

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Δ35: ΑΝΑΛΥΣΗ ΕΥΑΙΣΘΗΣΙΑΣ ΧΡΕΟΓΡΑΦΩΝ ΚΑΙ ΠΑΡΑΓΩΓΩΝ

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

ΚΩΔΙΚΟΣ	ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ*	ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΣΥΝΑΛΛΑΓΩΝ			ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΘΕΣΕΩΝ ΑΡΧΙΚΑ ΑΝΑΓΝΩΡΙΖΟΜΕΝΩΝ ΣΤΗΝ ΕΥΛΟΓΗ ΑΞΙΑ ΜΕΣΩ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΩΝ			ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΔΙΑΘΕΣΙΜΟ ΠΡΟΣ ΠΩΛΗΣΗ			ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΔΑΝΕΙΩΝ ΚΑΙ ΑΠΑΙΤΗΣΕΩΝ ΑΠΟΤΙΜΩΜΕΝΩΝ ΣΤΟ ΑΠΟΣΒΕΣΙΜΟ ΚΟΣΤΟΣ			ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ ΔΙΑΚΡΑΤΟΥΜΕΝΟ ΣΤΗ ΛΗΞΗ			ΣΥΝΟΛΙΚΟ ΧΑΡΤΟΦΥΛΑΚΙΟ		
		ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ	ΡΝΟ1 (κίνδυνος επιτοκίου)	CSO1 (κίνδυνος πιστωτικού περιθωρίου)	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ	ΡΝΟ1 (κίνδυνος επιτοκίου)	CSO1 (κίνδυνος πιστωτικού περιθωρίου)	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ	ΡΝΟ1 (κίνδυνος επιτοκίου)	CSO1 (κίνδυνος πιστωτικού περιθωρίου)	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ	ΡΝΟ1 (κίνδυνος επιτοκίου)	CSO1 (κίνδυνος πιστωτικού περιθωρίου)	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ	ΡΝΟ1 (κίνδυνος επιτοκίου)	CSO1 (κίνδυνος πιστωτικού περιθωρίου)	ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΑΞΙΑ	ΡΝΟ1 (κίνδυνος επιτοκίου)	CSO1 (κίνδυνος πιστωτικού περιθωρίου)
(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)	(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)	(19)	(20)
1	ΧΡΕΟΓΡΑΦΑ																		
1.1	Ομόλογα Ελληνικού Δημοσίου																		
1.1.1	εκ των οποίων: Έντοκα Γραμμάτια Δημοσίου																		
1.2	Κρατικοί τίτλοι εκδόσεως κυβερνήσεων και Κεντρικών Τραπεζών άλλων χωρών εκτός του Ελληνικού Δημοσίου																		
1.3	Λοιποί Τίτλοι (Τίτλοι εκδόσεως υπερεθνικών οργανισμών, Εταιρικά Ομόλογα, Ομόλογα Χρηματοπιστωτικού τομέα, Λοιπά Ομόλογα)																		
2	ΕΠΙΤΟΚΙΑΚΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΚΑΙ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΓΙΑ ΣΚΟΠΟΥΣ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗΣ ΑΝΤΙΣΤΑΘΜΙΣΗΣ																		
2.1	Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης (futures) και Προθεσμιακές συμβάσεις (forwards)																		
2.2	Δικαιώματα προαίρεσης (options)																		
2.3	Συμβάσεις ανταλλαγής (swaps)																		
2.4	Λοιπά Επιτοκιακά παράγωγα																		
2.5	Πιστωτικά Παράγωγα																		
3	ΕΠΙΤΟΚΙΑΚΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΚΑΙ ΠΙΣΤΩΤΙΚΑ ΠΑΡΑΓΩΓΑ ΓΙΑ ΕΜΠΟΡΙΚΟΥΣ ΣΚΟΠΟΥΣ																		
3.1	Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης (futures) και Προθεσμιακές συμβάσεις (forwards)																		
3.2	Δικαιώματα προαίρεσης (options)																		
3.3	Συμβάσεις ανταλλαγής (swaps)																		
3.4	Λοιπά Επιτοκιακά παράγωγα																		
3.5	Πιστωτικά Παράγωγα																		
4	ΣΥΝΟΛΟ (ΛΑΜΒΑΝΟΝΤΑΣ ΥΠΟΨΗ ΤΗΝ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗ ΑΝΤΙΣΤΑΘΜΙΣΗ) (Γραμμή 1 + 2)																		
5	ΓΕΝΙΚΟ ΣΥΝΟΛΟ (Γραμμή 1 + 2 + 3)																		

Σημείωση:

* Τα στοιχεία συμπληρώνονται με βάση την ημερομηνία συναλλαγής (trade date).