Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO DO BANCO DE PORTUGAL N.º 7/2007
RISCO DE CRÉDITO - OPERAÇÕES DE TITULARIZAÇÃO TRADICIONAL
MÉTODO DAS NOTAÇÕES INTERNAS

MODELO TIT IRBT01 - parte I

Instituição: Base: Ano: Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

Valores em euros

	Posições de Titularização	Técnicas de redução do risco de crédito com efeito de substituição na posição de titularização (6)				Posição de tituarização, 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 cauções financeiras - Caução financeira: valor ajustado pela volatilidade e por qualquer desfasamento entre prazos de vencimento (Cvam) (10)	Valor da posição de titularização totalmente ajustada (E*) (11)	Decomposição do valor da posição totalmente ajustada (E*) de elementos extrapatrimoniais por factores de conversão (12)				Valor da posição de titularização		
				Efeito da substituição na posição de titularização (9)											
	Posição antes da aplicação de factores de conversão (5)	Protecção pessoal de crédito: valor da protecção totalmente ajustado (G_A) (7)	Protecção real de crédito (8)	Total: saídas	Total: entradas					> 0% e ≤ 20%	> 20% e ≤ 50%	> 50% e ≤ 100%		Deduzida aos fundos próprios (13)	Sujeita a ponderação de risco
	1	2	3	4	5	6=1-4+5	7	8	9	10	11	12	13	14	15=13-14
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															