

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal EUROSIGEMA Departamento de Supervisão Bancária		REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO N.º 7/2007 RISCO DE CRÉDITO - OPERAÇÕES DE TITULARIZAÇÃO SINTÉTICA MÉTODO PADRÃO											MODELO TIT MP501 - parte I				
Instituição:				Data:				Ano:				Mês:					
<input type="checkbox"/> NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO																	
Montante total das posições em risco (5)	Titularização sintética: cobertura do risco de crédito das posições em risco (6)			Posição antes da aplicação de factores de conversão (10)	Correcções de valor e provisões (11)	Posição líquida de correcções de valor e provisões	Técnicas de redução do risco de crédito com efeito de substituição na posição de titularização líquida (12)				Posição de titularização líquida, após efeito de substituição, antes da aplicação de factores de conversão	Técnicas de redução do risco de crédito com efeito no montante da posição: protecção real de crédito - método integral sobre cauições financeiras - Caução financeira: valor ajustado pela volatilidade e por qualquer desfasamento entre prazos de vencimento (Cvam) (16)	Valor da posição de titularização totalmente ajustada (E*) (17)	Decomposição do valor da posição totalmente ajustada (E*) de elementos extrapatrimoniais por factores de conversão (18)			
	Protecção real de crédito (C _{CR}) (7)	Protecção pessoal de crédito: valor da protecção ajustado (C*) (8)	Montante nominal da cobertura do risco de crédito retido ou readquirido (9)				Protecção pessoal de crédito: valor da protecção totalmente ajustado (C _a) (13)	Protecção real de crédito (14)	Total saídas	Total entradas				> 0% e ≤ 20%	> 20% e ≤ 50%	> 50% e ≤ 100%	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12=7+10+11	13	14	15	16	17	18
Total de posições de titularização																	
1. Instituição cedente: total das posições																	
1.1 Posições relevadas no activo																	
1.1.1 Grau de subordinação reduzido (3)																	
1.1.2 Grau de subordinação intermédio (1)																	
1.1.3 Grau de subordinação elevado (2)																	
1.2 Posições extrapatrimoniais e instrumentos derivados (4)																	
1.3 Cláusula de amortização antecipada																	
2. Investidor: total das posições																	
2.1 Posições relevadas no activo																	
2.1.1 Grau de subordinação reduzido																	
2.1.2 Grau de subordinação intermédio																	
2.1.3 Grau de subordinação elevado																	
2.2 Posições extrapatrimoniais e instrumentos derivados																	
3. Instituição patrocinadora: total das posições																	
3.1 Posições relevadas no activo																	
3.2 Posições extrapatrimoniais e instrumentos derivados																	