

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

RISCOS CAMBIAIS - MÉTODO PADRÃO
(Anexo V do Aviso n.º 8/2007)

MODELO RX02

Instituição: _____ Base: _____ Ano: _____ Mês: _____

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

	Total das posições (6)		Das quais: Posições de natureza estrutural e respeitantes a elementos deduzidos a fundos próprios (7)		Posições líquidas (8)		Somatório da Posição líquida global em divisas com a posição líquida em ouro (9)	Posições sujeitas a requisitos de fundos próprios (incluindo redistribuição de posições não compensadas em divisas sujeitas a tratamento especial para posições compensadas) (10)			Ponderação (%)			Requisitos de fundos próprios (11)
	Longas	Curtas	Longas	Curtas	Longas	Curtas		Longas	Curtas	Compensadas	Longas	Curtas	Compensadas	
	1	2	3	4	5	6		7	8	9	10	11		
1. POSIÇÕES TOTAIS EM MOEDA ESTRANGEIRA (1)														
1.1 Divisas sujeitas a acordos entre Estados (2)														
1.2 Divisas estreitamente correlacionadas (3)														
1.3 Outras divisas (inclui OIC tratados como divisas quando sejam conhecidas as posições totais) (4)														
1.4 Ouro														
1.5 OIC tratados como divisas quando não sejam conhecidas as posições, longas e curtas, totais (5)														
2. OUTROS REQUISITOS RELATIVOS A RISCOS ASSOCIADOS A OPÇÕES, QUE NÃO O RISCO DELTA														
3. POR MEMÓRIA: LIMAR MÍNIMO DE 2% DOS FUNDOS PRÓPRIOS														
4. POR MEMÓRIA: OIC TRATADOS COMO DIVISAS AUTÓNOMAS (incluídas em 1.3.)														

Valores em euros