilmoitetaan vastuun maturiteetti. Päivämäärä ilmoitetaan muodossa ”pp/kk/vvvv”.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0100	Palautusaste	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 1 kohdan e alakohta	Laitosten on ilmoitettava palautusaste. Palautusaste lasketaan käyttämällä sovellettavaa tappio-osuutta (LGD), kun palautusaste = 1 – LGD. Palautusaste ilmoitetaan lukuna, joka ilmaistaan desimaaliarvona väliltä 0–1 vähintään neljän desimaalin tarkkuudella.
0110	Suunta	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 1 kohdan a ja b alakohta	Laitosten on ilmoitettava vastuun suunta asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 1 kohdan a ja b alakohdan määritelmien mukaisesti. Vastauksen on oltava yksi seuraavista: a) ”Lyhyt vastuu”; b) ”Pitkä vastuu”.
0120	Kiinnityspiste (%)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 aa ja 325 ad artikla	Jos ilmoitettava vastuu liittyy etuoikeusluokkaan, laitosten on ilmoitettava etuoikeusluokan kiinnityspiste. Ilmoitettava luku on ilmaistava vähintään neljän desimaalin tarkkuudella.
0130	Irtautumispiste (%)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 aa ja 325 ad artikla	Jos ilmoitettava vastuu liittyy etuoikeusluokkaan, laitosten on ilmoitettava etuoikeusluokan irtautumispiste. Ilmoitettava luku on ilmaistava vähintään neljän desimaalin tarkkuudella.
0140–0170	Raportointivaluutan tulokset		Arvot ilmoitetaan viittaamalla laitoksen raportointivaluuttaan ja vähintään kahden desimaalin tarkkuudella soveltuvin osin.
0140	Nimellisarvo	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1, 2 ja 5 kohta	Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita”, laitosten on ilmoitettava instrumentin nimellismäärä. Arvo vastaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1 ja 2 kohdassa olevaa muuttujaa $V_{notional}$ tai kyseisen asetuksen 325 w artiklan 5 kohdassa olevaa muuttujaa V vastuutyypistä riippuen. Solu jätetään tyhjäksi, jos mikään mainituista tapauksista ei päde tai jos laitos ei nimenomaisesti laske tai käytä tässä sarakkeessa ilmoitettavaa määrää äkillisestä maksukyvyttömyydestä aiheutuvan bruttomäärän (gross jump to default, JTD) arvioimiseksi.
0150	Voitot ja tappiot + mukautus	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1, 2 ja 5 kohta	Laitosten on ilmoitettava voittojen ja tappioiden (P&L) ja mukautusten (Adjustment) summa kunkin vastuun osalta: — Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita” ja ilmoitettu vastuu on pitkä vastuu, laitosten on ilmoitettava $P\&L_{long}$- ja $Adjustment_{long}$-muuttujien summa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1 kohdan mukaisesti. — Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita” ja ilmoitettu vastuu on lyhyt vastuu, laitosten on ilmoitettava $P\&L_{short}$- ja $Adjustment_{short}$-muuttujien summa kyseisen asetuksen 325 w artiklan 2 kohdan mukaisesti.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Solu jätetään tyhjäksi, jos mikään mainituista tapauksista ei päde tai jos laitos ei nimenomaisesti laske tai käytä tässä sarakkeessa ilmoitettavaa määrää JTD:stä aiheutuvan bruttomäärän arvioimiseksi.
0160	JTD:stä aiheutuva bruttomäärä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 1 kohdan c alakohta, 325 w artiklan 1, 2 ja 5 kohta, 325 z artiklan 1 kohta ja 325 ac artiklan 2 kohta	Laitosten on ilmoitettava kyseisen vastuun JTD:stä aiheutuva bruttomäärä.
0170	Valuutta		Ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutta (ilmoitetun arvon on oltava ISO 4217 -standardin mukainen valuuttakoodi).
0180–0200	EPV:n salkun valuutan tulokset	Tämän asetuksen liitteessä V olevat 3 ja 4 jakso ja asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 y, 325 aa ja 325 ad artikla	Arvot ilmoitetaan sarakkeessa 0030 annettujen ohjeiden mukaisesti, mutta ne on muunnettava käyttämällä tämän asetuksen liitteessä V olevassa 3 ja 4 jaksossa määriteltyä salkun valuuttaan liittyvää EKP:n avistakurssia.
0180	Nimellisarvo	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1, 2 ja 5 kohta	Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita”, laitosten on ilmoitettava instrumentin nimellismäärä. Arvo vastaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1 ja 2 kohdassa olevaa muuttujaa $V_{notional}$ tai kyseisen asetuksen 325 w artiklan 5 kohdassa olevaa muuttujaa V vastuutyypistä riippuen. Solu jätetään tyhjäksi, jos mikään mainituista tapauksista ei päde tai jos laitos ei nimenomaisesti laske tai käytä tässä sarakkeessa ilmoitettavaa määrää JTD:stä aiheutuvan bruttomäärän arvioimiseksi.
0190	Voitot ja tappiot + mukautus	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1, 2 ja 5 kohta	Laitosten on ilmoitettava voittojen ja tappioiden (P&L) ja mukautusten (Adjustment) summa kunkin vastuun osalta: — Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita” ja ilmoitettu vastuu on pitkä vastuu, laitosten on ilmoitettava $P\&L_{long}$- ja $Adjustment_{long}$-muuttujien summa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 w artiklan 1 kohdan mukaisesti. — Jos sarakkeessa 0020 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita” ja ilmoitettu vastuu on lyhyt vastuu, laitosten on ilmoitettava $P\&L_{short}$- ja $Adjustment_{short}$-muuttujien summa kyseisen asetuksen 325 w artiklan 2 kohdan mukaisesti.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Solu jätetään tyhjäksi, jos mikään mainituista tapauksista ei päde tai jos laitos ei nimenomaisesti laske tai käytä tässä sarakkeessa ilmoitettavaa määrää JTD:stä aiheutuvan bruttomäärän arvioimiseksi.
0200	JTD:stä aiheutuva bruttomäärä	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 1 kohdan c alakohta, 325 w artiklan 1, 2 ja 5 kohta, 325 z artiklan 1 kohta ja 325 ac artiklan 2 kohta	Laitosten on ilmoitettava kyseisen vastuun äkillisestä maksukyvyttömyydestä aiheutuva bruttomäärä (gross jump to default, JTD).

