REGULAMENTO DE EXECUÇÃO (UE) 2025/379 DA COMISSÃO

de 26 de fevereiro de 2025

que altera as normas técnicas de execução estabelecidas no Regulamento de Execução (UE) 2016/2070 no que respeita às carteiras de análise comparativa e aos modelos e instruções a aplicar na União para a comunicação de informações a que se refere o artigo 78.º, n.º 2, da Diretiva 2013/36/UE do Parlamento Europeu e do Conselho

(Texto relevante para efeitos do EEE)

A COMISSÃO EUROPEIA,

Tendo em conta o Tratado sobre o Funcionamento da União Europeia,

Tendo em conta a Diretiva 2013/36/UE do Parlamento Europeu e do Conselho, de 26 de junho de 2013, relativa ao acesso à atividade das instituições de crédito e à supervisão prudencial das instituições de crédito, que altera a Diretiva 2002/87/CE e revoga as Diretivas 2006/48/CE e 2006/49/CE ([1]), nomeadamente o artigo 78.º, n.º 8, terceiro parágrafo,

Considerando o seguinte:

(1) Nos termos do artigo 78.º, n.º 1, da Diretiva 2013/36/UE, as instituições autorizadas a utilizar métodos internos devem apresentar à respetiva autoridade competente com uma frequência adequada e, pelo menos, uma vez por ano, os resultados dos cálculos dos montantes das suas posições ponderadas pelo risco ou dos requisitos de fundos próprios de acordo com os seus métodos internos para as exposições ou posições incluídas nas carteiras de referência, a fim de permitir à autoridade competente avaliar a qualidade desses métodos internos («exercício de avaliação comparativa»). Nos termos do artigo 78.º, n.º 3, segundo parágrafo, da mesma diretiva, a Autoridade Bancária Europeia (EBA) deve apresentar um relatório a fim de assistir as autoridades competentes na avaliação da qualidade dos métodos internos das instituições, com base nos resultados do exercício de análise comparativa. Os requisitos de comunicação de informações para o exercício de avaliação comparativa são especificados no Regulamento de Execução (UE) 2016/2070 da Comissão ([2]), que foi alterado várias vezes. A fim de refletir as alterações no foco das avaliações pelas autoridades competentes e dos relatórios da EBA, e à luz das alterações legislativas no domínio do risco de mercado, é necessário atualizar novamente as carteiras para análise comparativa, juntamente com os requisitos de comunicação de informações estabelecidos no regulamento de execução anteriormente mencionado.

(2) No que respeita à avaliação comparativa do risco de crédito, as instruções devem ser alteradas para especificar a natureza obrigatória da comunicação dos parâmetros de risco para a probabilidade de incumprimento (PD) e para as perdas dado o incumprimento (LGD), no que respeita à margem de prudência (MoC), aos acréscimos regulamentares e às componentes de contração económica, que podem ser uma fonte de variabilidade nos modelos. Além disso, deve especificar-se que as instituições são obrigadas a comunicar o identificador dos modelos atribuído pela autoridade competente, simplificando a operacionalização da comunicação da afetação dos dados.

(3) O Regulamento Delegado (UE) 2024/2795 da Comissão ([3]) adiou a data de aplicação dos novos requisitos de fundos próprios para o risco de mercado. Por conseguinte, os modelos para o atual método dos modelos internos não irão ser substituídos para este exercício. Paralelamente, os modelos para a validação do método padrão devem ser alargados de modo a incluir carteiras adicionais em comparação com o exercício de 2024, que apenas abrangia os instrumentos de taxas de juro. O objetivo é assegurar uma supervisão adequada e uma aplicação harmoniosa da nova abordagem normalizada, que é utilizada para o cálculo do limite mínimo dos resultados.

([1]) JO L 176 de 27.6.2013, p. 338, ELI: http://data.europa.eu/eli/dir/2013/36/oj).

([2]) Regulamento de Execução (UE) 2016/2070 da Comissão, de 14 de setembro de 2016, que estabelece normas técnicas de execução no que respeita aos modelos, às definições e às soluções informáticas a utilizar pelas instituições quando comunicam informações à Autoridade Bancária Europeia e às autoridades competentes em conformidade com o artigo 78.º, n.º 2, da Diretiva 2013/36/UE do Parlamento Europeu e do Conselho (JO L 328 de 2.12.2016, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2016/2070/oj).

([3]) Regulamento Delegado (UE) 2024/2795 da Comissão, de 24 de julho de 2024, que altera o Regulamento (UE) n.º 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita à data de aplicação dos requisitos de fundos próprios para o risco de mercado (JO L, 2024/2795, 31.10.2024, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_del/2024/2795/oj).

(4) O Regulamento de Execução (UE) 2016/2070 deve, por conseguinte, ser alterado em conformidade.

(5) O presente regulamento tem por base os projetos de normas técnicas de execução apresentados pela EBA à Comissão.

(6) A EBA efetuou consultas públicas abertas sobre os projetos de normas técnicas de execução em que o presente regulamento se baseia, analisou os potenciais custos e benefícios associados e solicitou o parecer do Grupo de Partes Interessadas do Setor Bancário, criado nos termos do artigo 37.º do Regulamento (UE) n.º 1093/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho ([4]),

ADOTOU O PRESENTE REGULAMENTO:

Artigo 1.º

O Regulamento de Execução (UE) 2016/2070 é alterado do seguinte modo:

1) O anexo IV é substituído pelo texto constante do anexo I do presente regulamento;

2) O anexo V é substituído pelo texto constante do anexo II do presente regulamento;

3) O anexo VI é substituído pelo texto constante do anexo III do presente regulamento;

4) O anexo VII é substituído pelo texto constante do anexo IV do presente regulamento;

5) O anexo X é substituído pelo texto do anexo V do presente regulamento.

Artigo 2.º

O presente regulamento entra em vigor no vigésimo dia seguinte ao da sua publicação no *Jornal Oficial da União Europeia*.

O presente regulamento é obrigatório em todos os seus elementos e diretamente aplicável em todos os Estados-Membros.

Feito em Bruxelas, em 26 de fevereiro de 2025.

Pela Comissão
A Presidente
Ursula VON DER LEYEN

([4]) Regulamento (UE) n.º 1093/2010 do Parlamento Europeu e do Conselho, de 24 de novembro de 2010, que cria uma Autoridade Europeia de Supervisão (Autoridade Bancária Europeia), altera a Decisão n.º 716/2009/CE e revoga a Decisão 2009/78/CE da Comissão (JO L 331 de 15.12.2010, p. 12, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2010/1093/oj).

ANEXO I

«ANEXO IV

RESULTADOS DAS CARTEIRAS DE ANÁLISE COMPARATIVA PARA FINS DE SUPERVISÃO

PARTE I: INSTRUÇÕES GERAIS

PARTE II:INSTRUÇÕES RESPEITANTES AOS MODELOS

C 101 – Informações pormenorizadas sobre as posições em risco em carteiras com baixo risco de incumprimento por contraparte

C 102 — Informações pormenorizadas sobre as posições em risco em carteiras com baixo risco de incumprimento

C 103 — Informações pormenorizadas sobre as posições em risco em carteiras com alto risco de incumprimento

C 105.01 – Definição de modelos internos

C 105.02 – Identificação dos modelos internos em função das carteiras

C 105.03 – Identificação dos modelos internos em função dos países

PARTE I: INSTRUÇÕES GERAIS

1. Só devem ser comunicadas informações relativamente às contrapartes e carteiras em que exista uma posição em risco efetiva na data de referência, sob a forma de uma posição em risco inicial ou de uma posição em risco após CRM (redução do risco de crédito). As contrapartes e carteiras relativamente às quais não exista nenhuma posição em risco na data de referência não devem ser apresentadas.

