

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Modelo RF01

(1) $1. = [\text{Máximo entre } (1.1. + 1.2. + 1.3.) \text{ e } 1.5.] + 1.4. + 1.6. + 1.7.$

(2) $1.1. = 1.1.1. + 1.1.2. + 1.1.3. + 1.1.4.$

(3) $1.1.1. = 1.1.1.1. + 1.1.1.2. + 1.1.1.3.$

(4) $1.1.1.1. = 1.1.1.1.1. + 1.1.1.1.2. + \dots + 1.1.1.1.12. + 1.1.1.1.13.$

O valor compreendido em cada uma das subrubricas da rubrica 1.1.1.1. corresponde ao total da coluna 22 do Modelo RC MP01 relativo à classe de risco respectiva.

(5) Corresponde ao total da coluna 34 do Modelo TIT MP01.

(6) Parte não elegível como elemento positivo dos fundos próprios nos termos número 9.º-A, do n.º 3.º do Aviso n.º 12/92.

(7) $1.1.2. = 1.1.2.1. + 1.1.2.2. + 1.1.2.3. + 1.1.2.4. + 1.1.2.5.$

(8) $1.1.2.1. = 1.1.2.1.1. + 1.1.2.1.2. + 1.1.2.1.3.$

O valor compreendido em cada uma das subrubricas da rubrica 1.1.2.1. corresponde ao total da coluna 24 do Modelo RC IRB01 relativo à classe de risco respectiva, nos casos em que não são utilizadas estimativas próprias de LGD e/ou factores de conversão.

(9) $1.1.2.2. = 1.1.2.2.1. + 1.1.2.2.2. + 1.1.2.2.3. + 1.1.2.2.4.$

O valor compreendido em cada uma das subrubricas da rubrica 1.1.2.2. corresponde ao total da coluna 24 do Modelo RC IRB01 relativo à classe de risco respectiva, nos casos em que são utilizadas estimativas próprias de LGD e/ou factores de conversão.

(10) Corresponde ao total da coluna 11 do Modelo RC IRB02.

(11) Corresponde ao total da coluna 40 do Modelo TIT IRB01.

(12) Deve ser inscrito o valor dos requisitos de fundos próprios calculados de acordo com o método das Notações Internas para as posições enquadradas na classe de risco Outras posições que não sejam obrigações de crédito.

(13) Corresponde ao total da rubrica 4. da Parte IV do Modelo RS01 – apenas aplicável às instituições que se prevaleçam da faculdade concedida no n.º 1 do artigo 33.º do Decreto-Lei n.º 104/2007.

(14) Corresponde ao total da rubrica 97. do Modelo RC01 – apenas aplicável às instituições que se prevaleçam da faculdade concedida no n.º 1 do artigo 23.º do Decreto-Lei n.º 103/2007.

(15) Corresponde ao total da coluna 3 do Modelo RL01.

(16) $1.3. = 1.3.1. + 1.3.2.$

(17) $1.3.1. = 1.3.1.1. + 1.3.1.2. + 1.3.1.3. + 1.3.1.4.$

(18) Corresponde ao total da coluna 9 do Modelo ID04.

(19) Corresponde ao total da coluna 7 do Modelo TC01.

(20) Corresponde ao total da coluna 11 do Modelo RX02.

- (21) Corresponde ao total da coluna 8 do Modelo ME04.
- (22) Corresponde ao total da coluna 4 do Modelo MRC MI01.
- (23) $1.4. = 1.4.1. + 1.4.2. + 1.4.3. + 1.4.4.$
- (24) Corresponde ao valor da rubrica 1. na coluna 4 do Modelo ROP01.
- (25) Corresponde ao valor da rubrica 2. na coluna 4 do Modelo ROP01.
- (25) Corresponde ao valor da rubrica 5. na coluna 4 do Modelo ROP01.
- (27) Corresponde à redução prevista no n.º 4, do artigo 33.º do Decreto-Lei n.º 104/2007.
- (28) Corresponde, quando aplicável, a um quarto das despesas gerais fixas do ano anterior, conforme previsto no artigo 11.º do Decreto-Lei n.º 103/2007, podendo este valor ser objecto de ajustamento, por determinação do Banco de Portugal, nos casos em que ocorra uma alteração significativa na actividade da empresa de investimento desde o ano anterior. No caso das instituições que ainda não tenham completado um ano de actividade deve-se inscrever nesta rubrica um quarto das despesas gerais fixas previstas no plano previsional para o primeiro ano de actividade, salvo se se tiver verificado uma divergência significativa em relação às previsões, caso em que o plano previsional deve ser ajustado.
- (29) Valor inscrito em 30 da Parte II do Modelo GR01.
- (30) $1.6. = 1.6.1. + 1.6.2.$
- (31) Apenas aplicável às instituições autorizadas a utilizar o método IRB ou autorizadas a utilizar o método AMA. O montante a inscrever nesta rubrica corresponde ao somatório das diferenças, quando positivas, entre os limiares mínimos de requisitos de fundos próprios previstos no artigo 32.º do Decreto Lei n.º 104/2007 e os valores dos requisitos de fundos próprios que a instituição tenha determinado de acordo com o método IRB ou de acordo com o método AMA.
- (32) $2.1. = \text{Rubrica 1. do Modelo FP01} - (1. - 1.7.)$
- (33) $2.1.a. = [\text{Rubrica 1. do Modelo FP01} / (1. - 1.7.)] \times 8\%$
- (34) $2.2. = \text{Rubrica 1. do Modelo FP01} - 1.$
- (35) $2.2.a. = (\text{Rubrica 1. do Modelo FP01} / 1.) \times 8\%$