

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Modelo MRC MI02

- (1) Nas colunas 1 a 4 deve ser dada indicação sobre a modelização, ou não, dos mencionados riscos, para efeitos de determinação de requisitos de fundos próprios.
- (2) Deve ser dada indicação sobre a modelização, ou não, do risco específico relativo aos títulos de capital e instrumentos de dívida, respectivamente.
- (3) Nas colunas 8 e 9 deve ser indicado o intervalo de confiança e o período de detenção utilizados no cálculo do valor-em-risco para efeitos internos de gestão de risco por parte da instituição, quando tal for aplicável e aquele cálculo utilizar para os referidos parâmetros valores distintos dos valores utilizados para efeitos do cálculo dos requisitos de fundos próprios para efeitos regulamentares.
- (4) Devem ser preenchidas as linhas correspondentes aos dias úteis decorridos desde a data de referência do último reporte.
- (5) Valor-em-risco (diário) determinado com base no intervalo de confiança de 99% e um período de detenção de 1 ou 10 dias. O valor-em-risco determinado com um período de detenção de 1 dia releva, em especial, para efeitos do programa de verificações *a posteriori* a que aludem os pontos 4, 5 e 13, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007.
- (6) Montante de risco de incumprimento adicional, calculado nos termos da alínea c) do subponto 17.2 ou do ponto 18, do Anexo VII do Aviso n.º 8/2007.
- (7) Valor-em-risco determinado com base no intervalo de confiança e no período de detenção utilizados para efeitos internos de gestão de risco por parte da instituição.
- (8) Devem ser inscritas as variações hipotéticas ou as variações hipotéticas e reais, do valor da carteira em cada um dos dias úteis incluídos neste reporte.