ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ07: ΓΕΝΙΚΟΣ & ΕΙΔΙΚΟΣ ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ και ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΜΕΤΟΧΩΝ, ΔΕΙΚΤΩΝ ΜΕΤΟΧΩΝ (τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Περιγραφή	ΘΕΣΕΙΣ						ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ		(-) ΑΦΑΙΡΕΤΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΜΕΣΩΝ ΠΟΥ ΕΧΟΥΝ ΑΝΑΛΗΦΘΕΙ Ή ΥΠΑΣΦΑΛΙΖΟΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΡΙΤΟΥΣ (ΕΠΙΔΡΑΣΗ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΕΚΔΟΣΗΣ ΤΙΤΛΩΝ)	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ		
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	ΣΤΑΘΜ.ΠΟΣΟ ΘΕΣΕΩΝ ΑΝΑΔΟΧΗΣ	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
ΜΕΤΟΧΕΣ ΣΤΟ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ									
7.1	Γενικός κίνδυνος							8%	
7.1.1	Διαπραγματεύσιμες στο χρηματιστήριο προθεσμιακές συμβάσεις δείκτη μετοχών που αντιπροσωπεύουν ευρέως διαφοροποιημένους δείκτες υποκείμενες σε ειδική προσέγγιση							8%	
7.1.2	Λοιπές μετοχές που δεν περιλαμβάνονται στη κατηγορία 7.1.1							8%	
7.2	Ειδικός κίνδυνος								
7.2.1	Χαρτοφυλάκια διαφοροποιημένα, υψηλής ποιότητας μετοχών που καλύπτονται από εγγύηση ή ασφάλεια και θεωρούνται υψηλής εμπορευσιμότητας από τις αρμόδιες αρχές βάσει αντικειμενικών κριτηρίων							8%	
7.2.2α	Λοιπές διαπραγματεύσιμες στο χρηματιστήριο προθεσμιακές συμβάσεις δείκτη μετοχών που αντιπροσωπεύουν μη επαρκώς διαφοροποιημένους δείκτες							8%	
7.2.3	Διαπραγματεύσιμες στο χρηματιστήριο προθεσμιακές συμβάσεις δείκτη μετοχών που αντιπροσωπεύουν ευρέως διαφοροποιημένους δείκτες							0%	

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ08: ΓΕΝΙΚΟΣ & ΕΙΔΙΚΟΣ ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΜΕΤΟΧΩΝ, ΔΕΙΚΤΩΝ ΜΕΤΟΧΩΝ (τυποποιημένη προσέγγιση)
(ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Περιγραφή	ΘΕΣΕΙΣ						ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ		(-) ΑΦΑΙΡΕΤΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΩΝ ΜΕΣΩΝ ΠΟΥ ΕΧΟΥΝ ΑΝΑΛΗΦΘΕΙ Ή ΥΠΑΣΦΑΛΙΖΟΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΡΙΤΟΥΣ (ΕΠΙΔΡΑΣΗ ΑΝΑΔΟΧΗΣ ΕΚΔΟΣΗΣ ΤΙΤΛΩΝ)	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ		
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	ΣΤΑΘΜ.ΠΟΣΟ ΘΕΣΕΩΝ ΑΝΑΔΟΧΗΣ	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)
ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΧΡΗΜΑΤΟΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΜΕΤΟΧΩΝ, ΔΕΙΚΤΩΝ ΜΕΤΟΧΩΝ ΣΤΟ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ									
8.1	Γενικός κίνδυνος							8%	
8.1.1	Διαπραγματεύσιμες στο χρηματιστήριο προθεσμιακές συμβάσεις δείκτη μετοχών που αντιπροσωπεύουν ευρέως διαφοροποιημένους δείκτες υποκείμενες σε ειδική προσέγγιση							8%	
8.1.2	Λοιπές μετοχές που δεν περιλαμβάνονται στη κατηγορία 8.1.1							8%	
8.2	Ειδικός κίνδυνος								
8.2.1	Χαρτοφυλάκια διαφοροποιημένα, υψηλής ποιότητας μετοχών που καλύπτονται από εγγύηση ή ασφάλεια και θεωρούνται υψηλής εμπορευσιμότητας από τις αρμόδιες αρχές βάσει αντικειμενικών κριτηρίων							8%	
8.2.2α	Λοιπές διαπραγματεύσιμες στο χρηματιστήριο προθεσμιακές συμβάσεις δείκτη μετοχών που αντιπροσωπεύουν μη επαρκώς διαφοροποιημένους δείκτες							8%	
8.2.3	Διαπραγματεύσιμες στο χρηματιστήριο προθεσμιακές συμβάσεις δείκτη μετοχών που αντιπροσωπεύουν ευρέως διαφοροποιημένους δείκτες							0%	