C 120.05 – MAKSUKYVYTTÖMYYSRISKIÄ KOSKEVA OMIEN VAROJEN VAATIMUS (DRC). OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN

Taulukoita koskevat ohjeet (z-akseli)

Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
Salkku	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Riskiluokka	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artiklan 2 kohta	Ilmoitetaan riskiluokka, jonka osalta maksukyvyttömyysriskiä koskeva omien varojen vaatimus ilmoitetaan sarakkeissa 0030 ja 0040. Vastauksen on oltava jokin seuraavista instrumenttityypeistä: a) ”Muut instrumentit kuin arvopaperistamispositiot”; b) ”Arvopaperistamispositiot, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”; c) ”Arvopaperistamispositiot, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”.
0020	Alaluokka1	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 y artiklan 3 kohta, 325 aa artiklan 4 kohta ja 325 ad artiklan 2 kohta	Ilmoitetaan alaluokka. Jos sarakkeessa 0010 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”muita instrumentteja kuin arvopaperistamispositioita”, vastaus on yksi seuraavista: a) ”Yritykset”; b) ”Valtiot”; c) ”Paikallishallinnot/kunnat”.

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			Jos sarakkeessa 0010 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamispositioita, jotka eivät kuulu vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on yksi seuraavista: d) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – Aasia”; e) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – Eurooppa”; f) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – Pohjois-Amerikka”; g) ”Omaisuusvakuudelliset yritystodistukset (ABCP) – muu maailma”; h) ”Autolainat/-leasingsopimukset – Aasia”; i) ”Autolainat/-leasingsopimukset – Eurooppa”; j) ”Autolainat/-leasingsopimukset – Pohjois-Amerikka”; k) ”Autolainat/-leasingsopimukset – muu maailma”; l) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – Aasia”; m) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – Eurooppa”; n) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – Pohjois-Amerikka”; o) ”Vakuudelliset velkasitoumukset (CDO-squared) – muu maailma”; p) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – Aasia”; q) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – Eurooppa”; r) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – Pohjois-Amerikka”; s) ”Lainavakuudelliset velkasitoumukset – muu maailma”; t) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – Aasia”; u) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – Eurooppa”; v) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – Pohjois-Amerikka”; w) ”Liikekiinteistölainavakuudelliset arvopaperit (CMBS) – muu maailma”; x) ”Luottokortit – Aasia”; y) ”Luottokortit – Eurooppa”; z) ”Luottokortit – Pohjois-Amerikka”; aa) ”Luottokortit – muu maailma”; bb) ”Muut vähittäislainat – Aasia”; cc) ”Muut vähittäislainat – Eurooppa”; dd) ”Muut vähittäislainat – Pohjois-Amerikka”; ee) ”Muut vähittäislainat – muu maailma”; ff) ”Muut tukkulainat – Aasia”; gg) ”Muut tukkulainat – Eurooppa”; hh) ”Muut tukkulainat – Pohjois-Amerikka”; ii) ”Muut tukkulainat – muu maailma”; jj) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – Aasia”; kk) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – Eurooppa”; ll) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – Pohjois-Amerikka”; mm) ”Asuntolainavakuudelliset arvopaperit (RMBS) – muu maailma”; nn) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – Aasia”; oo) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – Eurooppa”; pp) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – Pohjois-Amerikka”; qq) ”Pienet ja keskisuuret yritykset (pk-yritykset) – muu maailma”; rr) ”Opintolainat – Aasia”;

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
			ss) ”Opintolainat – Eurooppa”; tt) ”Opintolainat – Pohjois-Amerikka”; uu) ”Opintolainat – muu maailma”. Jos sarakkeessa 0010 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamispositioita, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on ”Arvopaperistamiset, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”.
0030	Alaluokka2	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 ad artiklan 2 kohta	Jos sarakkeessa 0010 ilmoitettu riskiluokka vastaa ”arvopaperistamispositioita, jotka kuuluvat vaihtoehtoiseen korrelaatiokaupankäyntisalkkuun”, vastaus on indeksin nimi, muissa tapauksissa vastaukseksi jätetään (NULL).
0040	Omien varojen vaatimukset (raportointivaluutan tulokset)	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 y, 325 aa ja 325 ad artikla	Maksukyvyttömyysriskiä koskevat omien varojen vaatimukset ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta. Arvot ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutassa ja vähintään kahden desimaalin tarkkuudella.
0050	Raportointivaluutta		Ilmoitetaan laitoksen raportointivaluutta (ilmoitetun arvon on oltava ISO 4217 -standardin mukainen valuuttakoodi).
0060	Omien varojen vaatimukset (EPV:n salkun valuutan tulokset)	Tämän asetuksen liitteessä V olevat 3 ja 4 jakso ja asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 y, 325 aa ja 325 ad artikla	Arvot ilmoitetaan sarakkeessa 0030 annettujen ohjeiden mukaisesti, mutta ne on muunnettava käyttämällä tämän asetuksen liitteessä V olevassa 3 ja 4 jaksossa määriteltyä salkun valuuttaan liittyvää EKP:n avistakurssia.

C 120.06 – VAIHTOEHTOINEN STANDARDIMENETELMÄ (ASA). Omien varojen vaatimus (OFR)

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0010	Salkun numero	Liite V, 3, 4 ja 5 jakso	Liitteestä V otettu salkun numero ilmoitetaan.
0020–0040	Raportointivaluutan tulokset	Liitteen V 3 ja 4 jakso	

