

Anexo à Instrução n.º 23/2007

<p><b>Banco de Portugal</b> EUROSISTEMA Departamento de Supervisão Bancária</p>	<p><b>REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS</b></p>	<p><b>Modelo RF01</b></p>	
Instituição:	Base:	Ano:	Mês:
<input type="checkbox"/> NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO			
<i>Valores em Euros</i>			
<b>RUBRICAS</b>			
1. Requisitos de fundos próprios (1)			
1.a. Dos quais: Empresas de investimento abrangidas pelo n.º 2 do artigo 10.º do Decreto-Lei n.º 103/2007			
1.1. Requisitos de fundos próprios para risco de crédito, risco de crédito de contraparte e transacções incompletas (2)			
1.1.1. Método Padrão (3)			
1.1.1.1. Classes de risco no Método Padrão excluindo posições de titularização (4)			
1.1.1.1.1. Administrações centrais ou bancos centrais			
1.1.1.1.2. Administrações regionais ou autoridades locais			
1.1.1.1.3. Organismos administrativos e empresas sem fins lucrativos			
1.1.1.1.4. Bancos multilaterais de desenvolvimento			
1.1.1.1.5. Organizações internacionais			
1.1.1.1.6. Instituições			
1.1.1.1.7. Empresas			
1.1.1.1.8. Carteira de retalho			
1.1.1.1.9. Posições com garantia de bens imóveis			
1.1.1.1.10. Elementos vencidos			
1.1.1.1.11. Obrigações hipotecárias ou obrigações sobre o sector público			
1.1.1.1.12. Posições em risco sobre organismos de investimento colectivo (OIC)			
1.1.1.1.13. Outros elementos			
1.1.1.2. Posições de titularização no Método Padrão (5)			
1.1.1.3. (-) Provisões para risco gerais de crédito (6)			
1.1.2. Método das Notações Internas (7)			
1.1.2.1. Método das Notações Internas quando não são utilizadas estimativas próprias de LGD e/ou de factores de conversão (8)			
1.1.2.1.1. Administrações centrais ou bancos centrais			
1.1.2.1.2. Instituições			
1.1.2.1.3. Empresas			
1.1.2.2. Método das Notações Internas quando são utilizadas as estimativas próprias de LGD e/ou de factores de conversão (9)			
1.1.2.2.1. Administrações centrais ou bancos centrais			
1.1.2.2.2. Instituições			
1.1.2.2.3. Empresas			
1.1.2.2.4. Carteira de retalho			
1.1.2.3. Posições sobre acções no Método das Notações Internas (10)			
1.1.2.4. Posições de titularização no Método das Notações Internas (11)			
1.1.2.5. Outras posições que não sejam obrigações de crédito (12)			
1.1.3. Risco de crédito (Aviso n.º 1/93) - derrogação transitória do método padrão (13)			
1.1.4. Transacções incompletas e risco de crédito de contraparte (carteira de negociação) - derrogação transitória (14)			
1.2. Risco de liquidação (15)			
1.3. Requisitos de fundos próprios para riscos de posição, riscos cambiais e riscos de mercadorias (16)			
1.3.1. Riscos de posição, riscos cambiais e riscos de mercadorias - Método Padrão (17)			
1.3.1.1. Instrumentos de dívida (18)			
1.3.1.2. Títulos de capital (19)			
1.3.1.3. Riscos cambiais (20)			
1.3.1.4. Risco de mercadorias (21)			
1.3.2. Riscos de posição, riscos cambiais e riscos de mercadorias - Método dos Modelos Internos (22)			
1.4. Requisitos de fundos próprios para risco operacional (23)			
1.4.1. Método do Indicador Básico (24)			
1.4.2. Método Padrão (25)			
1.4.3. Métodos de Medição Avançada (26)			
1.4.4. (-) Redução dos requisitos de fundos próprios para risco operacional - derrogação transitória do método padrão (27)			
1.5. Requisitos de fundos próprios - Despesas gerais fixas (28)			
1.6. Grandes riscos - Carteira de negociação (29)			
1.7. Requisitos transitórios de fundos próprios ou outros requisitos de fundos próprios (30)			
1.7.1. Acréscimo ao limiar mínimo global de requisitos de fundos próprios (31)			
1.7.2. Outros requisitos de fundos próprios			
2. Por memória:			
2.1. Excesso (+) / Insuficiência (-) de fundos próprios, antes de requisitos transitórios de fundos próprios ou outros requisitos de fundos próprios (32)			
2.1.a. Rácio de Solvabilidade (%), antes de requisitos transitórios de fundos próprios e outros requisitos de fundos próprios (33)			
2.2. Excesso (+) / Insuficiência (-) de fundos próprios (34)			
2.2.a. Rácio de Solvabilidade (%) (35)			