

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO : RISCO DE POSIÇÃO EM TÍTULOS DE CAPITAL - MÉTODO PADRÃO
(Anexo II do Aviso n.º 8/2007)

MODELO TC01

Instituição:

Base:

Ano:

Mês:

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

Valores em euros

	Posições					Valor das posições sujeitas a requisitos de fundos próprios (6)	Ponderação (%)	Requisitos de fundos próprios (12)
	Total das posições (9)		(-) Efeito da redução das posições (líquidas) relativas a tomada firme de títulos de capital (10)	Posições líquidas (11)				
	Longas (1)	Curtas (2)		Longas (4)	Curtas (5)			
Títulos de capital								
1. Risco Geral						8		
1.1. Futuros sobre índices de acções largamente diversificados (1)								
1.2. Títulos de capital nas condições da alínea d) do subponto 7.2. da Secção III-A da Parte 2 do Anexo II do Aviso n. 8/2007 (2)								
1.3. Futuros sobre índices de acções tratados como títulos de capital (3)								
1.4. Outras posições em títulos de capital sujeitas a risco geral (2)								
2. Risco Específico								
2.1. Títulos de capital nas condições da alínea d) do subponto 7.2. da Secção III-A da Parte 2 do Anexo II do Aviso n. 8/2007 (4)						2		
2.2. Outras posições em títulos de capital sujeitas a risco específico (4)						4		
3. Requisitos de fundos próprios relativos às posições em OIC na carteira de negociação (5)								
4. Requisitos de fundos próprios relativos a futuros e opções vendidas negociados em bolsa (método baseado na margem) (6)								
5. Requisitos de fundos próprios relativos a contratos a prazo e opções vendidas no mercado de balcão - OTC (método baseado na margem) (7)								
6. Requisitos de fundos próprios relativos a opções adquiridas (baseadas no método do preço ou no subjacente) (8)								
7. Outros requisitos de fundos próprios relativos a riscos associados a opções, que não o risco delta								