

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ09: ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΟΣΕ, ΔΟΜΗΜΕΝΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ & HEDGE FUNDS, GAMMA & VEGA ΤΩΝ ΔΙΚΑΙΩΜΑΤΩΝ ΠΡΟΑΙΡΕΣΗΣ ΚΑΙ ΠΕΡΙΘΩΡΙΑ ΕΓΓΥΗΣΗΣ ΓΙΑ ΤΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ (τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Περιγραφή	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ	ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
9.1	Γενικός και Ειδικός κίνδυνος από θέσεις σε ΟΣΕ				32%	
9.2	Κεφαλαιακή απαίτηση ίση με το ποσό των περιθωρίων εγγύησης (margins) για διαπραγματεύσιμα σε χρηματιστήριο συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης και δικαιωμάτων προαίρεσης (futures - options)					
9.2.1	Κεφαλαιακή απαίτηση για διαπραγματεύσιμες προθεσμιακές συμβάσεις και συμβάσεις προαίρεσης επί χρεωστικών τίτλων (futures - options)					
9.2.2	Κεφαλαιακή απαίτηση για διαπραγματεύσιμες προθεσμιακές συμβάσεις και συμβάσεις προαίρεσης επί μετοχών (futures - options)					
9.2.3	Κεφαλαιακή απαίτηση για διαπραγματεύσιμα συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης και δικαιωμάτων προαίρεσης επί εμπορευμάτων (futures - options)					
9.3	Κεφαλαιακή απαίτηση ίση με το ποσό των περιθωρίων εγγύησης που απαιτεί το συμψηφιστικό γραφείο για συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παράγωγων μέσων οι οποίες διακανονίζονται από αναγνωρισμένο συμψηφιστικό γραφείο (OTC futures και options)					
9.3.1	Κεφαλαιακή απαίτηση για συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παράγωγων μέσων σε χρεωστικούς τίτλους (OTC futures και options)					
9.3.2	Κεφαλαιακή απαίτηση για συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παράγωγων μέσων σε μετοχές ή δείκτες μετοχών (OTC futures και options)					
9.3.3	Κεφαλαιακή απαίτηση για συμβάσεις εξωχρηματιστηριακών παράγωγων μέσων σε εμπορεύματα (OTC futures και options)					
9.4	Κάλυψη των άλλων κινδύνων, εκτός του κινδύνου που σχετίζεται με το συντελεστή δέλτα, στους οποίους υπόκεινται τα δικαιώματα προαίρεσεων					
9.4.1	Κίνδυνος GAMMA από δικαιώματα προαίρεσεων σε χρεωστικούς τίτλους					
9.4.2	Κίνδυνος VEGA από δικαιώματα προαίρεσεων σε χρεωστικούς τίτλους					
9.4.3	Κίνδυνος GAMMA από δικαιώματα προαίρεσεων σε μετοχές και δείκτες επί μετοχών					
9.4.4	Κίνδυνος VEGA από δικαιώματα προαίρεσεων σε μετοχές και δείκτες επί μετοχών					
9.4.5	Κίνδυνος GAMMA από δικαιώματα προαίρεσεων σε συνάλλαγμα					
9.4.6	Κίνδυνος VEGA από δικαιώματα προαίρεσεων σε συνάλλαγμα					
9.4.7	Κίνδυνος GAMMA από δικαιώματα προαίρεσεων σε εμπορεύματα					
9.4.8	Κίνδυνος VEGA από δικαιώματα προαίρεσεων σε εμπορεύματα					
9.5	Γενικός και Ειδικός κίνδυνος από θέσεις σε επενδυτικές εταιρείες υψηλής μόχλευσης (hedge funds)				32%	
9.6	Γενικός και Ειδικός κίνδυνος από θέσεις σε ιδιωτικά επενδυτικά κεφάλαια (private equity funds)				32%	
9.7	Γενικός και Ειδικός κίνδυνος από θέσεις σε δομημένα προϊόντα				12%	
	ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ 9.1+9.2+9.3+9.4+9.5+9.6+9.7					