

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 08/01 - parte II					
Instituição											Base:		Ano:		Mês:					
Decomposição do valor da posição em risco sujeita a ponderação por ponderador de risco															Valores em euros					
Método baseado em Notações (Ponderadores de risco em função dos graus de qualidade do crédito)										1250%		Método da Fórmula Regulamentar		Método de Avaliação Interna		Redução do montante da posição ponderada pelo risco devido a correcções de valor e provisões (17)	Montante da posição ponderada pelo risco (18)	Requisitos de fundos próprios totais (antes de requisitos mínimos de fundos próprios - «CAPs»)	Por memória, Requisitos de fundos próprios correspondente às partes das posições de titularização para outras classes de risco	Requisitos de fundos próprios (após requisitos mínimos de fundos próprios - «CAPs»)
Posições com avaliações creditícias de curto prazo e com outras avaliações creditícias (14)										Posição objecto de notação	Posição não objecto de notação	Ponderador de risco efectivo (%) (15)	Facilidades de Liquidez não objecto de notação externa (16)	Ponderador de risco médio (%)						
0% - 10%	12% - 10%	20% - 35%	50% - 75%	100%	250%	425%	650%													
16	17	18	19	20	21	22	23	24	25	26	27	28	29	30	31	32	33	34	35	
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																				