Sarake	Nimi	Lainsäädäntöviite	Ohjeet
0020	SBM OFR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 h artikla	Vaihtoehtoisen standardimenetelmän herkkyysperusteisen menetelmän omien varojen vaatimukset ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle.
0030	DRC OFR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artikla	Vaihtoehtoisen standardimenetelmän maksukyvyttömyysriskiä koskeva omien varojen vaatimus ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle.
0040	RRAO OFR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 u artikla	Vaihtoehtoisen standardimenetelmän jäännösriskiä koskevan korotuksen omien varojen vaatimukset ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle.
0050–0070	EPV:n salkun valuutan tulokset	Liitteen V 3 ja 4 jakso	Jos laitoksen raportointivaluutta on muu kuin liitteessä V olevissa 3 ja 4 jaksossa täsmennetyt EPV:n salkun valuutat, laitosten on muunnettava raportointivaluutta käyttämällä sovellettavaa EKP:n avistakurssia.
0050	SBM OFR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 h artikla	Vaihtoehtoisen standardimenetelmän herkkyysperusteisen menetelmän omien varojen vaatimukset ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle.
0060	DRC OFR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 v artikla	Vaihtoehtoisen standardimenetelmän maksukyvyttömyysriskiä koskeva omien varojen vaatimus ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle.
0070	RRAO OFR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 u artikla	Vaihtoehtoisen standardimenetelmän jäännösriskiä koskevan korotuksen omien varojen vaatimukset ilmoitetaan riskimittojen viimeisen viitepäivän (ja viimeisen ASA-viitepäivän) (täsmennetty tämän asetuksen liitteessä V olevan 1 jakson b alakohdassa) osalta kullekin salkulle.

Taulukko: ohjeet lomakkeiden 106.01 (sarake 0010) ja 120.01 (sarake 0020) raportointia varten

— Sarake ”riskiluokka” viittaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 d artiklan 1 kohtaan. Riskiluokista käytetään seuraavia lyhenteitä:

a) ”GIRR” (yleinen korkoriski)

b) ”CSR_NON_SEC” (arvopaperistamiseen liittymätön luottomarginaaliriski (CSR))

c) ”CSR_SEC_NON_ACTP” (arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun ulkopuolinen luottomarginaaliriski (non-ACTP CSR))

d) ”CSR_SEC_ACTP” (arvopaperistamiseen liittyvä vaihtoehtoisen korrelaatiokaupankäyntisalkun luottomarginaaliriski (ACTP CSR))

e) ”EQ” (osakeriski)

f) ”CM” (hyödykeriski)

g) ”FX” (valuuttakurssiriski).

— Sarake ”osatekijä” viittaa asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 e artiklan 1 kohtaan. Herkkyysperusteisen menetelmän osatekijöistä käytetään seuraavia lyhenteitä:

a) ”DELTA” (deltariski)

b) ”VEGA” (vegariski)

c) ”CURVATURE” (kaarevuusriski).

— Sarake ”maturiteetti” viittaa riskitekijän maturiteettiin, jossa riskitekijät määritellään käyttämällä tiettyjä pisteitä asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l, 325 m, 325 n, 325 o, 325 p ja 325 q artiklan mukaisesti. Kyseisen asetuksen 325 l artiklan 7 kohdassa määriteltyjen yleisten vega-korkoriskitekijöiden osalta ilmoitetaan kaksi maturiteettia ja ne erotetaan toisistaan väliviivalla (esim. ”0,5 vuotta – 0,5 vuotta”). Ensimmäinen viittaa option maturiteettiin ja toinen option kohde-etuuden jäljellä olevaan maturiteettiin option erääntymispäivänä.

— Sarakkeessa ”lisäeritelmät” täsmennetään riskitekijä asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artiklan mukaisten inflaatioriski- ja valuuttojen välisen korkoperusteriskitekijöiden välisen eron osalta, velkainstrumentteihin liittyvien riskitekijöiden ja kyseisen asetuksen 325 m ja 325 n artiklan mukaisten luottoriskinvaihtosopimuksiin liittyvien riskitekijöiden välisen eron osalta, kyseisen asetuksen 325 o artiklan mukaisten osakkeiden spot-hintojen ja osakkeiden repokorkojen riskitekijöiden välisen eron osalta sekä kyseisen riskitekijän nousevan nettomääräisen kaarevuusriskiposition (CVR_k^+) tai kyseisen riskitekijän laskevan nettomääräisen kaarevuusriskiposition (CVR_k^-) välisen eron osalta kyseisen asetuksen 325 g artiklan mukaisesti.

