

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ05: ΓΕΝΙΚΟΣ ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΥΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ και ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΤΙΤΛΩΝ, ΕΠΙΤΟΚΙΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΜΑΤΟΣ ΣΕ ΣΥΝΑΡΤΗΣΗ ΜΕ ΤΟ ΜΕΣΟ ΣΤΑΘΜΙΚΟ ΔΕΙΚΤΗ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ (τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)											
Κωδικός	Περιγραφή	ΘΕΣΕΙΣ								ΤΕΚΜΑΙΡΟΜΕΝΗ ΜΕΤΑΒΟΛΗ ΕΠΙΤΟΚΙΟΥ & ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΜΕΣΟΣ ΤΡΟΠΟΠΟΙΗΜΕΝΟΣ ΔΕΙΚΤΗΣ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ (*)		ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ		(-) ΑΦΑΙΡΕΤΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΜΕΣΩΝ ΠΟΥ ΕΧΟΥΝ ΑΝΑΛΗΦΘΕΙ Ή ΥΠΑΣΦΑΛΙΖΟΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΡΙΤΟΥΣ	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ		
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)		ΣΤΑΘΜ.ΠΟΣΟ ΘΕΣΕΩΝ ΑΝΑΔΟΧΗΣ	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΙ ΤΙΤΛΟΙ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ											
Γενικό Σύνολο	Γενικός κίνδυνος σε συνάρτηση με το μέσο σταθμικό δείκτη διάρκειας (Duration-based)										
5.1	ΖΩΝΗ 1(> 0 ≤ 1 έτος)									1,00%	
5.2	ΖΩΝΗ 2(> 1 ≤ 3,6 έτη)									0,85%	
5.3	ΖΩΝΗ 3(> 3,6 έτη)									0,70%	
5.4	Άθροισμα σταθμισμένων βάσει του δείκτη διάρκειας αντιστοιχισμένων θέσεων σε όλες τις ζώνες									2%	
5.5	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας θέσεων που αντιστοιχίζονται μεταξύ των ζωνών 1 και 2									40%	
5.6	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας θέσεων που αντιστοιχίζονται μεταξύ των ζωνών 2 και 3									40%	
5.7	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας θέσεων που αντιστοιχίζονται μεταξύ των ζωνών 1 και 3									150%	
5.8	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας μη αντιστοιχισμένες θέσεις που εναπομένουν									100%	

(*) ΣΗΜΕΙΩΣΗ: Όλοι οι χρωστικοί τίτλοι που ανήκουν στην ίδια ζώνη ομαδοποιούνται σε μια αξία και έναν μέσο τροποποιημένο δείκτη διάρκειας

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ06: ΓΕΝΙΚΟΣ ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΤΙΤΛΩΝ, ΕΠΙΤΟΚΙΩΝ ΚΑΙ ΣΥΝΑΛΛΑΓΜΑΤΟΣ ΣΕ ΣΥΝΑΡΤΗΣΗ ΜΕ ΤΟ ΜΕΣΟ ΣΤΑΘΜΙΚΟ ΔΕΙΚΤΗ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ (τυποποιημένη προσέγγιση) (ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Περιγραφή	ΘΕΣΕΙΣ								ΤΕΚΜΑΙΡΟΜΕΝΗ ΜΕΤΑΒΟΛΗ ΕΠΙΤΟΚΙΟΥ & ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΜΕΣΟΣ ΤΡΟΠΟΠΟΙΗΜΕΝΟΣ ΔΕΙΚΤΗΣ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ (*)		ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ		(-) ΑΦΑΙΡΕΤΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΜΕΣΩΝ ΠΟΥ ΕΧΟΥΝ ΑΝΑΛΗΦΘΕΙ Ή ΥΠΑΣΦΑΛΙΖΟΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΡΙΤΟΥΣ	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ		
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)		ΣΤΑΘΜ.ΠΟΣΟ ΘΕΣΕΩΝ ΑΝΑΔΟΧΗΣ	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)
ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΙ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΙ ΤΙΤΛΟΙ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ											
Γενικό Σύνολο	Γενικός κίνδυνος σε συνάρτηση με το μέσο σταθμικό δείκτη διάρκειας (Duration-based)										
6.1	ΖΩΝΗ 1(> 0 ≤ 1 έτος)									1,00%	
6.2	ΖΩΝΗ 2(> 1 ≤ 3,6 έτη)									0,85%	
6.3	ΖΩΝΗ 3(> 3,6 έτη)									0,70%	
6.4	Άθροισμα σταθμισμένων βάσει του δείκτη διάρκειας αντιστοιχισμένων θέσεων σε όλες τις ζώνες									2%	
6.5	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας θέσεων που αντιστοιχίζονται μεταξύ των ζωνών 1 και 2									40%	
6.6	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας θέσεων που αντιστοιχίζονται μεταξύ των ζωνών 2 και 3									40%	
6.7	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας θέσεων που αντιστοιχίζονται μεταξύ των ζωνών 1 και 3									150%	
6.8	Σταθμισμένες βάσει του δείκτη διάρκειας μη αντιστοιχισμένες θέσεις που εναπομένουν									100%	

(*) ΣΗΜΕΙΩΣΗ: Όλοι οι χρεωστικοί τίτλοι που ανήκουν στην ίδια ζώνη ομαδοποιούνται σε μια αξία και έναν μέσο τροποποιημένο δείκτη διάρκειας