2. Só devem ser comunicadas informações relativamente às posições em risco para as quais a autoridade competente tenha aprovado um modelo interno para o cálculo dos montantes das posições em risco ponderadas pelo risco ("RWA"). No modelo C 101, os códigos das contrapartes terminados em "STDA" não devem ser comunicados. Quantos aos restantes códigos das contrapartes do modelo C 101 do anexo I e às carteiras de referência referidas nos modelos C 102 e C 103, devem ser excluídas as posições em risco calculadas nos termos do método padrão e as posições em risco para as quais a respetiva autoridade competente tenha autorizado a utilização parcial temporária ou permanente do método padrão.

3. Os campos que recolhem informações não aplicáveis ou mal especificadas devem ser deixados em branco ou preenchidos com a indicação "NULO". O mesmo se aplica às quantidades e aos parâmetros ponderados pela posição em risco em incumprimento ("EAD") que não é possível calcular. De igual modo, os campos de dados cuja comunicação não é obrigatória podem ser deixados em branco ou preenchidos com a indicação "NULO". Só deve ser comunicado o valor zero se a intenção for comunicar uma quantidade ou parâmetro igual a zero. As indicações "em branco" ou "NULO" não devem ser utilizadas para comunicar quantidades ou parâmetros iguais a zero.

4. Os montantes monetários devem ser comunicados da mesma forma que para o cálculo dos requisitos de fundos próprios numa data de referência específica, em conformidade com o Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão ([1]).

([1]) Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão, de 17 de dezembro de 2020, que estabelece normas técnicas de execução para a aplicação do Regulamento (UE) n.º 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho no que respeita ao relato para fins de supervisão das instituições e revoga o Regulamento de Execução (UE) n.º 680/2014 (JO L 97 de 19.3.2021, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2021/451/oj).

PARTE II: INSTRUÇÕES RESPEITANTES AOS MODELOS

C 101 – Informações pormenorizadas sobre as posições em risco em carteiras com baixo risco de incumprimento por contraparte

São excluídas as posições em risco sobre empréstimos especializados.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Código da contraparte	Modelo C 101, coluna 0010 do anexo I	Indicar o código da contraparte no modelo C 101, coluna 0010 do anexo I que identifica a contraparte incluída nas amostras de carteiras com baixo risco de incumprimento ("LDP"). Este código deve identificar uma linha e ser único para cada linha do modelo.
0020	Classe de risco	Ponto 76 do anexo II do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Cada contraparte deve ser afetada a uma das seguintes classes de risco: a) Bancos centrais e administrações centrais; b) Instituições; c) Empresas – PME (pequenas e médias empresas); d) Empresas — Empréstimos especializados; e) Empresas – Outras; f) Retalho – PME – Garantidas por imóveis; g) Retalho – Não PME – Garantidas por imóveis; h) Retalho – Renováveis elegíveis; i) Retalho – PME – Outras; j) Retalho – Não PME – Outras; k) Não aplicável. Deve comunicar-se "Não aplicável" caso nenhuma das respostas acima listadas se aplique, por exemplo quando as posições em risco perante uma contraparte forem classificadas em diferentes classes de risco sem que uma dessas classes seja claramente predominante.
0040	Notação		Deve comunicar-se a hierarquia dos graus de notação interna atribuídos à contraparte no âmbito da escala de notação interna aplicada pela instituição, a qual deve seguir uma ordem numérica - 1, 2, 3, etc. - do risco mais baixo até ao mais elevado, excluindo as situações de incumprimento com probabilidade de incumprimento ("PD") correspondente a 100 %. Se uma instituição usar uma escala de notação contínua em conformidade com o artigo 169.º, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho ([2]), esta deve usar os graus de notação indicados na coluna 0005 do modelo C 08.02 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451. Caso as posições em risco perante uma contraparte tenham sido afetadas a vários graus de notação em conformidade com o artigo 172.º, n.º 1, alínea e), subalínea i) ou iii), do Regulamento (UE) n.º 575/2013, deve indicar-se o grau de notação zero (0).

([2]) Regulamento (UE) n.° 575/2013 do Parlamento Europeu e do Conselho, 26 de junho de 2013, relativo aos requisitos prudenciais para as instituições de crédito e para as empresas de investimento e que altera o Regulamento (UE) n. ° 648/2012 (JO L 176 de 27.6.2013, p. 1, ELI: http://data.europa.eu/eli/reg/2013/575/oj).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0050	Data da notação mais recente da contraparte		Deve comunicar-se a data da notação mais recente da contraparte.
0060	PD	Modelo C 08.01, coluna 0010, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se a probabilidade de incumprimento atribuída à contraparte. A probabilidade de incumprimento deve ser a probabilidade de incumprimento utilizada no cálculo do montante das posições ponderadas pelo risco (RWA), excluindo o efeito de medidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013. A probabilidade de incumprimento deve ser expressa como um valor entre 0 e 1.
0070	Estado de incumprimento		Deve comunicar-se o estado de incumprimento da contraparte, o qual deve ser um dos seguintes, em conformidade com o artigo 178.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013: a) Em incumprimento; b) Sem incumprimento.
0080	Posição em risco inicial antes da aplicação de fatores de conversão	Modelo C 08.01, coluna 0020, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o valor da posição em risco inicial antes da tomada em consideração de quaisquer ajustamentos de valor, provisões, efeitos devido a técnicas de redução do risco de crédito ou fatores de conversão.
0090	Posição em risco após efeitos de substituição CRM (redução do risco de crédito) e antes da aplicação de fatores de conversão de crédito	Modelo C 08.01, coluna 0090, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o montante a que são aplicados fatores de conversão de crédito ("CCF") para obter a posição em risco em incumprimento ("EAD" – coluna 0110), tendo em conta as técnicas de redução do risco de crédito com efeitos de substituição na posição em risco.
0100	Fator de conversão de crédito ("CCF")	Artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se a média ponderada dos fatores de conversão de crédito. Os ponderadores utilizados devem ser os montantes aos quais são aplicados os fatores de conversão de crédito para obter a posição em risco em incumprimento. No caso das contrapartes cujas facilidades correspondem exclusivamente a elementos referidos no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, o cálculo da média ponderada dos fatores de conversão de crédito deve basear-se em todas as facilidades. No caso das contrapartes cujas facilidades não são abrangidas pelos elementos referidos no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, o campo relativo aos fatores de conversão de crédito deve ser deixado em branco ou preenchido com a indicação "NULO".

