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 II

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

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em euros

	Técnicas de redução do risco de crédito com efeito no montante da posição em risco: protecção real de crédito - método integral sobre cauções financeiras (15)			Valor da posição em risco totalmente ajustado (E*) (19)	Decomposição do valor da posição em risco totalmente ajustado de elementos extrapatrimoniais por factores de conversão (20)				Valor da posição em risco	Montante da posição ponderada pelo risco	Requisitos de fundos próprios
	Ajustamento de volatilidade ao valor da posição em risco (16)	Caução financeira: valor ajustado pela volatilidade e por qualquer desfasamento entre prazos de vencimento (C_{VMD}) (17)	Ajustamentos de volatilidade e prazos de vencimento (18)		0%	20%	50%	100%			
	12	13	14	15	16	17	18	19	20=15-16-0,8x17-0,5x18	21	22
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)											