Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

RISCO DE MERCADORIAS - MÉTODO PADRÃO
(Anexo VI do Aviso n.º 8/2007)

MODELO ME04

Instituição: Base: Ano: Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em euros

	Total das posições (6)		Das quais: Posições que constituem financiamento de existências (7)		Posições líquidas (8)		Valor das posições sujeitas a requisitos de fundos próprios (9)	Ponderação (%)	Requisitos de fundos próprios (10)
	Longa	Curta	Longas	Curtas	Longas	Curtas			
	1	2	3	4	5	6	7		8
Total das posicões sobre mercadorias									
1. Método da escala de prazos de vencimento (1)									
1.a Posições compensadas num só intervalo e entre intervalos distintos								1,5	
1.b Reporte de posições a outros intervalos para compensação								0,6	
1.c Posições não compensadas								15	
2. Método simplificado (2)									
2.a Posição líquida								15	
2.b Posição bruta								3	
3. Requisitos de fundos próprios relativos a futuros e opções negociados em bolsa (método baseado na margem) (3)									
4. Requisitos de fundos próprios relativos a contratos a prazo e opções vendidas no mercado de balcão - OTC (método baseado na margem) (4)									
5. Requisitos de fundos próprios relativos a opções compradas (baseadas no método do preço ou no subjacente) (5)									
6. Outros requisitos de fundos próprios relativos a riscos associados a opções, que não o risco delta									