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			Para as contrapartes com facilidades correspondentes a elementos a que se refere o artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 e facilidades não abrangidas pelos elementos a que se refere o artigo 166.º, n.º 8, do mesmo regulamento, o cálculo da média ponderada dos fatores de conversão de crédito deve basear-se apenas nas facilidades correspondentes aos elementos a que se refere o artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Mais especificamente, as facilidades que correspondem a elementos referidos no artigo 166.º, n.º 10, do mesmo regulamento devem ser excluídas do cálculo. Caso a instituição aplique estimativas próprias dos fatores de conversão de crédito para os elementos referidos no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, esses fatores de conversão de crédito devem ser utilizados para calcular a média ponderada dos fatores de conversão de crédito. Caso a instituição não aplique estimativas próprias dos fatores de conversão de crédito para os elementos mencionados no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, devem ser utilizados os fatores de conversão de crédito regulamentares previstos no referido artigo. O fator de conversão de crédito deve ser expresso como um valor entre 0 e 1.
0110	Posição em risco em incumprimento ("EAD")	Modelo C 08.01, coluna 0110, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o valor da posição em risco.
0120	Valor das cauções	Modelo C 08.01, colunas 0150 a 0210, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o valor de mercado das cauções.
0130	Perdas dado o incumprimento ("LGD") hipotéticas dos créditos prioritários não garantidos sem cláusula de não penhor	Artigo 161.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Devem comunicar-se as estimativas próprias hipotéticas das perdas dado o incumprimento ("LGD") que a instituição aplicaria às posições em risco perante a contraparte do seguinte modo: (a) O âmbito das posições em risco é o mesmo que para o valor de perdas dado o incumprimento comunicado na coluna 0150; (b) As posições em risco são prioritárias e não garantidas; (c) Não existe uma cláusula de não penhor. Uma cláusula de não penhor é uma cláusula segundo a qual o mutuário ou emitente de dívida não pode entregar quaisquer dos seus ativos em penhor a favor de outra parte.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0140	Perdas dado o incumprimento ("LGD") hipotéticas dos créditos prioritários não garantidos com cláusula de não penhor	Artigo 161.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Devem comunicar-se as estimativas próprias hipotéticas das perdas dado o incumprimento que a instituição aplicaria às posições em risco perante a contraparte do seguinte modo: (a) O âmbito das posições em risco é o mesmo que para o valor de perdas dado o incumprimento comunicado na coluna 0150; (b) As posições em risco são prioritárias e não garantidas; (c) Existe uma cláusula de não penhor. Uma cláusula de não penhor é uma cláusula segundo a qual o mutuário ou emitente de dívida não pode entregar quaisquer dos seus ativos em penhor a favor de outra parte.
0150	Perdas dado o incumprimento ("LGD")	Modelo C 08.01, colunas 0230 e 0240, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se a média ponderada pela posição em risco ("EAD") em incumprimento dos valores de perdas dado o incumprimento ("LGD") das posições em risco perante a contraparte. As perdas dado o incumprimento devem ser as utilizadas para o cálculo do montante das posições em risco ponderadas pelo risco ("RWA"). Mais especificamente, se a instituição tiver obtido autorização da sua autoridade competente para utilizar estimativas próprias para as perdas dado o incumprimento, estas devem basear-se nas estimativas das próprias instituições; caso contrário, as perdas dado o incumprimento devem basear-se nos respetivos valores regulamentares, tendo em conta as técnicas de redução do risco aplicáveis. Devem ser incluídas as perdas dado o incumprimento para as grandes entidades regulamentadas do setor financeiro e as entidades financeiras não regulamentadas. O efeito das medidas introduzidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013 deve ser excluído. As perdas dado o incumprimento devem ser expressas como um valor entre 0 e 1.
0160	Prazo de vencimento	Modelo C 08.01, coluna 0250, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o prazo de vencimento ponderado pela posição em risco em incumprimento para as posições em risco perante a contraparte. Deve ser expresso em número de dias.
0170	Montante das posições ponderadas pelo risco ("RWA")	Modelo C 08.01, coluna 0260, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o montante das posições ponderadas pelo risco após a aplicação de fatores de apoio (às PME e às infraestruturas). O montante das posições ponderadas pelo risco deve excluir o efeito de eventuais medidas introduzidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013.

C 102 — Informações pormenorizadas sobre as posições em risco em carteiras com baixo risco de incumprimento

Para as carteiras referidas no anexo I relativamente às quais o estado das cauções é diferente de "Não aplicável", as informações seguintes podem ser omitidas se o modelo aprovado não previr cálculos de perdas dado o incumprimento distintos para a parte garantida e não garantida de uma posição em risco: Perdas dado o incumprimento (LGD) (coluna 0130); LGD sem medidas de supervisão (coluna 0131); LGD sem margem de prudência e sem medidas de supervisão (coluna 0132); LGD sem MoC, medidas de supervisão e componente de contração económica (coluna 0133); Montante das perdas esperadas (coluna 0150); Montante das posições ponderadas pelo risco (RWA) (coluna 0170).

Para as carteiras com uma abordagem regulamentar definida como "Critérios de afetação de crédito especializado", devem omitir-se as seguintes informações: Probabilidade de incumprimento (PD) (coluna 0060); PD sem medidas de supervisão (coluna 0061); PD sem margem de prudência e medidas de supervisão (coluna 0062); Perdas dado o incumprimento (LGD) (coluna 0130); LGD sem medidas de supervisão (coluna 0131); LGD sem margem de prudência e sem medidas de supervisão (coluna 0132); LGD sem MoC, medidas de supervisão e componente de contração económica (coluna 0133).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	ID da carteira	Modelo C 102, coluna 0010 do anexo I	Deve comunicar-se o ID da carteira, indicado na coluna 0010 do modelo C.102 do anexo I, que identifica a carteira. Este ID deve identificar uma linha e ser único para cada linha do modelo. A afetação das posições em risco aos identificadores de carteira não é exclusiva: As posições em risco ou partes das posições em risco devem ser comunicadas para cada identificador de carteira aplicável.
