

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ15Α: ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΒΑΣΙΚΑ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΑ ΚΑΙ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΩΝ

ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ ΜΕ ΒΑΣΗ ΤΟ ΠΙΝΑΚΑ ΛΗΚΤΟΤΗΤΑΣ (MATURITY LADDER APPROACH) (τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Διαστήματα ληκτοτήτων	Καθαρές θέσεις		Κεφαλαιακές Απαιτήσεις			
		Θετική Long	Αρνητική Short	Κεφαλαιακή απαίτηση αντιστοιχισμένων θέσεων 1,5%	Κεφαλαιακή απαίτηση αντιστοιχισμένων θέσεων μεταξύ διαστημάτων ληκτότητας 0,6%	Συνολική κεφαλαιακή απαίτηση	
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)=(3)+(4)	
ΕΜΠΟΡΕΥΜΑ :	15Α.1	≤ 1 έτος					
		0 ≤ 1 μήνα					
		> 1 ≤ 3 μήνες					
		> 3 ≤ 6 μήνες					
		> 6 ≤ 12 μήνες					
	15Α.2	> 1 έτος και ≤ 3 έτη					
		> 1 ≤ 2 έτη					
		> 2 ≤ 3 έτη					
	15Α.3	> 3 έτη					
		>3 έτη					
		ΣΥΝΟΛΟ					
		Κεφαλαιακή απαίτηση απομενουσών μη αντιστοιχισμένων θέσεων 15%					
	ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΗΣ ΑΠΑΙΤΗΣΗΣ = συν. κεφ. απαιτ. + κεφ. απαιτ. απομ. μη αντισ. θέσεων 15%						

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ15: ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΒΑΣΙΚΑ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΑ ΚΑΙ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΩΝ

ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ ΜΕ ΒΑΣΗ ΤΟ ΠΙΝΑΚΑ ΛΗΚΤΟΤΗΤΑΣ (MATURITY LADDER APPROACH) (τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Διαστήματα ληκτοτήτων	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ	ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)	ΚΕΦΑΛΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
15.1α	ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ					
15.1α.1	≤ 1 έτος					
15.1α.1.1	0 ≤ 1 μήνα					
15.1α.1.2	> 1 ≤ 3 μήνες					
15.1α.1.3	> 3 ≤ 6 μήνες					
15.1α.1.4	> 6 ≤ 12 μήνες					
15.1α.2	> 1 έτος και ≤ 3 έτη					
15.1α.2.1	> 1 ≤ 2 έτη					
15.1α.2.2	> 2 ≤ 3 έτη					
15.1α.3	> 3 έτη					
15.1α.α	Σύνολο αντιστοιχισμένων θετικών και αρνητικών θέσεων για όλα τα διαστήματα ληκτότητας				1,50%	
15.1α.β	Σύνολο αντιστοιχισμένων θέσεων μεταξύ δύο διαστημάτων ληκτότητας για όλα τα διαστήματα ληκτότητας				0,60%	
15.1α.γ	Σύνολο απομενουσών μη αντιστοιχισμένων θέσεων για όλα τα διαστήματα ληκτότητας				15,00%	