ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ19: ΓΕΝΙΚΟΣ & ΕΙΔΙΚΟΣ ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΘΕΣΗΣ & ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΤΙΜΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΜΑΤΟΣ & ΚΙΝΔΥΝΟΣ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΟΣ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΕΝΟΣ ΜΕ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟ ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

		VaR		STRESSED (Ακραίων συνθηκών) VaR		ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΗ ΑΠΑΙΤΗΣΗ ΕΝΑΝΤΙ ΤΩΝ ΕΠΙΠΡΟΣΘΕΤΩΝ ΚΙΝΔΥΝΩΝ ΑΘΕΤΗΣΗΣΗ ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΩΝ & ΜΕΤΑΒΟΛΗΣ ΤΗΣ ΠΙΣΤΟΛΗΠΤΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ		ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΗ ΑΠΑΙΤΗΣΗ ΓΙΑ ΟΛΟΥΣ ΤΟΥΣ ΚΙΝΔΥΝΟΥΣ ΤΙΜΗΣ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΣΥΣΧΕΤΙΣΕΩΝ				ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ	ΛΟΙΠΕΣ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΕΣ				
Κωδικός	ΚΑΤΗΓΟΡΙΕΣ ΚΙΝΔΥΝΟΥ	ΣΥΝΟΛΙΚΟΣ ΠΟΛΛΑΠΛΑΣΙΑΣΤΙΚΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ (mc) Χ ΜΕΣΟΣ ΟΡΟΣ ΔΥΝΗΤΙΚΗΣ ΖΗΜΙΑΣ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΩΝ 60 ΕΡΓΑΣΙΜΩΝ ΗΜΕΡΩΝ (VaRavg)	ΔΥΝΗΤΙΚΗ ΖΗΜΙΑ (VaRt-1) ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΗΣ ΗΜΕΡΑΣ	ΣΥΝΟΛΙΚΟΣ ΠΟΛΛΑΠΛΑΣΙΑΣΤΙΚΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ (ms) Χ ΜΕΣΟΣ ΟΡΟΣ ΔΥΝΗΤΙΚΗΣ ΖΗΜΙΑΣ ΥΠΟ ΑΚΡΑΙΕΣ ΣΥΝΘΗΚΕΣ ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΩΝ 60 ΕΡΓΑΣΙΜΩΝ ΗΜΕΡΩΝ (SVaRavg)	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑ ΔΙΑΘΕΣΙΜΗ ΜΕΤΡΗΣΗ ΔΥΝΗΤΙΚΗ ΖΗΜΙΑ (SVaRt-1)	ΜΕΣΟΣ ΟΡΟΣ ΜΕΤΡΗΣΕΩΝ ΣΕ ΔΙΑΣΤΗΜΑ 12 ΕΒΔΟΜΑΔΩΝ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑ (ΠΙΟ ΠΡΟΣΦΑΤΗ) ΜΕΤΡΗΣΗ	ΕΛΑΧΙΣΤΟ ΠΟΣΟ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΗΣ ΑΠΑΙΤΗΣΗΣ (FLOOR)	ΜΕΣΟΣ ΟΡΟΣ ΜΕΤΡΗΣΕΩΝ ΣΕ ΔΙΑΣΤΗΜΑ 12 ΕΒΔΟΜΑΔΩΝ	ΤΕΛΕΥΤΑΙΑ (ΠΙΟ ΠΡΟΣΦΑΤΗ) ΜΕΤΡΗΣΗ	ΠΡΟΣΘΕΤΗ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΗ ΑΠΑΙΤΗΣΗ (ΑΣΚΗΣΗΣ ΠΡΟΣΟΜΟΙΩΣΗΣ ΑΚΡΑΙΩΝ ΚΑΤΑΣΤΑΣΕΩΝ-STRESS TEST)		Αριθμός υπερβάσεων κατά τις προηγούμενες 250 εργάσιμες ημέρες	VaR ΠΟΛΛΑΠΛΑΣΙΑΣΤΙΚΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ (mc)	SVaR ΠΟΛΛΑΠΛΑΣΙΑΣΤΙΚΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ (ms)	ΣΥΝΟΛΙΚΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ ΓΙΑ ΕΙΔΙΚΟ ΚΙΝΔΥΝΟ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΘΕΤΙΚΩΝ ΘΕΣΕΩΝ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΣΥΣΧΕΤΙΣΕΩΝ (META CAP)	ΣΥΝΟΛΙΚΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ ΓΙΑ ΕΙΔΙΚΟ ΚΙΝΔΥΝΟ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΑΡΝΗΤΙΚΩΝ ΘΕΣΕΩΝ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΣΥΣΧΕΤΙΣΕΩΝ (META CAP)
		(1)	(2)	(3a)	(3b)	(4a)	(4b)	(4c)	(4d)	(4e)	(4f)	(5)	(6)	(7a)	(7b)	(8)	(9)
	ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ											ΣΥΝΔΕΣΗ ΜΕ ΥΠΟΔ.Β02					
19.1	Χρεωστικοί τίτλοι και παράγωγα επί χρεωστικών τίτλων, επιτοκίων και συναλλάγματος																
19.1.1	Γενικός κίνδυνος																
19.1.2	Ειδικός κίνδυνος																
19.2	Μετοχές και παράγωγα επί μετοχών και δεικτών μετοχών																
19.2.1	Γενικός κίνδυνος																
19.2.2	Ειδικός κίνδυνος																
19.3	Κίνδυνος τιμών συναλλάγματος																
19.4	Κίνδυνος εμπορευμάτων																
19.5	Σύνολο για γενικό κίνδυνο																
19.6	Σύνολο για ειδικό κίνδυνο																