

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ16Α: ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΒΑΣΙΚΑ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΑ ΚΑΙ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΩΝ
ΔΙΕΥΡΥΜΕΝΗ ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ ΜΕ ΒΑΣΗ ΤΟ ΠΙΝΑΚΑ ΛΗΚΤΟΤΗΤΑΣ (EXTENDED MATURITY LADDER APPROACH)
(τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)							
Εμπόρευμα	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)
ΛΟΙΠΑ, ΣΥΓΓΡΑΜΜΑΤΟΜΕΝΩΝ ΤΩΝ ΕΝΕΡΓΕΙΑΚΩΝ ΠΡΟΪΟΝΤΩΝ & ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΕΠΙ ΛΟΙΠΩΝ ΠΡΟΪΟΝΤΩΝ	Δ16Α.1	≤ 1 έτος					
		0 ≤ 1 μήνα					
		> 1 ≤ 3 μήνες					
		> 3 ≤ 6 μήνες					
		> 6 ≤ 12 μήνες					
	Δ16Α.2	> 1 έτος και ≤ 3 έτη					
		> 1 ≤ 2 έτη					
		> 2 ≤ 3 έτη					
	Δ16Α.3	> 3 έτη					
		>3έτη					
		ΣΥΝΟΛΟ					
		Κεφαλαιακή απαίτηση απομεινουσών 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 Δ16: ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΒΑΣΙΚΑ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΑ ΚΑΙ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΜΕΣΑ ΕΠΙ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΩΝ

ΔΙΕΥΡΥΜΕΝΗ ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ ΜΕ ΒΑΣΗ ΤΟΝ ΠΙΝΑΚΑ ΛΗΚΤΟΤΗΤΑΣ (EXTENDED MATURITY LADDER APPROACH) (τυποποιημένη προσέγγιση)

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Διαστήματα ληκτοτήτων	ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΘΕΣΕΙΣ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΕΣ ΣΕ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ	ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)	ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)			
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)
16.1α	ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ					
16.1α.1	≤ 1 έτος					
16.1α.1.1	0 ≤ 1 μήνα					
16.1α.1.2	> 1 ≤ 3 μήνες					
16.1α.1.3	> 3 ≤ 6 μήνες					
16.1α.1.4	> 6 ≤ 12 μήνες					
16.1α.2	> 1 έτος και ≤ 3 έτη					
16.1α.2.1	> 1 ≤ 2 έτη					
16.1α.2.2	> 2 ≤ 3 έτη					
16.1α.3	> 3 έτη					
16.1α.α	Σύνολο αντιστοιχισμένων θετικών και αρνητικών θέσεων για όλα τα διαστήματα ληκτότητας					
16.1α.β	Σύνολο αντιστοιχισμένων θέσεων μεταξύ δύο διαστημάτων ληκτότητας για όλα τα διαστήματα ληκτότητας					
16.1α.γ	Σύνολο απομενουσών μη αντιστοιχισμένων θέσεων για όλα τα διαστήματα ληκτότητας					