Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
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 MPS01 - parte II

Instituição: Base: Ano: Mês:

Valores em euros

	Valor da posição de titularização			Decomposição do valor da posição sujeita a ponderação por ponderador de risco								Montante da posição ponderada pelo risco (21)	Ajustamentos ao montante da posição ponderada pelo risco devido a desfasamentos de prazos de vencimento (22)	Requisitos de fundos próprios totais (antes de requisito máximo de fundos próprios - «CAP»)	Por memória: Requisitos de fundos próprios correspondente às saídas das posições de titularização para outras classes de risco	Requisitos de fundos próprios (após requisito máximo de fundos próprios - «CAP»)
				Posição objecto de notação (Graus de qualidade do crédito 1 a 4)				1250%		Método que obtém a ponderação de risco a partir das posições em risco (20)						
		Deduzida aos fundos próprios (19)	Sujeita a ponderação de risco	20%	50%	100%	350%	Posição objecto de notação	Posição não objecto de notação		Do qual: posições de perdas de 2º grau ou superior num programa ADCP					
	19	20	21=19-20	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34
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																