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
CM	DELTA	0 vuotta		CM_D_00.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	0,25 vuotta		CM_D_00.25	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	0,5 vuotta		CM_D_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	1 vuosi		CM_D_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	2 vuotta		CM_D_02.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	3 vuotta		CM_D_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	5 vuotta		CM_D_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	10 vuotta		CM_D_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	15 vuotta		CM_D_15.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	20 vuotta		CM_D_20.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	DELTA	30 vuotta		CM_D_30.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	VEGA	0,5 vuotta		CM_V_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	VEGA	1 vuosi		CM_V_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	VEGA	3 vuotta		CM_V_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	VEGA	5 vuotta		CM_V_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	VEGA	10 vuotta		CM_V_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p artikla
CM	CURVATURE		Nousu	CM_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p ja 325 g artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
CM	CURVATURE		Lasku	CM_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 p ja 325 g artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	1 vuosi	Velkainstrumentti	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	3 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	5 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	10 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	1 vuosi	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	3 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	5 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	DELTA	10 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 vuotta		CSR_NON_SEC_V_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	VEGA	1 vuosi		CSR_NON_SEC_V_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	VEGA	3 vuotta		CSR_NON_SEC_V_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	VEGA	5 vuotta		CSR_NON_SEC_V_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	VEGA	10 vuotta		CSR_NON_SEC_V_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m artikla
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Nousu	CSR_NON_SEC_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m ja 325 g artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
CSR_NON_SEC	CURVATURE		Lasku	CSR_NON_SEC_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 m ja 325 g artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 vuosi	Velkainstrumentti	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 vuosi	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 vuotta		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 vuosi		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 vuotta		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 vuotta		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 vuotta		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Nousu	CSR_SEC_ACTP_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n ja 325 g artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
CSR_SEC_ACTP	CURVATURE		Lasku	CSR_SEC_ACTP_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n ja 325 g artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 vuosi	Velkainstrumentti	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 vuotta	Velkainstrumentti	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 vuosi	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 vuotta	Luottoriskinvaihtosopimus	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 vuotta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 vuosi		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 vuotta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 vuotta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 vuotta		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n artikla
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Nousu	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n ja 325 g artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVATURE		Lasku	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 n ja 325 g artikla
EQ	DELTA		Spot-hinta	EQ_D_SPOT	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	DELTA		Repokorko	EQ_D_REPO	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	VEGA	0,5 vuotta		EQ_V_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	VEGA	1 vuosi		EQ_V_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	VEGA	3 vuotta		EQ_V_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	VEGA	5 vuotta		EQ_V_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	VEGA	10 vuotta		EQ_V_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o artikla
EQ	CURVATURE		Nousu	EQ_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o ja 325 g artikla
EQ	CURVATURE		Lasku	EQ_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 o ja 325 g artikla
FX	DELTA			FX_D	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artikla
FX	VEGA	0,5 vuotta		FX_V_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artikla
FX	VEGA	1 vuosi		FX_V_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artikla
FX	VEGA	3 vuotta		FX_V_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artikla
FX	VEGA	5 vuotta		FX_V_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artikla
FX	VEGA	10 vuotta		FX_V_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q artikla
FX	CURVATURE		Nousu	FX_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q ja 325 g artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
FX	CURVATURE		Lasku	FX_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 q ja 325 g artikla
GIRR	DELTA	0,25 vuotta		GIRR_D_00.25	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	0,5 vuotta		GIRR_D_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	1 vuosi		GIRR_D_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	2 vuotta		GIRR_D_02.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	3 vuotta		GIRR_D_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	5 vuotta		GIRR_D_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	10 vuotta		GIRR_D_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	15 vuotta		GIRR_D_15.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	20 vuotta		GIRR_D_20.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA	30 vuotta		GIRR_D_30.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA		Inflaatio	GIRR_D_INF	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA		Valuuttojen välinen korkoperuste (EUR)	GIRR_D_CRO_EUR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	DELTA		Valuuttojen välinen korkoperuste (USD)	GIRR_D_CRO_USD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta – 0,5 vuotta		GIRR_V_00.50_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi – 0,5 vuotta		GIRR_V_01.00_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta – 0,5 vuotta		GIRR_V_03.00_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
GIRR	VEGA	5 vuotta – 0,5 vuotta		GIRR_V_05.00_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta – 0,5 vuotta		GIRR_V_10.00_00.50	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta – 1 vuosi		GIRR_V_00.50_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi – 1 vuosi		GIRR_V_01.00_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta – 1 vuosi		GIRR_V_03.00_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta – 1 vuosi		GIRR_V_05.00_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta – 1 vuosi		GIRR_V_10.00_01.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta – 3 vuotta		GIRR_V_00.50_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi – 3 vuotta		GIRR_V_01.00_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta – 3 vuotta		GIRR_V_03.00_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta – 3 vuotta		GIRR_V_05.00_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta – 3 vuotta		GIRR_V_10.00_03.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta – 5 vuotta		GIRR_V_00.50_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi – 5 vuotta		GIRR_V_01.00_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta – 5 vuotta		GIRR_V_03.00_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta – 5 vuotta		GIRR_V_05.00_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta – 5 vuotta		GIRR_V_10.00_05.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
GIRR	VEGA	0,5 vuotta – 10 vuotta		GIRR_V_00.50_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi – 10 vuotta		GIRR_V_01.00_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta – 10 vuotta		GIRR_V_03.00_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta – 10 vuotta		GIRR_V_05.00_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta – 10 vuotta		GIRR_V_10.00_10.00	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta	Inflaatio	GIRR_V_00.50_INF	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi	Inflaatio	GIRR_V_01.00_INF	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta	Inflaatio	GIRR_V_03.00_INF	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta	Inflaatio	GIRR_V_05.00_INF	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta	Inflaatio	GIRR_V_10.00_INF	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi	Valuuttojen välinen korkoperuste (EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	3 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	0,5 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	1 vuosi	Valuuttojen välinen korkoperuste (USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla

Riskiluokka	Osatekijä	Maturiteetti	Lisäeritelmä	Riskitekijän tunniste	Lainsäädäntöviite
GIRR	VEGA	3 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	5 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	VEGA	10 vuotta	Valuuttojen välinen korkoperuste (USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l artikla
GIRR	CURVATURE		Nousu	GIRR_CU	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l ja 325 g artikla
GIRR	CURVATURE		Lasku	GIRR_CD	Asetuksen (EU) N:o 575/2013 325 l ja 325 g artikla”

LIITE IV

”LIITE VII

Vertailusalkut valvontatarkoituksiin – Tulokset. MARKKINARISKI

VERTAILUSALKKUJEN TULOKSET. MARKKINARISKI			
Lomakkeen numero	**Lomakkeen koodi**	**Lomakkeen/lomakeryhmän nimi**	**Lyhytnimi**
		IMV-ARVO (INITIAL MARKET VALUATION)	
106,1	C 106.00	IMV-ARVO (INITIAL MARKET VALUATION) JA POISSULKEMISPERUSTEET	IMV-ARVO
106,2	C 106.01	RISKIHERKKYYDET INSTRUMENTEITTAIN	HERKKYYDET
		VaR, sVaR ja nykyarvo	
107,1	C 107.01	YKSITYISKOHTAINEN KUVAUS	VaR ja sVaR 1
107,2	C 107.02	**EPV:N SALKUN** VALUUTAN TULOKSET	VaR ja sVaR 2
		VOITTOJEN JA TAPPIOIDEN AIKASARJAT	
108	C 108.00	VOITTOJEN JA TAPPIOIDEN AIKASARJAT	VOITOT JA TAPPIOT
		IRC (INCREMENTAL RISK CHARGE)	
109,1	C 109.01	IRC. MALLIN TIEDOT	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC. SALKKUKOHTAISET TIEDOT	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC. SALKKU-/PÄIVÄMÄÄRÄKOHTAINEN MÄÄRÄ	IRC 3
		KORRELAATIOKAUPANKÄYNTI (CT)	
110,1	C 110.01	CT. MALLIN TIEDOT	CT 1
110,2	C 110.02	CT. SALKKUKOHTAISET TIEDOT	CT 2
110,3	C 110.03	CT. SALKKU-/PÄIVÄMÄÄRÄKOHTAINEN MÄÄRÄ	CT 3
		ASA (SBM ja DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. RISKIHERKKYYDET INSTRUMENTEITTAIN/SALKUITTAIN	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. MARKKINA-ARVOT JA JTD:STÄ AIHEUTUVAT BRUTTOMÄÄRÄT INSTRUMENTEITTAIN/SALKKUITTAIN	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN	ASA OFR

