

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ01: ΕΙΔΙΚΟΣ ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΥΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ και ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΤΙΤΛΩΝ, ΕΠΙΤΟΚΙΩΝ, ΣΥΝΑΛΛΑΓΜΑΤΟΣ (τυποποιημένη προσέγγιση)

Κωδικός	Περιγραφή	ΘΕΣΕΙΣ							ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ	
		ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ		(-) ΑΦΑΙΡΕΤΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΜΕΣΩΝ ΠΟΥ ΕΧΟΥΝ ΑΝΑΛΗΦΘΕΙ Ή ΥΠΑΣΦΑΛΙΖΟΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΡΙΤΟΥΣ	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		(-) ΜΕΙΩΣΕΙΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ ΕΙΔΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΓΙΑ ΘΕΣΕΙΣ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ ΠΟΥ ΑΝΤΙΣΤΑΘΜΙΖΟΝΤΑΙ ΜΕ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ			
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)					ΣΕ ΘΕΤΙΚΕΣ (LONG) ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8) = (4) - (6) + (5) - (7)	(9)	(10)
Γενικό Σύνολο	Ειδικός κίνδυνος - Πίνακας 1, Παράρτημα Ι της ΠΔΤΕ 2646/9.9.2011, όπως ισχύει										
1.1	Κατηγορία 1									0%	
1.2	Σύνολο Κατηγορίας 2										
1.2.1	Εναπομένουσα διάρκεια μέχρι τη λήξη ≤ 6 μηνών									0,25%	
1.2.2	Εναπομένουσα διάρκεια μέχρι τη λήξη > 6 μηνών και ≤ 24 μηνών									1%	
1.2.3	Εναπομένουσα διάρκεια μέχρι τη λήξη > 24 μηνών									1,60%	
1.3	Κατηγορία 3									8%	
1.4	Κατηγορία 4									12%	
1.5	Καλυμμένες Ομολογίες										

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

