

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO : RISCO DE POSIÇÃO EM INSTRUMENTOS DE DÍVIDA - MÉTODO PADRÃO

(Anexo II do Aviso n.º 8/2007)

MODELO ID04

Instituição:	Base:	Ano:	Mês:
--------------	-------	------	------

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

Valores em euros

	Posições							Ponderação (%)	Requisitos de fundos próprios (15)	
	Total das posições (10)		Efeito da redução das posições (líquidas) relativas a tomada firme de títulos de dívida (11)	Posições líquidas (12)		(-) Compensação das posições da carteira de negociação cobertas por derivados de crédito (13)				Valor das posições sujeitas a requisitos de fundos próprios (14)
	Longas	Curtas		Longas	Curtas	Para posições líquidas longas	Para posições líquidas curtas			
1	2	3	4	5	6	7	8	9		
Instrumentos de dívida										
1. Risco Geral - Método baseado no Prazo de Vencimento (1)										
1. a Somatório das posições ponderadas compensadas de todos os intervalos										
1. b Posição ponderada compensada da zona 1										
1. c Posição ponderada compensada da zona 2										
1. d Posição ponderada compensada da zona 3										
1. e1 Posição ponderada compensada entre as zonas 1 e 2										
1. e2 Posição ponderada compensada entre as zonas 2 e 3										
1. f Posição ponderada compensada entre a zona 1 e 3										
1. g Posição residual ponderada não compensada										
2. Risco Geral - Método baseado na «Duração» (2)										
2. a Posição ponderada compensada das zonas 1, 2 e 3										
2. b1 Posição ponderada compensada entre as zonas 1 e 2										
2. b2 Posição ponderada compensada entre as zonas 2 e 3										
2. c Posição ponderada compensada entre as Zonas 1 e 3										
2. d Posição residual ponderada não compensada										
3. Risco Específico (3)										
3.1 Títulos de dívida incluídos na categoria 1 do Quadro 1 da Parte 2 do anexo II do Aviso n.º 8/2007 (4)										
3.2 Títulos de dívida incluídos nas categorias 2 a 6 do Quadro 1 da Parte 2 do anexo II do Aviso n.º 8/2007										
3.2.a Prazo de vencimento residual: ≤ 6 meses										
3.2.b Prazo de vencimento residual: > 6 meses e ≤ 24 meses										
3.2.c Prazo de vencimento residual: > 24 meses										
3.3 Títulos de dívida incluídos nas categorias 7 a 10 do Quadro 1 da Parte 2 do anexo II do Aviso n.º 8/2007										
3.4 Títulos de dívida incluídos nas categorias 11 a 12 do Quadro 1 da Parte 2 do anexo II do Aviso n.º 8/2007										
3.5 Posições titularizadas (5)										
4. Requisitos de fundos próprios relativos às posições em OIC na carteira de negociação (6)										
5. Requisitos de fundos próprios relativos a futuros e opções vendidas negociados em bolsa (método baseado na margem) (7)										
6. Requisitos de fundos próprios relativos a contratos a prazo e opções vendidas no mercado de balcão - OTC (método baseado na margem) (8)										
7. Requisitos de fundos próprios relativos a opções adquiridas (baseadas no método do preço ou no subjacente) (9)										
8. Outros requisitos de fundos próprios relativos a riscos associados a opções, que não o risco delta										