

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ 001: Καλυμμένες ομολογίες και στοιχεία ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας

	Σύνολο εκδόσεων	
I.	Σύνολο στοιχείων ενεργητικού των χαρτοφυλακίων ασφαλείας (ον. αξία)	
II.	Διαθέσιμα Στοιχεία Ενεργητικού σύμφωνα με την παρ. 1(α) του Κεφ. II της ΠΔΤΕ 2620/2009	
III.	Σύνολο στοιχείων ενεργητικού των χαρτοφυλακίων ασφαλείας (ον. αξία) ως ποσοστό των Διαθέσιμων Στοιχείων Ενεργητικού σύμφωνα με την παρ. 1(α) του Κεφ. II της ΠΔΤΕ 2620/2009	I. / II.

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

Κωδικός	Περιγραφή	Όνομαστική αξία	Καθαρή παρούσα αξία	Καθαρή παρούσα αξία με αύξηση επιτοκίων κατά 200 μον. βάσης	Καθαρή παρούσα αξία με μείωση επιτοκίων κατά 200 μον. βάσης	Μέσο σταθμικό επιτόκιο (%)	Αξία υπέγγυων ακινήτων / πλοίων
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
1ο	Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών						
A1.	Στοιχεία ενεργητικού (πλην παραγώγων χρηματοοικονομικών μέσων)						
A1.1	Ανοίγματα έναντι ή καλυπτόμενα από την εγγύηση κεντρικών κυβερνήσεων, κεντρικών τραπεζών, δημοσίων επιχειρήσεων και οργανισμών, περιφερειακών κυβερνήσεων & τοπικών αρχών της ΕΕ						
A1.2	Ανοίγματα έναντι ή ανοίγματα καλυπτόμενα από την εγγύηση, κεντρικών κυβερνήσεων ή κεντρικών τραπεζών εκτός ΕΕ, πολυμερών τραπεζών ανάπτυξης ή διεθνών οργανισμών						
A1.3	Ανοίγματα έναντι ή καλυπτόμενα από την εγγύηση περιφερειακών κυβερνήσεων και τοπικών αρχών, καθώς και δημοσίων επιχειρήσεων και οργανισμών εκτός ΕΕ						
A1.4	Ανοίγματα έναντι πιστωτικών ιδρυμάτων και ΕΠΕΥ						
A1.5	Δάνεια που εξασφαλίζονται με ακίνητα που χρησιμοποιούνται ως κατοικίες						
A1.6	Δάνεια που εξασφαλίζονται με εμπορικά ακίνητα						
A1.7	Δάνεια που εξασφαλίζονται με πλοία						
A1.8	Λοιπά						
B1.	Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα με αντισυμβαλλόμενο						
B1.1	κεντρική κυβέρνηση ή κεντρική τράπεζα κράτους-μέλους της Ε.Ε.						
B1.2	περιφερειακή κυβέρνηση ή τοπική αρχή κράτους-μέλους της Ε.Ε.						
B1.3	διεθνή οργανισμό						
B1.4	Δημόσια Επιχείρηση ή Οργανισμό κράτους-μέλους της Ε.Ε.						
B1.5	πιστωτικό ίδρυμα ή ΕΠΕΥ						
B1.6	κεντρικό σε οργανωμένη αγορά						
A1+B1	Σύνολο στοιχείων ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας (A+B)						
Γ1.	Καλυμμένες ομολογίες						
Δ1.	Υπερεξασφάλιση [(A+B)-Γ]						

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ
ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Θ02: Πίνακας ληκτότητας καλυμμένων ομολογιών και στοιχείων ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

	Στοιχεία ενεργητικού		Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα		Καλυμμένες ομολογίες	
	σε €	σε ξένο νόμισμα	σε €	σε ξένο νόμισμα	σε €	σε ξένο νόμισμα
	(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
1ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών						
≤ 1 χρόνο						
>1 ≤ 5 χρόνια						
>5 ≤ 10 χρόνια						
>10 χρόνια						
Σύνολο 1ης έκδοσης						

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Θ03: Πίνακας ελέγχου (i) της αποτελεσματικότητας της αντιστάθμισης κινδύνων των στοιχείων ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας και (ii) συμφωνίας μεταξύ των εισπρακτέων και πληρωτέων τόκων

		(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)		
Κωδικός	Περιγραφή	Καθαρή παρούσα αξία	(+)Τόκοι εισπρακτέοι	(-)Τόκοι πληρωτέοι
		(1)	(2)	(3)
1ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών				
A1.	Στοιχεία ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας			
B1.	B. Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα που χρησιμοποιούνται για αντιστάθμιση:			
B1.1	Επιτοκιακού κινδύνου			
B1.1.1	Κινδύνου βάσης			
B1.2	Συναλλαγματικού κινδύνου			
B1.3	Κινδύνου ρευστότητας			
(A1+B1)	Σύνολο στοιχείων ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας			
Γ1.	Καλυμμένες ομολογίες			
Δ1.	Βαθμός αποτελεσματικότητας της αντιστάθμισης (>0%)			
Ε1.	Διαφορά τόκων			

ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ
ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

**ΥΠΟΔΕΙΓΜΑ Θ04: Συνολικό ποσό υπερήμερων οφειλών από δάνεια του
χαρτοφυλακίου ασφαλείας**

(ποσό σε χιλιάδες ευρώ)	
1ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 1	
2ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 2	
3ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 3	
4ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 4	
5ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 5	
6ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 6	
7ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 7	
8ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 8	
9ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 9	
10ο Πρόγραμμα Έκδοσης Καλυμμένων Ομολογιών	
Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 10	