C 106.00 – IMV-ARVO (INITIAL MARKET VALUATION) JA POISSULKEMISPERUSTEET

Instrumentin numero	VaR- ja sVaR-arvoille mallinnettu instrumentti (Kyllä/Ei)	IRC-arvoa varten mallinnettu instrumentti (Kyllä/Ei)	Korrelaatiokaupankäyntiä varten mallinnettu instrumentti (Kyllä/Ei)	Poissulkemisen perusteet	Vapaa tekstikenttä	IMV-arvo (Initial Market Valuation)
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 – RISKIHERKKYYDET INSTRUMENTEITTAIN

Instrumentin numero

Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Riskiherkkyys (raportointivaluutan tulokset)	Raportointivaluutta	Riskiherkkyys (EPV:n instrumentin valuutan tulokset)	Hinnoittelumalli	Herkkyyksien määritelmä	Vapaa tekstikenttä	Lisätunniste2	Luottoluokka
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 – VaR, sVaR ja nykyarvo. YKSITYISKOHTAINEN KUVAUS

		Vaihtoehto	Vapaa tekstikenttä
		0010	0020
VaR-luku			
0010	**Menetelmä**		
0020	**Laskenta 10 päivän aikavälillä**		

		Vaihtoehto	Vapaa tekstikenttä
		0010	0020
0030	**Havaintojakson pituus**		
0040	**Tietojen painottaminen**		
0050	**Toteutumatestauslisäys**		
0060	**Sääntelyn mukainen VaR-lisäys**		
sVaR-luku			
0070	**Menetelmä**		
0080	**Laskenta 10 päivän aikavälillä**		
0090	**Sääntelyn mukainen SVaR-lisäys**		
0100	**SVaR-luvun ajanjakso**		

C 107.02 – VaR ja sVaR – korrelaatioon perustumattomat kaupankäyntisalkut. EPV:N SALKUN VALUUTAN TULOKSET

Salkku

Päivämäärä	VaR-luku	sVaR-luku	Nykyarvo
0010	0020	0030	0040

C 108.00 – VOITTOJEN JA TAPPIOIDEN AIKASARJAT

Salkku

Päivämäärä	**Päivittäiset voitot ja tappiot**
0010	0020

C 109.01 – IRC (incremental risk charge). MALLIN TIEDOT

		Vaihtoehto	**Vapaa tekstikenttä**
Rivi	**Kohta**	0010	0020
0010	**Mallinnustekijöiden määrä**		
0020	**LGD-lukujen lähde**		

C 109.02 – IRC (incremental risk charge). SALKKUKOHTAISET TIEDOT

Salkku

		Vaihtoehto	Vapaa tekstikenttä
Rivi	**Kohta**	0010	0020
0010	**Likviditeettihorisontti**		
0020	**PD-lukujen lähde**		
0030	**Siirtymämatriisien lähde**		

C 109.03 – IRC (incremental risk charge). SALKKU-/PÄIVÄMÄÄRÄKOHTAINEN MÄÄRÄ

Salkku

Päivämäärä	IRC (incremental risk charge)
0010	0020

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 110.01 – KORRELAATIOKAUPANKÄYNTI (CT). MALLIN TIEDOT

		Vaihtoehto	Vapaa tekstikenttä
Rivi	**Kohta**	0010	0020
0010	**Mallinnustekijöiden määrä**		
0020	**LGD-lukujen lähde**		

C 110.02 – KORRELAATIOKAUPANKÄYNTI (CT). SALKKUKOHTAISET TIEDOT

Salkku

		Vaihtoehto	Vapaa tekstikenttä
Rivi	**Kohta**	0010	0020
0010	**Likviditeettihorisontti**		
0020	**PD-lukujen lähde**		
0030	**Siirtymämatriisien lähde**		

C 110.03 – KORRELAATIOKAUPANKÄYNTI (CT). SALKKU-/PÄIVÄMÄÄRÄKOHTAINEN KAIKKIEN HINTOJEN RISKI (APR)

Salkku

Päivämäärä	**Kaikkien hintojen riski (APR)**
0010	0060

C 120.01 – HERKKYYSPERUSTEINEN MENETELMÄ (SBM). RISKIHERKKYYDET INSTRUMENTEITTAIN/SALKUITTAIN

Salkku

Instrumentin numero	**Riskitekijän tunniste**	**Alaluokka**	**Lisätunniste**	**Riskiherkkyys (raportointiva-luutan tulokset)**	**Raportointiva-luutta**	**Riskiherkkyys (EPV:n salkun valuutan tulokset)**	**Riskipaino**	**Lisätunniste2**	**Luottoluokka**
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

C 120.02 – HERKKYYSPERUSTEINEN MENETELMÄ (SBM). OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN

Salkku

Riski-luokka	Riskitekijä	Korrelaatioiden skenaario	Omien varojen vaatimukset (raportointivaluutan tulokset)	Raportointiva-luutta	Omien varojen vaatimukset (EPV:n salkun valuutan tulokset)	Positiot, joihin ei liity valinnaisuutta ja joihin sovelletaan kaarevuusriskiä koskevia omien varojen vaatimuksia	Perusvaluuttamenetelmä, jota sovelletaan valuuttakurssiriskin delta- ja kaarevuuskomponentteihin	Valuuttakurssiriskin kaarevuusriskikomponenttien jakautuminen skalaarin mukaan	Tulosten toimittaminen SBM:n validointisalkkujen osalta	Vapaa tekstikenttä
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 – MAKSUKYVYTTÖMYYSRISKIÄ KOSKEVA OMIEN VAROJEN VAATIMUS (DRC). Markkina-arvot ja JTD:stä aiheutuvat bruttomäärät instrumenteittain/salkuittain

