

ÍNDICE DE MODELOS

MODELO LM01 - Cálculo dos limites para efeitos do método a utilizar na determinação dos requisitos de fundos próprios da carteira de negociação.

MODELO RF01 - Requisitos mínimos de fundos próprios para instituições de crédito, SICAM e sucursais de instituições de crédito com sede em países terceiros.

MODELO RF02 - Requisitos mínimos de fundos próprios para sociedades financeiras e sucursais de outras empresas de países terceiros.

MODELO FP01 - Fundos próprios.

MODELO FP02 - Cálculo dos fundos próprios para cobertura dos riscos da carteira de negociação e para riscos cambiais.

MODELO RS01 - Fundos próprios exigidos pelo Aviso nº 1/93:

Parte I - Ponderação do activo;

Parte II - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais;

Parte IIIA1 - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a contratos sobre taxas de juro (Método de avaliação ao preço de mercado);

Parte IIIA2 - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a contratos sobre taxas de câmbio e ouro (Método de avaliação ao preço de mercado);

Parte IIIA3 - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a contratos sobre títulos de capital (Método de avaliação ao preço de mercado);

Parte IIIA4 - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a contratos sobre metais preciosos, com excepção do ouro (Método de avaliação ao preço de mercado);

Parte IIIA5 - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a contratos sobre mercadorias que não sejam metais preciosos (Método de avaliação ao preço de mercado);

Parte IIIB - Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a contratos sobre taxas de juro, taxas de câmbio e ouro (Método de avaliação em função do risco inicial);

Parte IV - Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso nº 1/93.

MODELO ID01 - Instrumentos de dívida - risco específico.

MODELO ID02 - Instrumentos de dívida - risco geral - método de base:

Parte I - Cálculo da posição;

Parte II - Cálculo dos requisitos de fundos próprios.

MODELO ID03 - Instrumentos de dívida - risco geral - método baseado na “duração”:

Parte I - Cálculo da posição;

Parte II - Cálculo dos requisitos de fundos próprios.

MODELO ID04 - Instrumentos de dívida - risco geral - requisitos de fundos próprios por divisas.

MODELO TC01 - Títulos de capital - risco específico e geral.

MODELO RL01 - Risco de liquidação.

MODELO RC01 - Risco de contraparte.

MODELO RX01 - Riscos cambiais:

Parte I - Cálculo das posições;

Parte II - Cálculo dos requisitos de fundos próprios.

MODELO GR01 - Grandes riscos:

Parte I - Riscos não decorrentes da carteira de negociação;
Parte II - Riscos decorrentes da carteira de negociação.

MODELO EC01 - Posições compensadas de entidades incluídas no perímetro de consolidação.

Anexo alterado pela Instrução nº 14/2001, publicada no BNBP nº 6, de 15 de Junho de 2001.