

Anexo I – Método Padrão

a) Curto Prazo

Grau da qualidade do crédito	ECAI		
	Fitch	Moody's	S&P
1	F1+, F1	P-1	A-1+, A-1
2	F2	P-2	A-2
3	F3	P-3	A-3
4 a 6	<i>Inferior a F3</i>	NP	<i>Inferior a A-3</i>

b) Longo Prazo

Grau da qualidade do crédito	ECAI		
	Fitch	Moody's	S&P
1	AAA a AA-	Aaa a Aa3	AAA a AA-
2	A+ a A-	A1 a A3	A+ a A-
3	BBB+ a BBB-	Baa1 a Baa3	BBB+ a BBB-
4	BB+ a BB-	Ba1 a Ba3	BB+ a BB-
5	B+ a B-	B1 a B3	B+ a B-
6	<i>Inferior a B-</i>	<i>Inferior a B3</i>	<i>Inferior a B-</i>

Anexo II – Posições de titularização – método Padrão

a) Curto Prazo

Grau da qualidade do crédito	ECAI		
	Fitch	Moody's	S&P
1	F1+, F1	P-1	A-1+, A-1
2	F2	P-2	A-2
3	F3	P-3	A-3
<i>Todas as outras notações</i>	<i>Inferior a F3</i>	NP	<i>Inferior a A-3</i>

b) Longo Prazo

Grau da qualidade do crédito	ECAI		
	Fitch	Moody's	S&P
1	AAA a AA-	Aaa a Aa3	AAA a AA-
2	A+ a A-	A1 a A3	A+ a A-
3	BBB+ a BBB-	Baa1 a Baa3	BBB+ a BBB-
4	BB+ a BB-	Ba1 a Ba3	BB+ a BB-
<i>5 e níveis inferiores</i>	<i>Inferior a BB-</i>	<i>Inferior a Ba3</i>	<i>Inferior a BB-</i>

Anexo à Instrução do Banco de Portugal n.º 10/2007

Anexo III – Posições de titularização – método Baseado em Notações

a) Curto Prazo

Grau da qualidade do crédito	ECAI		
	Fitch	Moody's	S&P
1	F1+, F1	P-1	A-1+, A-1
2	F2	P-2	A-2
3	F3	P-3	A-3
<i>Todas as outras notações</i>	<i>Inferior a F3</i>	<i>Inferior a P-3</i>	<i>Inferior a A-3</i>

b) Longo Prazo

Grau da qualidade do crédito	ECAI		
	Fitch	Moody's	S&P
1	AAA	Aaa	AAA
2	AA	Aa	AA
3	A+	A1	A+
4	A	A2	A
5	A-	A3	A-
6	BBB+	Baa1	BBB+
7	BBB	Baa2	BBB
8	BBB-	Baa3	BBB-
9	BB+	Ba1	BB+
10	BB	Ba2	BB
11	BB-	Ba3	BB-
<i>Inferior a 11</i>	<i>Inferior a BB-</i>	<i>Inferior a Ba3</i>	<i>Inferior a BB-</i>

Anexo IV – Organismos de Investimento Colectivo (OIC)

Grau da qualidade do crédito	ECAI			
	Fitch	Moody's	S&P	
			Notações sobre a estabilidade do valor dos fundos	Notações sobre a qualidade do crédito
1	AAA a AA-	Aaa a Aa3	AAA _m a AA _{-m}	AAA _f a AA _{-f}
2	A+ a A-	A1 a A3	A _{+m} a A _{-m}	A _{+f} a A _{-f}
3	BBB+ a BBB-	Baa1 a Baa3	BBB _{+m} a BBB _{-m}	BBB _{+f} a BBB _{-f}
4	BB+ a BB-	Ba1 a Ba3	BB _{+m} a BB _{-m}	BB _{+f} a BB _{-f}
5	B+ a B-	B1 a B3	B _{+m} a B _{-m}	B _{+f} a B _{-f}
6	<i>Inferior a B-</i>	<i>Inferior a B3</i>	<i>Inferior a B-m</i>	<i>Inferior a B-f</i>