

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ20: ΣΥΓΚΕΝΤΡΩΤΙΚΟΣ ΠΙΝΑΚΑΣ ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΥ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ ΓΙΑ ΤΟΝ ΚΙΝΔΥΝΟ ΑΓΟΡΑΣ

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)			
Κωδικός	Περιγραφή	Συσχετιζόμενος πίνακας	Ποσό
20.1	ΕΝΑΝΤΙ ΕΙΔΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΥΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ	Δ01	
20.2	ΕΝΑΝΤΙ ΓΕΝΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΥΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ ΣΕ ΣΥΝΑΡΤΗΣΗ ΜΕ ΤΗ ΛΗΚΤΟΤΗΤΑ	Δ03	
20.3	ΕΝΑΝΤΙ ΓΕΝΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΙΜΟΥΣ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ ΣΕ ΣΥΝΑΡΤΗΣΗ ΜΕ ΤΟ ΜΕΣΟ ΣΤΑΘΜΙΚΟ ΔΕΙΚΤΗ ΔΙΑΡΚΕΙΑΣ	Δ05	
20.4	ΕΝΑΝΤΙ ΓΕΝΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ	Δ07	
20.5	ΕΝΑΝΤΙ ΕΙΔΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΜΕΤΟΧΕΣ	Δ07	
20.6	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ ΣΕ ΟΣΕ, HEDGE FUNDS & ΔΟΜΗΜΕΝΑ ΠΡΟΙΟΝΤΑ, GAMMA & VEGA ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΚΑΙ ΠΕΡΙΘΩΡΙΑ ΕΓΓΥΗΣΗΣ ΣΕ ΠΑΡΑΓΩΓΑ	Δ09	
20.7	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ / ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ ΓΙΑ ΤΙΣ ΑΤΕΛΕΙΣ ΣΥΝΑΛΛΑΓΕΣ	Δ10	
20.8	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΔΙΑΚΑΝΟΝΙΣΜΟΥ / ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ ΓΙΑ ΧΡΕΩΣΤΙΚΟΥΣ ΤΙΤΛΟΥΣ, ΜΕΤΟΧΕΣ, ΞΕΝΑ ΝΟΜΙΣΜΑΤΑ, ΒΑΣΙΚΑ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΑ ΓΙΑ ΤΟ ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ ΣΤΟ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ	Δ11	
20.9	ΕΝΑΝΤΙ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΑΝΤΙΣΥΜΒΑΛΛΟΜΕΝΟΥ		
20.10	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΤΙΜΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΜΑΤΟΣ	Δ12	
20.11	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΒΑΣΙΚΟΥ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΟΣ - ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ ΠΙΝΑΚΑ ΛΗΚΤΟΤΗΤΩΝ	Δ15	
20.12	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΒΑΣΙΚΟΥ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΟΣ - ΔΙΕΥΡΥΜΕΝΗ ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ ΠΙΝΑΚΑ ΛΗΚΤΟΤΗΤΩΝ	Δ16	
20.13	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΒΑΣΙΚΟΥ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΟΣ - ΑΠΛΟΥΣΤΕΥΜΕΝΗ ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ	Δ17	
20.14	ΕΝΑΝΤΙ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΑΠΟ ΥΠΕΡΒΑΣΕΙΣ ΟΡΙΩΝ Μ.Χ.Α.	Δ18	
20.15	ΕΝΑΝΤΙ ΓΕΝΙΚΟΥ & ΕΙΔΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΘΕΣΗΣ & ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΤΙΜΩΝ ΣΥΝΑΛΛΑΓΜΑΤΟΣ, ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΕΜΠΟΡΕΥΜΑΤΟΣ - ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΕΝΟΥ ΜΕ ΕΣΩΤΕΡΙΚΟ ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ	Δ19	
20.16	ΕΝΑΝΤΙ ΕΙΔΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΣΕ ΤΙΤΛΟΠΟΙΗΣΕΙΣ	Δ29	
20.17	ΕΝΑΝΤΙ ΕΙΔΙΚΟΥ ΚΙΝΔΥΝΟΥ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΣΥΣΧΕΤΙΣΕΩΝ	Δ30	
Δ20	ΣΥΝΟΛΟ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ ΓΙΑ ΤΟΝ ΚΙΝΔΥΝΟ ΑΓΟΡΑΣ:		