

## **Anexo à Instrução n.º 23/2007**

### **ÍNDICE DOS MODELOS**

- MODELO LM01 – Cálculo dos limites para efeitos do método a utilizar na determinação dos requisitos de fundos próprios da carteira de negociação.
- MODELO FP01 – Fundos próprios.
- MODELO RF01 – Requisitos mínimos de fundos próprios para instituições de crédito, SICAM, sociedades financeiras e sucursais de instituições de crédito e de outras empresas com sede em países terceiros.
- MODELO RS01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso n.º 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 n.º 1/93.
- MODELO RC MP01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelos Avisos n.º 5/2007 e n.º 8/2007 – Risco de crédito, risco de crédito de contraparte e transacções incompletas - método Padrão.
- MODELO RC IRB01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelos Avisos n.º 5/2007 e n.º 8/2007 – Risco de crédito, risco de crédito de contraparte e transacções incompletas – método das Notações Internas.
- MODELO RC IRB02 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso n.º 5/2007 – Risco de crédito: acções – método das Notações Internas.
- MODELO TIT MPT01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso n.º 7/2007 – Risco de crédito: operações de titularização tradicional - método Padrão.
- MODELO TIT MPS01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso n.º 7/2007 – Risco de crédito: operações de titularização sintética - método Padrão.
- MODELO TIT IRBT01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso n.º 7/2007 – Risco de crédito: operações de titularização tradicional - método das Notações Internas.
- MODELO TIT IRBS01 – Requisitos de fundos próprios exigidos pelo Aviso n.º 7/2007 – Risco de crédito: operações de titularização sintética - método das Notações Internas.
- MODELO RL01 – Risco de liquidação.
- MODELO RC01 – Risco de contraparte.

- MODELO ROP01 – Requisitos de fundos próprios para cobertura de risco operacional exigidos pelo Aviso n.º 9/2007.
- MODELO ROP02 – Risco operacional – Perdas brutas por segmentos de actividade e tipos de eventos de risco operacional.
- MODELO ROP03 – Risco operacional – Principais perdas de risco operacional registadas no último exercício ou em resolução.
- MODELO ID01 – Instrumentos de dívida - risco geral - método baseado no Prazo de Vencimento:  
Parte I - Cálculo da posição;  
Parte II - Cálculo dos requisitos de fundos próprios.
- MODELO ID02 – Instrumentos de dívida - risco geral - método baseado na «Duração»:  
Parte I - Cálculo da posição;  
Parte II - Cálculo dos requisitos de fundos próprios.
- MODELO ID03 – Instrumentos de dívida - risco geral - requisitos de fundos próprios por divisas.
- MODELO ID04 – Instrumentos de dívida – total de posições e de requisitos de fundos próprios para risco geral e risco específico.
- MODELO TC01 – Títulos de capital - risco específico e geral.
- MODELO ME01 – Risco de mercadorias - método Simplificado.
- MODELO ME02 – Risco de mercadorias - método da Escala de Prazos de Vencimento.
- MODELO ME03 – Risco de mercadorias - método da Escala de Prazos de Vencimento – requisitos de fundos próprios por mercadoria.
- MODELO ME04 – Risco de mercadorias – total de posições e de requisitos de fundos próprios.
- MODELO RX01 – Riscos cambiais - Cálculo das posições.
- MODELO RX02 – Riscos cambiais - Cálculo dos requisitos de fundos próprios.
- MODELO MRC MI01 – Riscos de posição, cambiais e de mercadorias - Modelos Internos.
- MODELO MRC MI02 – Detalhes sobre riscos de posição, cambiais e de mercadorias - Modelos Internos.
- MODELO EC01 – Posições compensadas de entidades incluídas no perímetro de consolidação.
- MODELO GR01 – Grandes riscos:  
Parte I - Riscos não decorrentes da carteira de negociação;  
Parte II - Riscos decorrentes da carteira de negociação.

Os modelos RS01 e RC01 só são aplicáveis às instituições que se prevaleçam das opções previstas no n.º 1, do artigo 33.º do Decreto-Lei n.º 104/2007 ou no n.º 1, do artigo 23.º do Decreto-Lei n.º 103/2007.