# Anexo à Instrução nº 14/2005

Banco de Portugal
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO GR01-II

## GRANDES RISCOS
## PARTE II
## RISCOS DECORRENTES DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO

(Nº 26-A do Aviso nº 10/94, aditado pelo Aviso nº 9/96)

Instituição: | Base: | Ano: Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

*Valores em Euros*

| | ENTIDADE | GRUPO | VALOR TRANSPORTADO DA COLUNA 11 DA PARTE I (12) | INSTRUMENTOS FINANCEIROS | | | RISCO DE LIQUIDAÇÃO (16) | RISCO DE CONTRAPARTE (17) | TOTAL DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO (18) | TOTAL (19) | ISENÇÕES E REDUÇÕES AOS LIMITES | | | | | | RISCOS SUJEITOS A LIMITE (26) | OBSERVAÇÕES |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | POSIÇÃO LONGA (13) | POSIÇÃO CURTA (14) | EXCEDENTE (15) | | | | | RISCOS A 0% | | | | RISCOS A 20% (24) | RISCOS A 50% (25) | | |
| | | | | | | | | | | | S/ ENTID. INCL. NA SUPERVISÃO BASE CONSOLIDADA (20) | ISENTOS (21) | COBERTOS POR FUNDOS PRÓPRIOS | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | COBERTURA A 100% (22) | COBERTURA A 80% (23) | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | ... | | | | | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | (27) | | | |
| | | | | | | | | | | | | | | | (28) | | | |

| | | |
|---|---|---|
| FUNDOS PRÓPRIOS ELEGÍVEIS | (29) | |
| GRANDE RISCO | (30) | |
| LIMITE À EMPRESA MÃE E FILIAIS | (31) | |
| LIMITE A UMA SÓ ENTIDADE | (32) | |
| LIMITE AGREGADO | (33) | |

| | GRUPO | VALOR TRANSPORTADO DA COLUNA 11 DA PARTE I (12) | INSTRUMENTOS FINANCEIROS | | | RISCO DE LIQUIDAÇÃO (16) | RISCO DE CONTRAPARTE (17) | TOTAL DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO (18) | TOTAL (19) | ISENÇÕES E REDUÇÕES AOS LIMITES | | | | | | RISCOS SUJEITOS A LIMITE (26) | OBSERVAÇÕES |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | POSIÇÃO LONGA (13) | POSIÇÃO CURTA (14) | EXCEDENTE (15) | | | | | RISCOS A 0% | | | | RISCOS A 20% (24) | RISCOS A 50% (25) | | |
| | | | | | | | | | | S/ ENTID. INCL. NA SUPERVISÃO BASE CONSOLIDADA (20) | ISENTOS (21) | COBERTOS POR FUNDOS PRÓPRIOS | | | | | |
| | | | | | | | | | | | | COBERTURA A 100% (22) | COBERTURA A 80% (23) | | | | |
| | ... | | | | | | | | | | | | | | | | |