



ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΕΥΡΩΣΥΣΤΗΜΑ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ (ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

| | |
|--------------------------------|---------------------------------|
| Κωδικός Πιστωτικού Ιδρύματος : | 011 |
| Πιστωτικό Ίδρυμα : | ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε. |
| Ημερομηνία Στοιχείων : | 31 Mar. 2013 |
| Διορθωτική Αποστολή: | 0 |
| Πλήθος Εκδόσεων: | 2 |
| Υποσύστημα : | BSD19 |
| Έκδοση Υποδείγματος : | 01.00.06 |
| Έκδοση Παραμέτρων : | 1397 |
| Υποβολή στοιχείων σε : | Ατομική βάση |

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

001: Καλυμμένες ομολογίες και στοιχεία ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας

Υποβολή σε Ατομική βάση

| | |
|--------------------------------|---------------------------------|
| Κωδικός Πιστωτικού Ιδρύματος : | 011 |
| Πιστωτικό Ίδρυμα : | ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε. |
| Ημερομηνία Στοιχείων : | 31 Mar. 2013 |
| Αρμόδιος Υπάλληλος : | KATERINA ARVANITI |
| Αριθμός Τηλεφώνου : | 210-3342338 |
| Ημερομηνία Συμπλήρωσης : | 11 Apr. 2013 |
| Διορθωτική Αποστολή: | 0 |
| Υποσύστημα : | BSD19 |
| Έκδοση Υποδείγματος : | 01.00.06 |

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

| Κωδικός | Περιγραφή | Ονομαστική 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) |
| Σύνολο εκδόσεων | | | | | | | |
| Σ1 | Σύνολο στοιχείων ενεργητικού των χαρτοφυλακίων ασφαλείας | 11,037,155.37 | | | | | |
| Σ2 | Διαθέσιμα Στοιχεία Ενεργητικού σύμφωνα με την παρ. 1(α) του Κεφ. ΙΙ της ΠΔΤΕ 2620/2009 | 19,270,371.45 | | | | | |
| Σ3 | Σύνολο στοιχείων ενεργητικού των χαρτοφυλακίων ασφαλείας (ον. αξία) ως ποσοστό (%) των Διαθέσιμων Στοιχείων Ενεργητικού σύμφωνα με την παρ. 1(α) του Κεφ. ΙΙ της ΠΔΤΕ 2620/2009 | 0.57 | | | | | |
| 1η Έκδοση | | | | | | | |