0040	Número de devedores		Deve comunicar-se o número de devedores. Este número deve basear-se nos devedores que tenham um valor estritamente positivo comunicado na coluna 0080 ou na coluna 0090. Caso seja aplicada uma substituição total devido a uma técnica de redução do risco de crédito, o devedor inicial deve ser adicionado ao "Número de devedores" da sua carteira inicial e o garante deve ser adicionado ao "Número de devedores" da carteira do garante.
0060	PD	Modelo C 08.01, coluna 0010, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	A probabilidade de incumprimento deve ser a probabilidade de incumprimento utilizada no cálculo do montante das posições ponderadas pelo risco (RWA), excluindo o efeito das medidas que possam ser introduzidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Para as carteiras correspondentes a um grau ou categoria de devedores, deve ser comunicada a probabilidade de incumprimento afetada ao grau ou categoria específicos de devedores. Para as carteiras correspondentes a um agrupamento de devedores de diferentes graus ou categorias, deve ser indicada a probabilidade de incumprimento média ponderada pela posição em risco em incumprimento atribuída às posições em risco incluídas no agrupamento. A probabilidade de incumprimento deve ser expressa como um valor entre 0 e 1.
0061	PD sem medidas de supervisão		A PD sem medidas de supervisão é a PD baseada no disposto nos artigos 179.º e 180.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, que inclui a margem de prudência (MoC) acrescentada pela instituição, mas exclui as medidas (multiplicadores, acréscimos, limites mínimos ou medidas semelhantes que aumentam diretamente a PD) que tenham sido impostas pelas autoridades competentes. Para as carteiras correspondentes a um grau ou categoria individual, deve ser comunicada a probabilidade de incumprimento para esse grau incluindo a margem de prudência, mas excluindo as medidas de supervisão. Para as carteiras correspondentes a um agrupamento de devedores de diferentes graus ou categorias, deve ser indicada a probabilidade de incumprimento média ponderada pela posição em risco em incumprimento das posições em risco respetivas, incluindo as margens de prudência, mas excluindo as medidas de supervisão. A probabilidade de incumprimento sem medidas de supervisão deve ser expressa como um valor entre 0 e 1. Caso a instituição não esteja em condições de isolar os ajustamentos conservadores relevantes, aplica-se o ponto 3 da Parte I.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0062	PD sem margem de prudência e medidas de supervisão		A probabilidade de incumprimento (PD) sem margem de prudência (MoC) e medidas de supervisão é a PD que não inclui a margem de prudência (MoC) acrescentada pela instituição em conformidade com o artigo 179.º, n.º 1, alínea f), e o artigo 180.º, n.º 1, alínea e), do Regulamento (UE) n.º 575/2013, nem o efeito das medidas impostas pelas autoridades competentes (multiplicadores, acréscimos, limites mínimos ou medidas semelhantes que aumentam diretamente a PD). Para as carteiras correspondentes a um grau ou categoria individual, deve ser comunicada a probabilidade de incumprimento para esse grau excluindo a margem de prudência e as medidas de supervisão. Para as carteiras correspondentes a um agrupamento de devedores de diferentes graus ou categorias, deve ser indicada a probabilidade de incumprimento média ponderada pela posição em risco em incumprimento das posições em risco respetivas, excluindo a margem de prudência (MoC) e as medidas de supervisão. A PD sem a margem de prudência e as medidas de supervisão deve ser expressa como um valor entre 0 e 1. Caso a instituição não esteja em condições de isolar os ajustamentos conservadores relevantes, aplica-se o ponto 3 da Parte I.
0080	Posição em risco inicial antes da aplicação de fatores de conversão	Modelo C 08.01, coluna 0020, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o valor da posição em risco inicial antes da tomada em consideração de quaisquer ajustamentos de valor, provisões, efeitos devido a técnicas de redução do risco de crédito ou fatores de conversão.
0090	Posição em risco após efeitos de substituição CRM (redução do risco de crédito) e antes da aplicação de fatores de conversão de crédito	Modelo C 08.01, coluna 0090, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o montante a que são aplicados fatores de conversão de crédito (CCF) para obter a posição em risco em incumprimento (EAD – coluna 0110), tendo em conta as técnicas de redução do risco de crédito com efeitos de substituição na posição em risco.
0100	Fator de conversão de crédito ("CCF")	Artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se a média ponderada dos fatores de conversão de crédito. Os ponderadores utilizados devem ser os montantes aos quais são aplicados os fatores de conversão de crédito para obter a posição em risco em incumprimento. No caso das carteiras que incluem facilidades que correspondem exclusivamente a elementos referidos no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, o cálculo da média ponderada dos fatores de conversão de crédito deve basear-se em todas as facilidades. No caso das carteiras que não incluem facilidades abrangidas pelos elementos referidos no artigo 166.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, o campo relativo aos fatores de conversão de crédito deve ser deixado em branco ou preenchido com a indicação "NULO". Para as carteiras que incluem facilidades correspondentes a elementos a que se refere o artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 e facilidades que não se enquadram nos elementos a que se refere esse artigo, a média ponderada comunicada do fator de conversão de crédito deve basear-se apenas nas facilidades correspondentes aos elementos a que se refere o artigo 166.º,