Salkku

Kokonaisluku

Instrumentin numero	Riski-luokka	Ala-luokka1	Ala-luokka2	Velallinen	Luotto-luokka	Maksukyvyttömyyden riskipaino	Etuoikeus-asema	Maturiteetti	Palautus-aste	Suunta	Kiinnityspiste (%)	Irtautumispiste (%)	Raportointivaluutan tulokset				EPV:n salkun valuutan tulokset		
													Nimellisarvo	Voitot ja tappiot + mukautus	JTD:stä aiheutuva bruttomäärä	Valuutta	Nimellisarvo	Voitot ja tappiot + mukautus	JTD:stä aiheutuva bruttomäärä
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 – MAKSUKYVYTTÖMYYSRISKIÄ KOSKEVA OMIEN VAROJEN VAATIMUS (DRC). OMIEN VAROJEN VAATIMUKSEN (OFR) KOOSTUMUS SALKUITTAIN

Salkku

Kokonaisluku

Riskiluokka	Alaluokka1	Alaluokka2	Omien varojen vaatimukset (raportointivaluutan tulokset)	Raportointivaluutta	Omien varojen vaatimukset (EPV:n salkun valuutan tulokset)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 – VAIHTOEHTOINEN STANDARDIMENETELMÄ (ASA). Omien varojen vaatimus (OFR)

Salkun numero	Raportointivaluutan tulokset			EPV:n salkun valuutan tulokset		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070”

LIITE V

”LIITE X

Herkkyysperusteisen menetelmän (SBM) validointisalkut

Taulukon nimi	Kuvaus
Instrumentit	Instrumentit (herkkyydet ja kaarevuusriskipositiot) SBM:n validointia varten
Salkut	SBM:n validointisalkut, jotka on määritelty tässä liitteessä eriteltyjen instrumenttien yhdistelminä

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				– 900,00
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				– 350,00
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				– 300,00
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				– 50,00
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				– 400,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				– 800,00
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00
S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				– 100,00
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				– 2 000,00
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				– 300,00
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				– 4 750,00
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				– 500,00
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				– 50 000,00
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			– 65 000,00
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			– 100 000,00
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				– 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000,00
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			– 50 000,00
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			– 120 000,00
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			– 100 000,00
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			– 25 000,00
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			– 90 000,00
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			– 35 000,00
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			– 5 000,00
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			– 100 000,00
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			– 10 000,00
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			– 65 000,00
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS			– 50 000,00
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m			– 40 000,00
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			20 000,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS			– 30 000,00
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD				– 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP				– 1 270,00
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR				– 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND				– 11 950,00
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD				– 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP				450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR				– 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND				– 4 030,00
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP				– 400,00
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND				– 2 000,00
S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				– 100,00
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				– 4 800,00
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				– 8 000,00
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				– 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				– 800,00
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				– 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				– 3 400,00
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				– 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				– 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				– 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				– 2 100,00
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			100,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	LIIKKEESEENLASKIJA AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	LIIKKEESEENLASKIJA M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	LUETTELONUMERO N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	LUETTELONUMERO O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	LIIKKEESEENLASKIJA Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	LIIKKEESEENLASKIJA AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			– 500,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	LUETTELONUMERO N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	LUETTELONUMERO O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	LIIKKEESEENLASKIJA X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	LIIKKEESEENLASKIJA Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	LIIKKEESEENLASKIJA AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	LUETTELONUMERO N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	LUETTELONUMERO O			– 200,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	LUETTELONUMERO Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	LUETTELONUMERO N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	LUETTELONUMERO O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	LIIKKEESEENLASKIJA AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	LIIKKEESEENLASKIJA AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	LIIKKEESEENLASKIJA AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	LIIKKEESEENLASKIJA C			– 500,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	LIIKKEESEENLASKIJA D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	LIIKKEESEENLASKIJA E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	LIIKKEESEENLASKIJA G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	LIIKKEESEENLASKIJA H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	LIIKKEESEENLASKIJA I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	LIIKKEESEENLASKIJA L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	LUETTELONUMERO N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	LUETTELONUMERO O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	LUETTELONUMERO P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	LIIKKEESEENLASKIJA C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	LIIKKEESEENLASKIJA D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	LIIKKEESEENLASKIJA E			1 100,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	LIIKKEESEENLASKIJA G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	LIIKKEESEENLASKIJA H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	LIIKKEESEENLASKIJA I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	LIIKKEESEENLASKIJA J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	LIIKKEESEENLASKIJA L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	LIIKKEESEENLASKIJA M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	LIIKKEESEENLASKIJA N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	LIIKKEESEENLASKIJA O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	LUETTELONUMERO Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	LUETTELONUMERO R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	LUETTELONUMERO S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	LUETTELONUMERO S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	LUETTELONUMERO T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	LIIKKEESEENLASKIJA U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	LIIKKEESEENLASKIJA V			– 100,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	LIIKKEESEENLASKIJA AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	LIIKKEESEENLASKIJA AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	LIIKKEESEENLASKIJA AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	LIIKKEESEENLASKIJA G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	LIIKKEESEENLASKIJA L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	LIIKKEESEENLASKIJA M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	LIIKKEESEENLASKIJA N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	LIIKKEESEENLASKIJA P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	LUETTELONUMERO Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	LUETTELONUMERO R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	LUETTELONUMERO T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	LIIKKEESEENLASKIJA X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	LIIKKEESEENLASKIJA Y			4 800,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	LIIKKEESEENLASKIJA Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	LIIKKEESEENLASKIJA AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	LIIKKEESEENLASKIJA AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	LIIKKEESEENLASKIJA AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	LIIKKEESEENLASKIJA AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	LIIKKEESEENLASKIJA AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	LIIKKEESEENLASKIJA AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	LIIKKEESEENLASKIJA AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	LIIKKEESEENLASKIJA AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	LIIKKEESEENLASKIJA C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	LIIKKEESEENLASKIJA D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	LIIKKEESEENLASKIJA E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	LIIKKEESEENLASKIJA G			– 3 642,50

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	LIIKKEESEENLASKIJA H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	LIIKKEESEENLASKIJA I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	LIIKKEESEENLASKIJA Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	LIIKKEESEENLASKIJA R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	LIIKKEESEENLASKIJA S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	LIIKKEESEENLASKIJA T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	LIIKKEESEENLASKIJA U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	LIIKKEESEENLASKIJA V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	LIIKKEESEENLASKIJA W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	LIIKKEESEENLASKIJA AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	LIIKKEESEENLASKIJA AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	LIIKKEESEENLASKIJA AC			– 5 414,60