| | | | | | | | |
|------------------|--|---------------------|----------------------|----------------------|----------------------|--------------|----------------------|
| A1. | Στοιχεία ενεργητικού (πλην παραγώγων χρηματοοικονομικών μέσων) | 1,793,294.37 | 2,157,788.97 | 2,108,708.99 | 2,211,617.35 | 2.77% | 4,552,885.65 |
| 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 | 1,793,294.37 | 2,157,788.97 | 2,108,708.99 | 2,211,617.35 | 2.77% | 4,552,885.65 |
| A1.6 | Δάνεια που εξασφαλίζονται με εμπορικά ακίνητα | | | | | | |
| A1.7 | Δάνεια που εξασφαλίζονται με πλοία | | | | | | |
| A1.8 | Λοιπά | | | | | | |
| B1. | Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα με αντισυμβαλλόμενο | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | | |
| 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) | 1,793,294.37 | 2,157,788.97 | 2,108,708.99 | 2,211,617.35 | 2.77% | |
| Γ1. | Καλυμμένες ομολογίες | 846,200.00 | 955,259.40 | 894,040.07 | 977,271.16 | 3.88% | |
| Δ1. | Υπερεξασφάλιση [(A+B)-Γ] | 947,094.37 | 1,202,529.57 | 1,214,668.92 | 1,234,346.19 | | |
| 2η Έκδοση | | | | | | | |
| A2. | Στοιχεία ενεργητικού (πλην παραγώγων χρηματοοικονομικών μέσων) | 9,243,861.00 | 11,612,642.46 | 11,173,913.74 | 12,059,498.73 | 3.20% | 25,193,241.31 |
| A2.1 | Ανοίγματα έναντι ή καλυπτόμενα από την εγγύηση κεντρικών κυβερνήσεων, κεντρικών τραπεζών, δημοσίων επιχειρήσεων και οργανισμών, περιφερειακών κυβερνήσεων & τοπικών αρχών της ΕΕ | | | | | | |
| A2.2 | Ανοίγματα έναντι ή ανοίγματα καλυπτόμενα από την εγγύηση, κεντρικών κυβερνήσεων ή κεντρικών τραπεζών εκτός ΕΕ, πολυμερών τραπεζών ανάπτυξης ή διεθνών οργανισμών | | | | | | |
| A2.3 | Ανοίγματα έναντι ή καλυπτόμενα από την εγγύηση περιφερειακών κυβερνήσεων και τοπικών αρχών, καθώς και δημοσίων επιχειρήσεων και οργανισμών εκτός ΕΕ | | | | | | |
| A2.4 | Ανοίγματα έναντι πιστωτικών ιδρυμάτων και ΕΠΕΥ | | | | | | |
| A2.5 | Δάνεια που εξασφαλίζονται με ακίνητα που χρησιμοποιούνται ως κατοικίες | 9,243,861.00 | 11,612,642.46 | 11,173,913.74 | 12,059,498.73 | 3.20% | 25,193,241.31 |
| A2.6 | Δάνεια που εξασφαλίζονται με εμπορικά ακίνητα | | | | | | |
| A2.7 | Δάνεια που εξασφαλίζονται με πλοία | | | | | | |
| A2.8 | Λοιπά | | | | | | |
| B2. | Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα με αντισυμβαλλόμενο | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | | |
| B2.1 | κεντρική κυβέρνηση ή κεντρική τράπεζα κράτους-μέλους της Ε.Ε. | | | | | | |
| B2.2 | περιφερειακή κυβέρνηση ή τοπική αρχή κράτους-μέλους της Ε.Ε. | | | | | | |
| B2.3 | διεθνή οργανισμό | | | | | | |
| B2.4 | Δημόσια Επιχείρηση ή Οργανισμό κράτους-μέλους της Ε.Ε. | | | | | | |
| B2.5 | πιστωτικό ίδρυμα ή ΕΠΕΥ | | | | | | |
| B2.6 | κεντρικό σε οργανωμένη αγορά | | | | | | |
| A2+B2 | Σύνολο στοιχείων ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας (A+B) | 9,243,861.00 | 11,612,642.46 | 11,173,913.74 | 12,059,498.73 | 3.20% | |
| Γ2. | Καλυμμένες ομολογίες | 8,400,000.00 | 8,963,379.29 | 8,934,960.47 | 9,008,830.28 | 2.89% | |
| Δ2. | Υπερεξασφάλιση [(A+B)-Γ] | 843,861.00 | 2,649,263.17 | 2,238,953.27 | 3,050,668.45 | | |



ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΕΥΡΩΣΥΣΤΗΜΑ
ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

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

Υποβολή σε Ατομική βάση

| | |
|--------------------------------|---------------------------------|
| Κωδικός Πιστωτικού Ιδρύματος : | 011 |
| Πιστωτικό Ίδρυμα : | ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε. |
| Ημερομηνία Στοιχείων : | 31 Mar. 2013 |
| Αρμόδιος Υπάλληλος : | KATERINA ARVANITI |
| Αριθμός Τηλεφώνου : | 210-3342338 |
| Ημερομηνία Συμπλήρωσης : | 11 Apr. 2013 |
| Διορθωτική Αποστολή : | 0 |
| Υποσύστημα : | BSD19 |
| Έκδοση Υποδείγματος : | 01.00.06 |

(ποσά σε χιλιάδες ευρώ)

| | Στοιχεία ενεργητικού | | Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα | | Καλυμμένες ομολογίες | |
|------------------|----------------------|------------------------|---------------------------------|------------------------|----------------------|------------------------|
| | σε € (1) | σε ξένο νόμισμα (2) | σε € (3) | σε ξένο νόμισμα (4) | σε € (5) | σε ξένο νόμισμα (6) |
| 1η Έκδοση | | | | | | |
| ≤ 1 χρόνο | 103,752.74 | | | | 0.00 | |
| >1 ≤ 5 χρόνια | 399,950.67 | | | | 846,200.00 | |
| >5 ≤ 10 χρόνια | 405,746.56 | | | | 0.00 | |
| >10 χρόνια | 919,271.53 | | | | 0.00 | |
| Σύνολα 1 | 1,828,721.50 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 846,200.00 | 0.00 |
| 2η Έκδοση | | | | | | |
| ≤ 1 χρόνο | 592,867.51 | 12,691.55 | | | 1,500,000.00 | |
| >1 ≤ 5 χρόνια | 2,215,360.41 | 53,305.39 | | | 4,300,000.00 | |
| >5 ≤ 10 χρόνια | 2,031,016.35 | 60,981.32 | | | 2,600,000.00 | |
| >10 χρόνια | 4,377,527.64 | 197,202.35 | | | 0.00 | |
| Σύνολα 2 | 9,216,771.91 | 324,180.61 | 0.00 | 0.00 | 8,400,000.00 | 0.00 |



ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΕΥΡΩΣΥΣΤΗΜΑ

ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

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

Υποβολή σε Ατομική βάση

| | |
|--------------------------------|---------------------------------|
| Κωδικός Πιστωτικού Ιδρύματος : | 011 |
| Πιστωτικό Ίδρυμα : | ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε. |
| Ημερομηνία Στοιχείων : | 31 Mar. 2013 |
| Αρμόδιος Υπάλληλος : | KATERINA ARVANITI |
| Αριθμός Τηλεφώνου : | 210-3342338 |
| Ημερομηνία Συμπλήρωσης : | 11 Apr. 2013 |
| Διορθωτική Αποστολή: | 0 |
| Υποσύστημα : | BSD19 |
| Έκδοση Υποδείγματος : | 01.00.06 |

| Κωδικός | Περιγραφή | (ποσά σε χιλιάδες ευρώ) | | |
|------------------|---|----------------------------|-----------------------------|---------------------------|
| | | Καθαρή παρούσα αξία (1) | (+)Τόκοι εισπρακτέοι (2) | (-)Τόκοι πληρωτέοι (3) |
| 1η Έκδοση | | | | |
| A1. | Στοιχεία ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας | 2,157,788.97 | 43,354.16 | |
| B1. | B. Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα που χρησιμοποιούνται για αντιστάθμιση: | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 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 | 2,157,788.97 | 43,354.16 | 0.00 |
| Γ1. | Καλυμμένες ομολογίες | 955,259.40 | | 32,790.25 |
| Δ1. | Βαθμός αποτελεσματικότητας της αντιστάθμισης (>0%) | | | |
| Ε1. | Διαφορά τόκων | | 10,563.91 | |
| 2η Έκδοση | | | | |
| A2. | Στοιχεία ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας | 11,612,642.46 | 277,560.40 | |
| B2. | B. Παράγωγα χρηματοοικονομικά μέσα που χρησιμοποιούνται για αντιστάθμιση: | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| B2.1 | Επιτοκιακού κινδύνου | | | |
| B2.1.1 | Κινδύνου βάσης | | | |
| B2.2 | Συναλλαγματικού κινδύνου | | | |
| B2.3 | Κινδύνου ρευστότητας | | | |
| (A2+B2) | Σύνολο στοιχείων ενεργητικού του χαρτοφυλακίου ασφαλείας | 11,612,642.46 | 277,560.40 | 0.00 |
| Γ2. | Καλυμμένες ομολογίες | 8,963,379.29 | | 197,568.06 |
| Δ2. | Βαθμός αποτελεσματικότητας της αντιστάθμισης (>0%) | | | |
| Ε2. | Διαφορά τόκων | | 79,992.34 | |



ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ
ΕΥΡΩΣΥΣΤΗΜΑ
ΔΙΕΥΘΥΝΣΗ ΕΠΟΠΤΕΙΑΣ ΠΙΣΤΩΤΙΚΟΥ ΣΥΣΤΗΜΑΤΟΣ

ΚΑΛΥΜΜΕΝΕΣ ΟΜΟΛΟΓΙΕΣ

Θ04: Συνολικό ποσό υπερήμερων οφειλών από δάνεια του χαρτοφυλακίου ασφαλείας

Υποβολή σε Ατομική βάση

| | |
|--------------------------------|---------------------------------|
| Κωδικός Πιστωτικού Ιδρύματος : | 011 |
| Πιστωτικό Ίδρυμα : | ΕΘΝΙΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε. |
| Ημερομηνία Στοιχείων : | 31 Mar. 2013 |
| Αρμόδιος Υπάλληλος : | KATERINA ARVANITI |
| Αριθμός Τηλεφώνου : | 210-3342338 |
| Ημερομηνία Συμπλήρωσης : | 11 Apr. 2013 |
| Διορθωτική Αποστολή: | 0 |
| Υποσύστημα : | BSD19 |
| Έκδοση Υποδείγματος : | 01.00.06 |

(ποσό σε χιλιάδες ευρώ)

| | 1η Έκδοση | |
|----|--------------------------------------|------|
| 1 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 1 | 0.00 |
| | 2η Έκδοση | |
| 2 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 2 | 0.00 |
| | 3η Έκδοση | |
| 3 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 3 | |
| | 4η Έκδοση | |
| 4 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 4 | |
| | 5η Έκδοση | |
| 5 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 5 | |
| | 6η Έκδοση | |
| 6 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 6 | |
| | 7η Έκδοση | |
| 7 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 7 | |
| | 8η Έκδοση | |
| 8 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 8 | |
| | 9η Έκδοση | |
| 9 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 9 | |
| | 10η Έκδοση | |
| 10 | Οφειλές δανείων άνω των 90 ημερών 10 | |