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Mais especificamente, as facilidades que correspondem a elementos referidos no artigo 166.º, n.º 10, do mesmo regulamento devem ser excluídas do cálculo. Caso a instituição aplique estimativas próprias dos fatores de conversão de crédito para os elementos referidos no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, esses fatores de conversão de crédito devem ser utilizados para calcular a média ponderada dos fatores de conversão de crédito. Caso a instituição não aplique estimativas próprias dos fatores de conversão de crédito para os elementos mencionados no artigo 166.º, n.º 8, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, devem ser utilizados os fatores de conversão de crédito regulamentares previstos no referido artigo. O fator de conversão de crédito deve ser expresso como um valor entre 0 e 1.
0110	Posição em risco em incumprimento ("EAD")	Modelo C 08.01, coluna 0110, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o valor da posição em risco.
0120	Valor das cauções	Modelo C 08.01, colunas 0150 a 0210, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o valor de mercado das cauções.
0130	Perdas dado o incumprimento ("LGD")	Modelo C 08.01, colunas 0230 e 0240, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se a média ponderada pela posição em risco em incumprimento dos valores de perdas dado o incumprimento das posições em risco na respetiva carteira. As perdas dado o incumprimento devem ser as utilizadas para o cálculo do montante das posições em risco ponderadas pelo risco ("RWA"). Mais especificamente, se a instituição tiver obtido autorização da sua autoridade competente para utilizar estimativas próprias para as perdas dado o incumprimento, estas devem basear-se nas estimativas das próprias instituições; caso contrário, as perdas dado o incumprimento devem basear-se nos respetivos valores regulamentares, tendo em conta as técnicas de redução do risco aplicáveis. Devem ser incluídas as posições em risco e as respetivas perdas dado o incumprimento para as grandes entidades regulamentadas do setor financeiro e as entidades financeiras não regulamentadas. O efeito das medidas introduzidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013 deve ser excluído. As perdas dado o incumprimento devem ser expressas como um valor entre 0 e 1.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0131	LGD sem medidas de supervisão		As perdas dado o incumprimento (LGD) sem medidas de supervisão são as LGD baseadas no disposto nos artigos 179.º e 181.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, que incluem a margem de prudência (MoC) acrescentada pela instituição, mas excluem as medidas (multiplicadores, acréscimos, limites mínimos ou medidas semelhantes que aumentam diretamente as LGD) que tenham sido impostas pelas autoridades competentes. Para as carteiras correspondentes a um grau ou categoria individual, devem ser comunicadas as perdas dado o incumprimento para esse grau incluindo a margem de prudência, mas excluindo as medidas de supervisão. Para as carteiras correspondentes a um agrupamento de devedores de diferentes graus ou categorias, devem ser indicadas as perdas dado o incumprimento médias ponderadas pela posição em risco em incumprimento das posições em risco respetivas, incluindo as margens de prudência, mas excluindo as medidas de supervisão. As perdas dado o incumprimento sem medidas de supervisão devem ser expressas como um valor entre 0 e 1. Caso a instituição não esteja em condições de isolar os ajustamentos conservadores relevantes, aplica-se o ponto 3 da Parte I.
0132	LGD sem margem de prudência e sem medidas de supervisão		As perdas dado o incumprimento (LGD) sem margem de prudência (MoC) são as LGD que não incluem a margem de prudência (MoC) acrescentada pela instituição em conformidade com o artigo 179.º, n.º 1, alínea f), e o artigo 181.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, nem o efeito das medidas impostas pelas autoridades competentes (multiplicadores, acréscimos, limites mínimos ou medidas semelhantes que aumentam diretamente as LGD). Para as carteiras correspondentes a um grau ou categoria individual, devem ser comunicadas as perdas dado o incumprimento para esse grau que não incluem a margem de prudência e as medidas de supervisão. Para as carteiras correspondentes a um agrupamento de devedores de diferentes graus ou categorias, devem ser indicadas as LGD médias ponderadas pela posição em risco em incumprimento das posições em risco respetivas excluindo a margem de prudência e as medidas de supervisão. As perdas dado o incumprimento sem a margem de prudência e as medidas de supervisão devem ser expressas como um valor entre 0 e 1. Caso a instituição não esteja em condições de isolar os ajustamentos conservadores relevantes, aplica-se o ponto 3 da Parte I.
0133	LGD sem margem de prudência, medidas de supervisão e componente de contração económica,		As perdas dado o incumprimento (LGD) sem margem de prudência (MoC), medidas de supervisão e componente de contração económica são as LGD que não incluem a margem de prudência (MoC) acrescentada pela instituição em conformidade com o artigo 179.º, n.º 1, alínea f), e o artigo 181.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013, nem o efeito das medidas impostas pelas autoridades competentes (multiplicadores, acréscimos, limites mínimos ou medidas semelhantes que aumentam diretamente as LGD), nem a componente de contração económica exigida pelo artigo 181.º, n.º 1, alínea b), do referido regulamento. Para as carteiras correspondentes a um grau ou categoria individual, devem ser comunicadas as perdas dado o incumprimento para esse grau excluindo as margens de prudência, as medidas de supervisão e a componente de contração económica. Para as carteiras correspondentes a um agrupamento de devedores de diferentes graus ou categorias, devem ser indicadas as perdas dado o incumprimento médias ponderadas pela posição em risco em incumprimento das posições em risco respetivas, excluindo a margem de prudência, as medidas de supervisão e a componente de contração económica.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			As perdas dado o incumprimento (LGD) sem a margem de prudência (MoC) as medidas de supervisão e a componente de contração económica devem ser expressas como um valor entre 0 e 1. Caso a instituição não esteja em condições de isolar os ajustamentos conservadores relevantes, aplica-se o ponto 3 da Parte I.
0140	Prazo de vencimento	Modelo C 08.01, coluna 0250, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o prazo de vencimento ponderado pela posição em risco em incumprimento. Deve ser expresso em número de dias. Esta informação não deve ser comunicada no que se refere às posições em risco cujo vencimento não é um elemento do cálculo dos montantes das posições ponderadas pelo risco (RWA). Mais especificamente, o prazo de vencimento não deve ser comunicado para as carteiras que representam posições em risco da classe "Retalho".
0150	Montante das perdas esperadas	Modelo C 08.01, coluna 0280, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão	Deve comunicar-se o montante das perdas esperadas.
0160	Provisões para posições em risco em situação de incumprimento	Modelo C 09.02, colunas 0050, 0055 e 0060, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Devem comunicar-se as provisões para posições em risco em incumprimento. Estas devem incluir todos os ajustamentos para o risco geral e específico de crédito das posições em risco em incumprimento, como especificado no artigo 110.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Se uma instituição efetuar ajustamentos (únicos) para o risco de crédito no contexto de alterações da aplicação da definição de incumprimento, deve comunicá-los tal como registados na sua base de dados.
0170	Montante das posições ponderadas pelo risco ("RWA")	Modelo C 08.01, coluna 0260, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o montante das posições ponderadas pelo risco após a aplicação de fatores de apoio (às PME e às infraestruturas). O montante das posições ponderadas pelo risco deve excluir o efeito de eventuais medidas introduzidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013.
0180	RWA Normalizados	Parte III, título II, capítulo 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	O RWA normalizado é o montante hipotético do RWA obtido com a aplicação do Método Padrão para o risco de crédito às posições em risco em vez do Método das Notações Internas (IRB).

