ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ30: ΥΠΟΛΟΓΙΣΜΟΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΩΝ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ ΓΙΑ ΤΟΝ ΕΙΔΙΚΟ ΚΙΝΔΥΝΟ ΑΠΟ ΘΕΣΕΙΣ ΤΟΥ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟΥ ΔΙΑΠΡΑΓΜΑΤΕΥΣΗΣ ΣΥΣΧΕΤΙΣΕΩΝ

Κωδικός	Περιγραφή	ΣΥΝΟΛΟ ΘΕΣΕΩΝ		(-) ΘΕΣΕΙΣ ΠΟΥ ΑΦΑΙΡΟΥΝΤΑΙ ΑΠΟ ΤΑ ΕΠΟΠΤΙΚΑ ΚΕΦΑΛΑΙΑ		ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΣΕΙΣ		ΚΑΤΑΝΟΜΗ ΤΗΣ ΑΞΙΑΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ ΘΕΤΙΚΩΝ ΘΕΣΕΩΝ (LONG), ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΩΝ ΣΕ ΣΤΑΘΜΙΣΗ ΚΙΝΔΥΝΟΥ, ΣΥΜΦΩΝΑ ΜΕ ΤΟΥΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ ΤΥΠΟΠΟΙΗΜΕΝΗΣ & ΠΕΔ																ΚΑΤΑΝΟ
								ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ < 1250%										1250%		ΜΕΘΟΔΟΣ ΕΠΟΠΤΙΚΟΥ ΥΠΟΔΕΙΓΜΑΤΟΣ		ΕΞΕΤΑΣΗ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ (LOOK-THROUGH)	ΜΕΘΟΔΟΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ			
		ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	ΘΕΤΙΚΗ (LONG)	ΑΡΝΗΤΙΚΗ (SHORT)	7 - 10%	12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	ΑΛΛΟΙ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ	ΔΙΑΒΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ	ΜΗ ΔΙΑΒΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ		ΜΕΣΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)			ΜΕΣΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)	7 - 10%
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(23)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)	(21)	(22)	(24)
Δ30	ΣΥΝΟΛΟ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ																								
Δ30.1	ΜΕΤΑΒΙΒΑΖΟΝ Π.Ι.: ΣΥΝΟΛΟ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ																								
Δ30.1.1	Θέσεις σε Τιτλοποίηση																								
Δ30.1.2	Άλλες θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων																								
Δ30.2	ΕΠΕΝΔΥΤΕΣ: ΣΥΝΟΛΟ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ																								
Δ30.2.1	Θέσεις σε Τιτλοποίηση																								
Δ30.2.2	Άλλες θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων																								
Δ30.3	ΑΝΑΔΟΧΟΣ: ΣΥΝΟΛΟ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ																								
Δ30.3.1	Θέσεις σε Τιτλοποίηση																								
Δ30.3.2	Άλλες θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων																								
Δ30.4	Θέσεις σε Πιστωτικά Παράγωγα Νιοστής Αθέτησης																								
Δ30.5	Λοιπές θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων που δεν περιλαμβάνονται στις προηγούμενες κατηγορίες																								

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Περιγραφή	ΟΜΗ ΤΗΣ ΑΞΙΑΣ ΤΩΝ ΚΑΘΑΡΩΝ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ ΑΡΝΗΤΙΚΩΝ ΘΕΣΕΩΝ (SHORT), ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΩΝ ΣΕ ΣΤΑΘΜΙΣΗ ΚΙΝΔΥΝΟΥ, ΣΥΜΦΩΝΑ ΜΕ ΤΟΥΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ ΤΥΠΟΠΟΙΗΜΕΝΗΣ Ε ΠΕΔ																ΠΡΙΝ ΤΗΝ ΕΦΑΡΜΟΓΗ ΤΟΥ ΑΝΩΤΑΤΟΥ ΣΤΑΘΜΙΣΜΕΝΟΥ ΠΟΣΟΥ ΑΝΟΙΓΜΑΤΟΣ (CAP)		ΜΕΤΑ ΤΗΝ ΕΦΑΡΜΟΓΗ ΤΟΥ ΑΝΩΤΑΤΟΥ ΣΤΑΘΜΙΣΜΕΝΟΥ ΠΟΣΟΥ ΑΝΟΙΓΜΑΤΟΣ (CAP)		ΣΥΝΟΛΙΚΕΣ ΚΕΦΑΛΑΙΑΚΕΣ ΑΠΑΙΤΗΣΕΙΣ
		ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ < 1250%									1250%		ΜΕΘΟΔΟΣ ΕΠΟΠΤΙΚΟΥ ΥΠΟΔΕΙΓΜΑΤΟΣ		ΕΞΕΤΑΣΗ ΥΠΟΚΕΙΜΕΝΩΝ ΕΠΕΝΔΥΣΕΩΝ (LOOK-THROUGH)	ΜΕΘΟΔΟΣ ΕΣΩΤΕΡΙΚΗΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ							
		12 - 18%	20 - 35%	40 - 75%	100%	250%	350%	425%	650%	ΑΛΛΟΙ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΕΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ	ΔΙΑΒΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ	ΜΗ ΔΙΑΒΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ		ΜΕΣΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)			ΜΕΣΟΣ ΣΥΝΤΕΛΕΣΤΗΣ ΣΤΑΘΜΙΣΗΣ (%)	ΣΤΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΤΙΚΕΣ ΘΕΣΕΙΣ (LONG)	ΣΤΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ ΚΑΘΑΡΕΣ ΑΡΝΗΤΙΚΕΣ ΘΕΣΕΙΣ (SHORT)	ΣΤΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ ΚΑΘΑΡΕΣ ΘΕΤΙΚΕΣ ΘΕΣΕΙΣ (LONG)	ΣΤΑΘΜΙΣΜΕΝΕΣ ΚΑΘΑΡΕΣ ΑΡΝΗΤΙΚΕΣ ΘΕΣΕΙΣ (SHORT)	
		(25)	(26)	(27)	(28)	(29)	(30)	(31)	(32)	(40)	(33)	(34)	(35)	(36)	(37)	(38)	(39)	(41)	(42)	(43)	(44)	(45)
Δ30	ΣΥΝΟΛΟ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ																					ΣΥΝΔΕΣΗ ΜΕ ΥΠΟΔ. B02
Δ30.1	ΜΕΤΑΒΙΒΑΖΟΝ Π.Ι.: ΣΥΝΟΛΟ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ																					
Δ30.1.1	Θέσεις σε Τιτλοποίηση																					
Δ30.1.2	Άλλες θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων																					
Δ30.2	ΕΠΕΝΔΥΤΕΣ: ΣΥΝΟΛΟ ΑΝΟΙΓΜΑΤΩΝ																					
Δ30.2.1	Θέσεις σε Τιτλοποίηση																					
Δ30.2.2	Άλλες θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων																					
Δ30.3	ΑΝΑΔΟΧΟΣ: ΣΥΝΟΛΟ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ																					
Δ30.3.1	Θέσεις σε Τιτλοποίηση																					
Δ30.3.2	Άλλες θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων																					
Δ30.4	Θέσεις σε Πιστωτικά Παράγωγα Νιοστής Αθέτησης																					
Δ30.5	Λοιπές θέσεις του Χαρτοφυλακίου Διαπραγμάτευσης Συσχετίσεων που δεν περιλαμβάνονται στις προηγούμενες κατηγορίες																					