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	LIIKKEESEENLASKIJA AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	LIIKKEESEENLASKIJA AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	LIIKKEESEENLASKIJA AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	LIIKKEESEENLASKIJA AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	LIIKKEESEENLASKIJA AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	LIIKKEESEENLASKIJA C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	LIIKKEESEENLASKIJA D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	LIIKKEESEENLASKIJA E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	LIIKKEESEENLASKIJA F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	LIIKKEESEENLASKIJA G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	LIIKKEESEENLASKIJA H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	LIIKKEESEENLASKIJA I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	LIIKKEESEENLASKIJA J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	LIIKKEESEENLASKIJA Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	LIIKKEESEENLASKIJA R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	LIIKKEESEENLASKIJA S			– 9 435,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	LIIKKEESEENLASKIJA T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	LIIKKEESEENLASKIJA U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	LIIKKEESEENLASKIJA V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	LIIKKEESEENLASKIJA W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	LIIKKEESEENLASKIJA HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	LIIKKEESEENLASKIJA AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	LUETTELONUMERO V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			500,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	LIIKKEESEENLASKIJA D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	LIIKKEESEENLASKIJA E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	LIIKKEESEENLASKIJA F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	LIIKKEESEENLASKIJA G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	LIIKKEESEENLASKIJA H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	LIIKKEESEENLASKIJA I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	LIIKKEESEENLASKIJA J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	LIIKKEESEENLASKIJA L			1 000,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	LIIKKEESEENLASKIJA M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	LIIKKEESEENLASKIJA N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	LIIKKEESEENLASKIJA O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	LIIKKEESEENLASKIJA P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	LIIKKEESEENLASKIJA Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	LIIKKEESEENLASKIJA R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	LUETTELONUMERO S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	LUETTELONUMERO T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	LUETTELONUMERO U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	LIIKKEESEENLASKIJA HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	LIIKKEESEENLASKIJA T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	LUETTELONUMERO Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	LIIKKEESEENLASKIJA AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	LIIKKEESEENLASKIJA W		LL 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	LIIKKEESEENLASKIJA S			– 6 000,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	LUETTELONUMERO X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	LIIKKEESEENLASKIJA D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	LIIKKEESEENLASKIJA E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	LIIKKEESEENLASKIJA F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	LIIKKEESEENLASKIJA G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	LIIKKEESEENLASKIJA H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	LIIKKEESEENLASKIJA HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	LIIKKEESEENLASKIJA I		LL 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	LIIKKEESEENLASKIJA J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	LIIKKEESEENLASKIJA K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	LIIKKEESEENLASKIJA L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	LIIKKEESEENLASKIJA M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	LIIKKEESEENLASKIJA N			– 20 000,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CND_o1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	16	LIIKKEESEENLASKIJA O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	17	LIIKKEESEENLASKIJA P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	18	LIIKKEESEENLASKIJA Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_DEBT	18	LIIKKEESEENLASKIJA R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	LIIKKEESEENLASKIJA AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	LUETTELONUMERO U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	LUETTELONUMERO V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	LUETTELONUMERO X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	LIIKKEESEENLASKIJA AA		LL 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	LIIKKEESEENLASKIJA AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	LIIKKEESEENLASKIJA D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	LIIKKEESEENLASKIJA E			– 1 050,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	LIIKKEESEENLASKIJA F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	LIIKKEESEENLASKIJA G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	LIIKKEESEENLASKIJA H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	LIIKKEESEENLASKIJA HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	LIIKKEESEENLASKIJA I		LL 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	LIIKKEESEENLASKIJA J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	LIIKKEESEENLASKIJA K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	LIIKKEESEENLASKIJA L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	LIIKKEESEENLASKIJA M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	LIIKKEESEENLASKIJA N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	LIIKKEESEENLASKIJA O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	LIIKKEESEENLASKIJA P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	LIIKKEESEENLASKIJA Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	LIIKKEESEENLASKIJA R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	LIIKKEESEENLASKIJA S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	LIIKKEESEENLASKIJA T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	LIIKKEESEENLASKIJA U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	LIIKKEESEENLASKIJA V			– 18 637,50

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	LIIKKEESEENLASKIJA W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	LIIKKEESEENLASKIJA X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	LIIKKEESEENLASKIJA Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	LIIKKEESEENLASKIJA AA		LL 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	LIIKKEESEENLASKIJA AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	LIIKKEESEENLASKIJA C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	LIIKKEESEENLASKIJA D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	LIIKKEESEENLASKIJA E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	LIIKKEESEENLASKIJA F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	LIIKKEESEENLASKIJA G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	LIIKKEESEENLASKIJA H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	LIIKKEESEENLASKIJA HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	LIIKKEESEENLASKIJA I		LL 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	LIIKKEESEENLASKIJA J			4 100,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	LIIKKEESEENLASKIJA K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	LIIKKEESEENLASKIJA L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	LIIKKEESEENLASKIJA M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	LIIKKEESEENLASKIJA N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	LIIKKEESEENLASKIJA O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	LIIKKEESEENLASKIJA P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	LIIKKEESEENLASKIJA Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	LIIKKEESEENLASKIJA R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	LIIKKEESEENLASKIJA S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	LIIKKEESEENLASKIJA T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	LIIKKEESEENLASKIJA U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	LIIKKEESEENLASKIJA V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	LIIKKEESEENLASKIJA W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	LIIKKEESEENLASKIJA X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	LIIKKEESEENLASKIJA Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	KIVIHIILI			– 300,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URAANI			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	KIVIHIILI			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URAANI			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	KIVIHIILI			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URAANI			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	KIVIHIILI			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URAANI			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FWD-SÄHKÖ NE			– 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	KUPARI			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	NESTEYTETTY MAAKAASU			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	HOPEA			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MAISSI			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	HERA			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	KUMI			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	KALIUMKARBO-NAATTI			– 1 800,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	KIVIHIILI			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	KIVIHIILI			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URAANI			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	SPOT-SÄHKÖ SE			– 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	TERÄS			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	MAAKAASU			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	KULTA			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOIJAPAVUT			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	KALAT			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	KAAKAO			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	TASOLASI			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_x1#	CM_V_0.50	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	MAISSI	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FWD-SÄHKÖ NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	HOPEA	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	HERA	NEWCASTLE		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	NESTEYTETTY MAAKAASU	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	KUMI	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	KUPARI	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	KALIUMKARBO-NAATTI	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URAANI	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	KIVIHIILI	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	KIVIHIILI	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	KIVIHIILI	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	KIVIHIILI	LONTOO		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	SPOT-SÄHKÖ SE	LONTOO		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	TERÄS	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	MAAKAASU	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	KULTA	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOIJAPAVUT	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	KALAT	LONTOO		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	KAAKAO	LONTOO		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	TASOLASI	LONTOO		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	KIVIHIILI			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	KIVIHIILI			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URAANI			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			– 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			– 36 900,00
S_CMC_e1#	CM_CU	3	SPOT-SÄHKÖ SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FWD-SÄHKÖ NE			– 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			– 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMC_i1#	CM_CU	5	TERÄS			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	KUPARI			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	MAAKAASU			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	NESTEYTETTY MAAKAASU			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	KULTA			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	HOPEA			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOIJAPAVUT			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MAISSI			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	KALAT			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	HERA			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	KAAKAO			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	KUMI			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	TASOLASI			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	KALIUMKARBO-NAATTI			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	MAITO			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URAANI			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMC_a1#	CM_CD	1	KIVIHIILI			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	KIVIHIILI			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URAANI			– 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	SPOT-SÄHKÖ SE			– 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FWD-SÄHKÖ NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 15 256,00
S_CMC_i1#	CM_CD	5	TERÄS			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	KUPARI			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	MAAKAASU			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	NESTEYTETTY MAAKAASU			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	KULTA			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	HOPEA			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOIJAPAVUT			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MAISSI			– 14 735,00

