

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal

EUROSISTEMA

Departamento de Supervisão Bancária

RISCOS DE POSIÇÃO, CAMBIAIS E DE MERCADORIAS - MODELOS INTERNOS

(Anexo VII do Aviso n.º 8/2007) (1)

MODELO MRC MI01

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

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

Valores em euros

	Média dos valores diários em risco verificados nos 60 dias úteis anteriores x Factor de multiplicação (2)	Valor-em-risco (VAR) do dia anterior (3)	Requisitos de fundos próprios para cobertura do risco de incumprimento adicional (4)	Requisitos de fundos próprios	Por memória:	
					Número de excessos (resultante das verificações <i>a posteriori</i> efectuadas nos últimos 250 dias úteis) (5)	Factor adicional (ao factor de multiplicação) (6)
	1	2	3	(4)=Max [(1),(2)]+(3)	5	6
Total						
Por memória : Decomposição dos riscos						
1. Instrumentos de dívida						
2. Títulos de capital						
3. Riscos cambiais						
4. Risco de mercadorias						