

**Anexo à Instrução n.º 23/2007**

<b>Banco de Portugal</b>		<b>DETALHES SOBRE RISCOS DE POSIÇÃO, CAMBIAIS E DE MERCADORIAS - MODELOS INTERNOS</b>				<b>MODELO MRC MI02</b>		
EUROSISTEMA		(Anexo VII do Aviso n.º 8/2007)						
<b>Departamento de Supervisão Bancária</b>								
Instituição:		Base:		Ano:		Mês:		
<input type="checkbox"/> NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO <span style="float: right;"><i>Valores em euros</i></span>								
Informação de base								
Valor-em-risco (VAR) regulamentar						Valor-em-risco (VAR) interno (3)		
Identificação dos riscos abrangidos pelo modelo regulamentar (1)				Modelização do risco específico de títulos de capital (2)	Modelização do risco específico de instrumentos de dívida (2)	Identificação do tipo de variações do valor da carteira utilizadas nas verificações <i>a posteriori</i> do número de excessos	Intervalo de confiança	Período de detenção
Títulos de capital	Instrumentos de dívida	Riscos cambiais	Risco de mercadorias					
1	2	3	4	5	6	7	8	9
Adicionar	Apagar	Valor-em-risco (VAR) regulamentar			Valor-em-risco (VAR) interno (7)	Variações do valor da carteira utilizadas nas verificações <i>a posteriori</i> do número de excessos (8)		
		Intervalo de confiança = 99% (5)		Requisito de fundos próprios para cobertura do risco de incumprimento adicional (6)				
		VAR (período de detenção = 10 dias)	VAR (período de detenção = 1 dia)					
		10	11	12		13	14	15