

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal EUROGESTIMA 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 SINTÉTICA MÉTODO DAS NOTAÇÕES INTERNAS											MODELO TIT IRRS01 - parte I					
Instituição:		Data:									Ano:		Mês:					
<input type="checkbox"/> NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO																		
Montante total das posições em risco (6)	Titularização sintética: cobertura do risco de crédito das posições em risco (8)			Posição antes da aplicação de factores de conversão (10)	Técnicas de redução do risco de crédito com efeito de substituição na posição de titularização (11)			Efeito da substituição na posição de titularização (14)	Posição de titularização, após efeito de substituição, antes da aplicação de factores (10+5-0+9)	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 (Cv _{net}) (15)	Valor da posição de titularização totalmente ajustada (E*) (16)	Decomposição do valor da posição totalmente ajustada (E*) de elementos extrapatrimoniais por factores de conversão (17)			Valor da posição de titularização			
	Protecção real de crédito (C _{na}) (7)	Protecção pessoal de crédito valor da protecção ajustado (C*) (9)	Montante nominal da cobertura do risco de crédito retida ou resguardada (8)		Protecção pessoal de crédito: valor da protecção totalmente ajustado (G _{aj}) (12)	Protecção real de crédito (13)	Total saídas					Total entradas	> 0% e ≤ 20%	> 20% e ≤ 50%	> 50% e ≤ 100%	Deduzida nos fundos próprios (18)	Sujeita a ponderação de risco	
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10-5-0+9	11	12	13	14	15	16	17	18	19-17-18
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																		