C 103 — Informações pormenorizadas sobre as posições em risco em carteiras com alto risco de incumprimento

Para as carteiras referidas no anexo I relativamente às quais o estado das cauções é diferente de "Não aplicável", as informações seguintes podem ser omitidas se o modelo homologado não previr cálculos de perdas dado o incumprimento distintos para a parte garantida e não garantida de uma posição em risco: Perdas dado o incumprimento (LGD) (coluna 0130); LGD sem medidas de supervisão (coluna 0131); LGD sem margem de prudência e sem medidas de supervisão (coluna 0132); LGD sem MoC, medidas de supervisão e componente de contração económica (coluna 0133); Montante das perdas esperadas (coluna 0150); Montante das posições ponderadas pelo risco (RWA) (coluna 0170); Taxa de perdas no último ano (coluna 0210); Taxa de perdas nos últimos 5 anos (coluna 0220).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	ID da carteira		Deve ser comunicado o ID da carteira do modelo C 103, coluna 0010, do anexo I, que define a carteira. Este ID deve identificar uma linha e ser único para cada linha do modelo. A afetação das posições em risco aos identificadores de carteira não é exclusiva: as posições em risco ou partes das posições em risco devem ser comunicadas para cada identificador de carteira aplicável.
0040	Número de devedores		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0040, do anexo I.
0060	PD		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0060, do anexo I.
0061	PD sem medidas de supervisão		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0061, do anexo I.
0062	PD sem margem de prudência e medidas de supervisão		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0062, do anexo I.
0080	Posição em risco inicial antes da aplicação dos fatores de conversão		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0080, do anexo I.
0090	Posição em risco após efeitos de substituição CRM (redução do risco de crédito) e antes da aplicação de fatores de conversão de crédito		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0090, do anexo I.
0100	Fator de conversão de crédito ("CCF")		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0100, do anexo I.
0110	Posição em risco em incumprimento ("EAD")		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0110, do anexo I.
0120	Valor das cauções		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0120, do anexo I.
0130	Perdas dado o incumprimento ("LGD")		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0130, do anexo I.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0131	LGD sem medidas de supervisão		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0131, do anexo I.
0132	LGD sem margem de prudência e sem medidas de supervisão		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0132, do anexo I.
0133	LGD sem margem de prudência, medidas de supervisão e componente de contração económica		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0133, do anexo I.
0140	Prazo de vencimento		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0140, do anexo I.
0150	Montante das perdas esperadas		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0150, do anexo I.
0160	Provisões para posições em risco em situação de incumprimento		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0160, do anexo I.
0170	Montante das posições ponderadas pelo risco ("RWA")		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0170, do anexo I.
0180	RWA Normalizados		São aplicáveis as instruções para o modelo C 102, coluna 0180, do anexo I.
0190	Taxa de incumprimento no último ano		Deve comunicar-se a taxa de incumprimento relativa ao último ano. Para esse efeito, a taxa de incumprimento é definida como o rácio entre os seguintes valores: a) A soma das posições em risco (posição em risco inicial indicada na coluna 0080, medida na data de referência menos um ano) que não se encontravam em incumprimento exatamente um ano antes da data de referência, mas entraram em incumprimento entre a data de referência menos um ano e a data de referência; b) A soma das posições em risco (posição em risco inicial indicada na coluna 0080, medida na data de referência menos um ano) que não se encontravam em incumprimento na data de referência menos um ano. As novas posições em risco que foram geradas durante o ano anterior à data de referência não devem ser incluídas. As posições em risco que entraram em incumprimento e foram resolvidas novamente durante o ano anterior à data de referência devem ser incluídas tanto no numerador como no denominador. Os múltiplos incumprimentos de um mesmo devedor devem ser incluídos apenas uma vez.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			Estas informações só devem ser comunicadas para os identificadores de carteira que digam respeito a posições em risco "sem incumprimento". Devem ser expressas como um valor entre 0 e 1. Os incumprimentos e as datas de incumprimento devem ser utilizados tal como registados de acordo com a definição de incumprimento aplicável à data do evento, ou seja, uma instituição deve considerar que ocorreu um incumprimento tendo em conta a definição de incumprimento por si aplicada no momento em que o evento foi registado. As alterações da definição de incumprimento só devem ser consideradas prospetivamente a partir da respetiva data de aplicação. Inversamente, não é permitido aplicar retrospetivamente alterações da definição de incumprimento introduzidas após o evento de incumprimento em causa (simulação retrospetiva).
0200	Taxa de incumprimento dos últimos 5 anos		Deve comunicar-se a média ponderada das taxas de incumprimento registadas nos últimos cinco anos anteriores à data de referência. Deve aplicar-se a definição de taxa de incumprimento referida na coluna 0190. As ponderações a utilizar são as posições em risco sem incumprimento utilizadas no cálculo da taxa de incumprimento em conformidade com a coluna 0190. Caso a instituição não tenha de calcular uma taxa de incumprimento para os 5 anos anteriores à data de referência nos termos do artigo 180.º, n.º 1, alínea h), ou n.º 2, alínea e), do Regulamento (UE) n.º 575/2013, deve desenvolver um indicador recorrendo a dados relativos ao mais longo período possível até 5 anos antes dessa mesma data de referência e fornecer toda a documentação sobre o cálculo à sua autoridade competente. Estas informações só devem ser comunicadas para os identificadores de carteira que digam respeito a posições em risco "sem incumprimento". Devem ser expressas como um valor entre 0 e 1. Os incumprimentos e as datas de incumprimento devem ser utilizados tal como registados de acordo com a definição de incumprimento aplicável à data do evento, ou seja, uma instituição deve considerar que ocorreu um incumprimento tendo em conta a definição de incumprimento por si aplicada no momento em que o evento foi registado. As alterações da definição de incumprimento só devem ser consideradas prospetivamente a partir da respetiva data de aplicação. Inversamente, não é permitido aplicar retrospetivamente alterações da definição de incumprimento introduzidas após o evento de incumprimento em causa (simulação retrospetiva).
0210	Taxa de perdas no último ano		Deve comunicar-se a taxa de perdas registada no último ano unicamente para os identificadores de carteira relativos às posições em risco "sem incumprimento" e "em incumprimento". Para as carteiras que não se encontram em incumprimento, a taxa de perdas deve ser a soma dos ajustamentos para o risco de crédito e das anulações aplicadas, no ano anterior à data de referência, às posições em risco que não se encontravam em incumprimento exatamente um ano antes da data de referência e que entraram em incumprimento durante o ano anterior à data de referência, dividida pela soma da posição em risco em incumprimento, medida exatamente um ano antes da data de referência, das posições em risco que não se encontravam em incumprimento exatamente um ano antes da data de referência e que entraram em incumprimento durante o ano anterior à data de referência.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			O numerador da taxa de perdas deve incorporar todos os ajustamentos para o risco de crédito e as anulações relativos às posições em risco que entraram em incumprimento no ano anterior à data de referência, incluindo os ajustamentos para o risco de crédito aplicados antes da data de incumprimento. As novas posições em risco geradas durante o ano anterior à data de referência não devem ser incluídas. As posições em risco que entraram em incumprimento e foram resolvidas novamente durante o ano anterior à data de referência devem ser incluídas no denominador da taxa de perdas e os ajustamentos para o risco de crédito e as anulações relativos a essas posições em risco devem ser considerados no numerador da taxa de perdas. Os múltiplos incumprimentos de um mesmo devedor só devem ser tidos em conta uma vez. No que diz respeito às carteiras em incumprimento, a taxa de perdas deve ter em conta as posições em risco que se encontravam em incumprimento exatamente um ano antes da data de referência e deve ser a soma: a) dos ajustamentos para o risco de crédito aplicados a estas posições em risco um ano antes da data de referência; e b) dos ajustamentos para o risco de crédito e das anulações aplicadas no ano anterior à data de referência, dividida pela soma da posição em risco em incumprimento (EAD), medida exatamente um ano antes da data de referência das posições em risco em causa. Os novos incumprimentos durante o ano anterior à data de referência não devem ser incluídos. As posições em risco que foram resolvidas novamente durante o ano anterior à data de referência devem ser incluídas no denominador da taxa de perdas e os ajustamentos para o risco de crédito e as anulações relativos a essas posições em risco devem ser incluídos no numerador da taxa de perdas. Os múltiplos incumprimentos de um mesmo devedor devem ser incluídos apenas uma vez. A taxa de perdas deve ser expressa como um valor entre 0 e 1. Os incumprimentos e as datas de incumprimento devem ser utilizados tal como registados de acordo com a definição de incumprimento aplicável à data do evento, ou seja, uma instituição deve considerar que ocorreu um incumprimento tendo em conta a definição de incumprimento por si aplicada no momento em que o evento foi registado. As alterações da definição de incumprimento só devem ser consideradas prospetivamente a partir da respetiva data de aplicação. Inversamente, não é permitido aplicar retrospetivamente alterações da definição de incumprimento introduzidas após o evento de incumprimento em causa (simulação retrospetiva).