Instrumentti	Riskitekijän tunniste	Alaluokka	Lisätunniste	Lisätunniste 2	Luottoluokka	Riskiherkkyys
S_CMC_q1#	CM_CD	9	KALAT			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	HERA			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	KAAKAO			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	KUMI			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	TASOLASI			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	KALIUMKARBO-NAATTI			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	MAITO			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URAANI			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
G029	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	DELTA	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
G039	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	VEGA	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1#
G047	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1#
G048	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1#
G050	GIRR	CURVATURE	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	CURVATURE	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	CURVATURE	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	CURVATURE	S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
G054	GIRR	KAIKKI	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#
E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
E015	EQ	DELTA	S_EQD_x1#
E016	EQ	DELTA	S_EQD_y1#
E017	EQ	DELTA	S_EQD_z1#
E018	EQ	DELTA	S_EQD_f2#
E019	EQ	DELTA	S_EQD_aa1#
E020	EQ	DELTA	S_EQD_ab1#
E021	EQ	DELTA	S_EQD_ac1#
E022	EQ	DELTA	S_EQD_k2#
E023	EQ	DELTA	S_EQD_m2#
E024	EQ	DELTA	S_EQD_p1#
E025	EQ	DELTA	S_EQD_q2#
E026	EQ	DELTA	S_EQD_t1#
E027	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	DELTA	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
E045	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
E087	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#
E088	EQ	CURVATURE	S_EQC_b1#
E089	EQ	CURVATURE	S_EQC_c1#
E090	EQ	CURVATURE	S_EQC_d1#
E091	EQ	CURVATURE	S_EQC_e1#
E092	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1#
E093	EQ	CURVATURE	S_EQC_g1#
E094	EQ	CURVATURE	S_EQC_h1#
E095	EQ	CURVATURE	S_EQC_i1#
E096	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1#
E097	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1#
E098	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1#
E099	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1#
E100	EQ	CURVATURE	S_EQC_u1#
E101	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	CURVATURE	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	CURVATURE	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	CURVATURE	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	CURVATURE	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
E108	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	CURVATURE	S_EQC_s1#
E110	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	CURVATURE	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	CURVATURE	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	CURVATURE	S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
E117	EQ	KAIKKI	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
			S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
F001	FX	DELTA	S_FXD_b1#
F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
F015	FX	CURVATURE	S_FXC_b1#
F016	FX	CURVATURE	S_FXC_c1#
F017	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	CURVATURE	S_FXC_d1#
F019	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	CURVATURE	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	CURVATURE	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	CURVATURE	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	FX	KAIKKI	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	FX	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	CURVATURE	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N036	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#
N054	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_p1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
N081	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N099	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#
N104	CSR_NON_SEC	KAIKKI	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURE	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_hb1#
C001	CM	DELTA	S_CMD_a2#
C002	CM	DELTA	S_CMD_c1#
C003	CM	DELTA	S_CMD_e1#
C004	CM	DELTA	S_CMD_g1#
C005	CM	DELTA	S_CMD_i1#
C006	CM	DELTA	S_CMD_k1#
C007	CM	DELTA	S_CMD_m1#
C008	CM	DELTA	S_CMD_o1#
C009	CM	DELTA	S_CMD_q1#
C010	CM	DELTA	S_CMD_s1#
C011	CM	DELTA	S_CMD_u1#
C012	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	DELTA	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	DELTA	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	DELTA	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	DELTA	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	DELTA	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	DELTA	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	DELTA	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	DELTA	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	DELTA	S_CMD_u1# S_CMD_v1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C051	CM	CURVATURE	S_CMC_b1#
C052	CM	CURVATURE	S_CMC_c1#
C053	CM	CURVATURE	S_CMC_e1#
C054	CM	CURVATURE	S_CMC_g1#
C055	CM	CURVATURE	S_CMC_i1#
C056	CM	CURVATURE	S_CMC_k1#
C057	CM	CURVATURE	S_CMC_m1#
C058	CM	CURVATURE	S_CMC_o1#
C059	CM	CURVATURE	S_CMC_q1#
C060	CM	CURVATURE	S_CMC_s1#
C061	CM	CURVATURE	S_CMC_u1#
C062	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	CURVATURE	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	CURVATURE	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	CURVATURE	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	CURVATURE	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	CURVATURE	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	CURVATURE	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	CURVATURE	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	CURVATURE	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	CURVATURE	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	CURVATURE	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Salkku	Riskiluokka	Osatekijä	Instrumentit
C076	CM	CURVATURE	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	CURVATURE	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	CURVATURE	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	CURVATURE	S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#
C081	CM	KAIKKI	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#”