Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

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 MP01
Parte I

Instituição:	Classe de Risco:	Base:	Ano:	Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

Valores em euros

	Posição em risco original (7)		Correcções de valor e provisões associadas à posição em risco original (8)	Posição em risco original, líquida de correcções de valor e provisões	Técnicas de redução do risco de crédito com efeito de substituição na posição em risco original líquida (9)						Posição em risco líquida, após efeito de substituição
					Protecção pessoal de crédito: valor da protecção totalmente ajustado (G_A)		Protecção real de crédito		Efeito de substituição na posição em risco (14)		
		Da qual: resultante de risco de crédito de contraparte			Garantias (10)	Derivados de crédito (11)	Método simples: Cauções Financeiras (12)	Outras formas de protecção real de crédito (13)	Total: saídas	Total: entradas	
	1	2	3	4=1-3	5	6	7	8	9	10	11=4-9+10
Total das posições em risco											
1. Decomposição das posições em risco por tipo:											
1.1 Elementos do activo											
1.2 Elementos extrapatrimoniais											
1.3 Operações de recompra, concessão/contracção de empréstimos de valores mobiliários ou de mercadorias, operações de liquidação longa e operações de empréstimo com imposição de margem (1)											
1.3.1 Método de avaliação ao preço de mercado											
1.3.2 Método do risco inicial											
1.3.3 Método padrão											
1.3.4 Método do modelo interno											
1.3.5 Anexo VI do Aviso n.º 5/2007											
1.4 Instrumentos Derivados (2)											
1.4.1 Método de avaliação ao preço de mercado											
1.4.2 Método do risco inicial											
1.4.3 Método padrão											
1.4.4 Método do modelo interno											
1.5 Compensação contratual multiproduto (3)											
2. Decomposição das posições em risco por ponderador de risco:											
2.1 0%											
2.2 10%											
2.3 20%											
2.4 35%											
2.5 50%											
2.6 75%											
2.7 100%											
Das quais: *sem avaliação de crédito por ECAI elegível* (4)											
2.8 150%											
2.9 200% (5)											
2.10 Outros ponderadores de risco (6)											