0220	Taxa de perdas nos últimos 5 anos		Deve comunicar-se a média ponderada pela posição em risco em incumprimento das taxas de perdas registadas nos últimos cinco anos anteriores à data de referência unicamente para os identificadores de carteira relativos às posições em risco "não em incumprimento" e "em incumprimento". Deve aplicar-se o cálculo para a taxa de perdas referido na coluna 0210. A taxa de perdas nos últimos 5 anos deve basear-se nas taxas de perdas anuais dos últimos cinco anos, sendo estas definidas por analogia com a definição de taxa de perdas da coluna 0210. Mais especificamente, as taxas de perdas anuais não podem incluir alterações adicionais dos ajustamentos para o risco de crédito nem anulações ocorridas após o período de observação (ano civil) de cada taxa de perdas anual. Caso a instituição não tenha de usar dados relativos aos 5 anos anteriores à data de referência nos termos do artigo 181.º, n.º 2, último parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 575/2013, deve desenvolver um indicador recorrendo a dados relativos ao mais longo período possível até 5 anos antes dessa mesma data de referência e fornecer toda a documentação sobre o cálculo à sua autoridade competente. A taxa de perdas deve ser expressa como um valor entre 0 e 1. Os incumprimentos e as datas de incumprimento devem ser utilizados tal como registados de acordo com a definição de incumprimento aplicável à data do evento, ou seja, uma instituição deve considerar que ocorreu um incumprimento tendo em conta a definição de incumprimento por si aplicada no momento em que o evento foi registado. As alterações da definição de incumprimento só devem ser consideradas prospetivamente a partir da respetiva data de aplicação. Inversamente, não é permitido aplicar retrospetivamente alterações da definição de incumprimento introduzidas após o evento de incumprimento em causa (simulação retrospetiva).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0250	RWA-		As instituições devem calcular e comunicar os RWA- para as carteiras a que se refere o anexo I, modelo 103, com o seguinte identificador de carteira: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL O RWA- deve ser o montante hipotético das posições ponderadas pelo risco, após a aplicação de fatores de apoio, que resulta da aplicação dos valores de PD- em lugar dos valores de probabilidade de incumprimento da instituição, para cada posição em risco. Os restantes parâmetros necessários para o cálculo não devem ser alterados. A PD- deve basear-se num cálculo efetuado separadamente para cada grau de devedor. Devem ser usados os graus de devedores comunicados na coluna 0005 do modelo C 08.02 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão (para as instruções, ver o anexo II do mesmo regulamento, modelo C 08.01, coluna 0010, e modelo C 08.02). Para cada grau de devedor, p^{-} deve ser o menor valor positivo que satisfaz a equação $$p^{-} + \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{-} \bullet (1 - p^{-})}{n}} \geq DR_{1y}$$ onde $DR_{1y} > 0$, e $p^{-} := 0$ em que $DR_{1y} = 0$. Nesta equação, Φ^{-1} = função inversa da distribuição-padrão normal (cumulativa); q = nível de confiança, fixado em 90 %; DR_{1y} = taxa de incumprimento, ponderada por casos, do ano anterior à data de referência, ou seja, o número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau de devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência e que entraram em incumprimento durante o último ano, dividido pelo número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau de devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência; n = número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau do devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência. Para cada devedor, a PD- deve ser calculada como p^{-}, em que p^{-} deve ser calculado de acordo com a fórmula estabelecida no quarto parágrafo para o grau de devedor atribuído ao devedor.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0260	RWA+		As instituições devem calcular e comunicar os RWA+ para as carteiras a que se refere o anexo I, modelo 103, com o seguinte identificador de carteira: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL O RWA+ deve ser o montante hipotético das posições ponderadas pelo risco, após a aplicação de fatores de apoio, que resulta da aplicação dos valores de PD+ em lugar dos valores de probabilidade de incumprimento da instituição, para cada posição em risco. Os restantes parâmetros necessários para o cálculo não devem ser alterados. A PD+ deve basear-se num cálculo efetuado separadamente para cada grau de devedor. Devem ser utilizados os graus de devedores relatados na coluna 0005 do modelo C 08.02 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão (para as instruções, ver o modelo C 08.01, coluna 0010, e o modelo C 08.02 do anexo II do mesmo regulamento). Para cada grau de devedor, p^{+} deve ser o maior valor positivo que satisfaz a equação $$p^{+} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{+} \bullet (1 - p^{+})}{n}} \leq DR_{1y}$$ Nesta equação, Φ^{-1} = função inversa da distribuição-padrão normal (cumulativa); q = nível de confiança, fixado em 90 %; DR_{1y} = taxa de incumprimento, ponderada por casos, do ano anterior à data de referência, ou seja, o número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau de devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência e que entraram em incumprimento durante o último ano, dividido pelo número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau de devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência; n = número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau do devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência. Para cada devedor, a PD- deve ser calculada como p^{+}, em que p^{+} deve ser calculado de acordo com a fórmula estabelecida no quarto parágrafo para o grau de devedor atribuído ao devedor.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0270	RWA–		As instituições devem calcular e comunicar os RWA– para as carteiras a que se refere o anexo I, modelo 103, com o seguinte identificador de carteira: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL O RWA– deve ser o montante hipotético das posições ponderadas pelo risco, após a aplicação de fatores de apoio, que resulta da aplicação dos valores de PD-- em lugar dos valores de probabilidade de incumprimento da instituição, para cada posição em risco. Os restantes parâmetros necessários para o cálculo não devem ser alterados. A PD-- deve basear-se num cálculo efetuado separadamente para cada grau de devedor. Devem ser usados os graus de devedores comunicados na coluna 0005 do modelo C 08.02 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão (para as instruções, ver o anexo II do mesmo regulamento, modelo C 08.01, coluna 0010, e modelo C 08.02). Para cada grau de devedor, p^{--} deve ser o menor valor positivo que satisfaz a equação $$p^{--} + \Phi^{-1}(q) \cdot \sqrt{\frac{p^{--} \cdot (1 - p^{--})}{n}} \geq DR_{5y}$$ onde $DR_{5y} > 0$, e $p^{--} := 0$ em que $DR_{5y} = 0$ Nesta equação, Φ^{-1} = função inversa da distribuição-padrão normal (cumulativa); q = nível de confiança, fixado em 90 %; DR_{5y} = taxa de incumprimento dos últimos 5 anos do grau de devedor, calculada como a média simples das cinco últimas taxas de incumprimento de um período de um ano, ponderadas em função dos casos; n = número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau do devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência. Para cada devedor, a PD-- deve ser calculada como p^{--}, em que p^{--} deve ser calculado de acordo com a fórmula estabelecida no quarto parágrafo para o grau de devedor atribuído ao devedor.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0280	RWA++		As instituições devem calcular e comunicar os RWA++ para as carteiras a que se refere o anexo I, modelo 103, com o seguinte identificador de carteira: CORP_ALL_0086_CT_****_**_***_ALL SMEC_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL MORT_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL SMOT_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RSMS_ALL_0106_CT_****_**_***_ALL RETO_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL RQRR_ALL_0094_CT_****_**_***_ALL O RWA++ deve ser o montante hipotético das posições ponderadas pelo risco, após a aplicação de fatores de apoio, que resulta da aplicação dos valores de PD++ em lugar dos valores de probabilidade de incumprimento da instituição, para cada posição em risco. Os restantes parâmetros necessários para o cálculo não devem ser alterados. A PD++ deve basear-se num cálculo efetuado separadamente para cada grau de devedor. Devem ser utilizados os graus de devedores relatados na coluna 0005 do modelo C 08.02 do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão (para as instruções, ver o modelo C 08.01, coluna 0010, e o modelo C 08.02 do anexo II do mesmo regulamento). Para cada grau de devedor, p^{++} deve ser o maior valor positivo que satisfaz a equação $$p^{++} - \Phi^{-1}(q) \bullet \sqrt{\frac{p^{++} \bullet (1 - p^{++})}{n}} \leq DR_{5y}$$ em que, Φ^{-1} = função inversa da distribuição-padrão normal (cumulativa); q = nível de confiança, fixado em 90 %; DR_{5y} = taxa de incumprimento dos últimos 5 anos do grau de devedor, calculada como a média simples das cinco últimas taxas de incumprimento de um período de um ano, ponderadas em função dos casos; n = número de devedores que não se encontravam em incumprimento e a quem era atribuído o grau do devedor em causa exatamente um ano antes da data de referência. Para cada devedor, a PD++ deve ser calculada como p^{++}, em que p^{++} deve ser calculado de acordo com a fórmula estabelecida no quarto parágrafo para o grau de devedor atribuído ao devedor.

C 105.01 – Definição de modelos internos

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	ID do modelo interno		A instituição deve relatar o ID do modelo interno atribuído pela autoridade competente. Caso tal não esteja disponível, a instituição deve relatar o ID do modelo interno atribuído por si própria. O ID do modelo interno deve referir-se unicamente a um modelo interno aprovado pela autoridade competente e utilizado para calcular o montante das posições ponderadas pelo risco. Este ID deve identificar uma linha e ser único para cada linha do modelo.
0020	Nome do modelo		Deve comunicar-se o nome atribuído ao modelo interno pela instituição que comunica.
0030	Parâmetro de risco do Método das Notações Internas (IRB)		O parâmetro de risco do método IRB deve ser um dos seguintes: a) Probabilidade de incumprimento (PD); b) Perdas dado o incumprimento (LGD); c) Fator de conversão de crédito (CCF). No caso de um modelo interno aplicável a Posições em risco sobre Empresas – Empréstimos especializados nos termos do artigo 153.º, n.º 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 ("Critérios de afetação de crédito especializado"), o campo deve ser deixado em branco ou preenchido com a indicação "NULO".
0040	Posição em risco em incumprimento ("EAD")	Modelo C 08.01, coluna 0110, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão	Deve comunicar-se o valor agregado das posições em risco abrangidas pelo âmbito de aplicação do modelo de notação.
0050	Taxa média de incumprimento ponderada pela posição em risco em incumprimento para efeitos de calibração		Deve comunicar-se a média das taxas de incumprimento anuais ponderada pela posição em risco em incumprimento, quando utilizada na calibração dos modelos de probabilidade de incumprimento. Estas informações só devem ser completadas para os modelos de probabilidade de incumprimento. Devem ser utilizados os dados introduzidos na calibração dos parâmetros do modelo. Se não existirem dados internos e a calibração se basear em dados externos, devem ser comunicados os dados externos.
0060	Taxa média de incumprimento ponderada pelos casos para efeitos de calibração		Deve comunicar-se a média simples das taxas de incumprimento anuais ponderadas por casos utilizadas na calibração dos modelos de probabilidade de incumprimento. Estas informações só devem ser completadas para os modelos de probabilidade de incumprimento. Devem ser utilizados os dados introduzidos na calibração dos parâmetros do modelo. Se não existirem dados internos e a calibração se basear em dados externos, devem ser comunicados os dados externos.
0070	Probabilidade de incumprimento ("PD") a longo prazo		Deve comunicar-se a tendência central utilizada pela instituição na calibração dos modelos que englobe qualquer ajustamento prudente da média simples, ponderada por casos, das taxas de incumprimento anuais utilizada na calibração dos modelos de probabilidade de incumprimento. Estas informações só devem ser completadas para os modelos de probabilidade de incumprimento.
0080	Taxa de resolução dos ativos em incumprimento		A taxa de resolução dos ativos em incumprimento deve ser a percentagem de ativos em incumprimento que voltam a ser considerados em situação de "não incumprimento" ao longo de um período de 12 meses. Uma instituição que não calcule taxas de resolução para um dado modelo deve calcular um indicador de substituição para as taxas de resolução em conformidade com a definição acima. A instituição deve comunicar à autoridade competente a utilização de um indicador de substituição. Esta informação só deve ser completada para os modelos de perdas dado o incumprimento.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0090	Taxa de recuperação dos ativos penhorados na sequência de incumprimentos não resolvidos		Deve comunicar-se a taxa média de recuperação, ponderada pelos casos, para os incumprimentos não resolvidos incluídos na série cronológica utilizada pela instituição para a calibração dos modelos de perdas dado o incumprimento no que respeita a ativos que não estejam em situação de incumprimento. Devem ser utilizados os dados introduzidos na calibração dos parâmetros do modelo. Se não existirem dados internos e a calibração se basear em dados externos, devem ser comunicados os dados externos. Uma instituição que não disponha de uma taxa de recuperação específica para os incumprimentos não resolvidos, em virtude de um procedimento de recuperação incompleto, deve calcular um indicador de substituição tendo em conta as recuperações observadas e as estimativas das recuperações no que respeita às negociações por concluir. A instituição deve comunicar à autoridade competente a utilização de um indicador de substituição. Esta informação só deve ser completada para os modelos de perdas dado o incumprimento.
0100	Duração do período de recuperação para os ativos penhorados na sequência de incumprimentos não resolvidos		Deve comunicar-se a duração média, ponderada pelos casos, do período de recuperação (desde o início da situação de incumprimento até à data de conclusão dos procedimentos de recuperação) para os incumprimentos não resolvidos incluídos na série cronológica utilizada pela instituição para a calibração dos modelos de perdas dado o incumprimento no que respeita a ativos que não estejam em situação de incumprimento. A duração média ponderada pelos casos deve ser expressa em número de dias. Devem ser utilizados os dados introduzidos na calibração dos parâmetros do modelo. Se não existirem dados internos e a calibração se basear em dados externos, devem ser comunicados os dados externos. Uma instituição que não disponha de um período de recuperação específico para os incumprimentos não resolvidos, em virtude de um procedimento de recuperação incompleto, deve calcular um indicador de substituição em conformidade com a definição estabelecida. A instituição deve comunicar à autoridade competente a utilização de um indicador de substituição. Esta informação só deve ser completada para os modelos de perdas dado o incumprimento.
0110	Decisão conjunta	Artigo 20.º, n.º 2, alínea a), do Regulamento (UE) n.º 575/2013	A instituição deve comunicar a existência ou inexistência de uma decisão conjunta em matéria de requisitos prudenciais entre a autoridade de consolidação e a autoridade do país de acolhimento competente no que respeita à autorização para utilizar o Método IRB para o cálculo dos requisitos prudenciais aplicáveis às posições em risco detidas pelas filiais das instituições nas carteiras de referência comunicadas.
0120	Supervisor em base consolidada	Artigo 20.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o código ISO do país de origem da autoridade competente responsável pela supervisão em base consolidada de uma instituição que utiliza o Método IRB.
0130	Montante das posições ponderadas pelo risco ("RWA")	Modelo C 08.01, coluna 0260, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o montante agregado das posições ponderadas pelo risco após a aplicação de fatores de apoio (às PME e às infraestruturas) das posições em risco abrangidas pelo âmbito de aplicação do modelo de notação.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0140	Acréscimos dos RWA		Os acréscimos dos RWA devem ser uma subposição ("dos quais") do montante das exposições ponderadas pelo risco (RWA) (Modelo C105.01, coluna 0130) e devem incluir: a) O RWA acrescentado ao montante das posições ponderadas pelo risco em resultado da aplicação de parâmetro(s) de risco do modelo devido a eventuais medidas internas de prudência adicionais diretamente aplicadas ao RWA; b) O RWA acrescentado ao montante das posições ponderadas pelo risco em resultado da aplicação de parâmetro(s) de risco do modelo devido a eventuais medidas de supervisão diretamente aplicadas ao RWA. Os montantes referidos nas alíneas a) e b) não podem incluir medidas já refletidas na Probabilidade de incumprimento (PD) (coluna 0060 dos modelos C 102 e C 103), no Fator de conversão de crédito (CCF) (coluna 0100 dos modelos C 102 e C 103) ou nas Perdas dado o incumprimento (LGD) (coluna 0130 dos modelos C 102 e C 103), devendo limitar-se a medidas diretamente aplicadas ao RWA e, se for caso disso, adicionais às margens de prudência e às medidas de supervisão (multiplicadores, acréscimos, limites mínimos ou medidas semelhantes) que incrementem os parâmetros de risco. Os acréscimos do montante das posições ponderadas pelo risco devem excluir o efeito de eventuais medidas introduzidas em conformidade com o artigo 458.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Caso a instituição não esteja em condições de isolar os ajustamentos conservadores relevantes, aplica-se o ponto 3 da Parte I.

C 105.02 – Identificação dos modelos internos em função das carteiras

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	ID da carteira	Modelos C102, coluna 0010, e C103, coluna 0010	Deve comunicar-se o ID da carteira que identifica a carteira de forma única em conformidade com os modelos C 102 e C 103 do anexo I. As colunas 0010 e 0020, em conjunto, identificam uma linha e devem, também em conjunto, ser únicas para cada linha deste modelo.
0020	ID do modelo interno	Modelo C 105.01, coluna 0010	Deve comunicar-se o identificador ID do modelo interno atribuído pela instituição que comunica. As colunas 0010 e 0020, em conjunto, identificam uma linha e devem, também em conjunto, ser únicas para cada linha do modelo C 105.02.
0030	Posição em risco em incumprimento ("EAD")	Modelo C 08.01, coluna 0110, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451 da Comissão	Deve comunicar-se o valor agregado das posições em risco incluídas na carteira definida na coluna 0010 e abrangidas pelo âmbito de aplicação do modelo de notação definido na coluna 0020. Se todas as operações de uma determinada carteira são tratadas com um modelo específico, o valor de posição em risco deve ser idêntico ao montante comunicado para a mesma carteira na coluna 0110 do modelo 102 ou 103, conforme aplicável.
0040	Montante das posições ponderadas pelo risco ("RWA")	Modelo C 08.01, coluna 0260, do anexo I do Regulamento de Execução (UE) 2021/451	Deve comunicar-se o montante agregado das posições ponderadas pelo risco após a aplicação de fatores de apoio referente às posições em risco incluídas na carteira definida na coluna 0010 e abrangidas pelo âmbito de aplicação do modelo de notação definido na coluna 0020. Se todas as posições em risco de uma determinada carteira são tratadas com um modelo específico, o montante agregado das posições ponderadas pelo risco deve ser idêntico ao montante comunicado para a mesma carteira na coluna 0170 dos modelos C 102 ou C 103, conforme aplicável.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 105.03 – Identificação dos modelos internos em função dos países

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0005	ID da linha		Este código deve identificar uma linha e ser único para cada linha do modelo. Deve seguir a ordem numérica 1, 2, 3, etc.
0010	ID do modelo interno	Modelo C 105.01, coluna 0010	Deve comunicar-se o identificador ID do modelo interno atribuído pela instituição que comunica. Caso o ID do modelo interno esteja associado a vários países, devem ser comunicadas linhas separadas para cada combinação dos campos "ID do modelo interno" e "Localização da instituição". As colunas 0010 e 0020, em conjunto, identificam uma linha e o seu conjunto deve ser único para cada linha do quadro.
0020	Localização da instituição	Artigo 20.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o código ISO de país da residência legal de cada filial em que as posições em risco calculadas pelo Método IRB comunicadas para cada carteira de análise comparativa estão inscritas, independentemente da existência de uma eventual autorização, concedida pela autoridade de supervisão do país de acolhimento, para aplicar o Método IRB.»

ANEXO II

«ANEXO V

INSTRUMENTOS E CARTEIRAS DE REFERÊNCIA PARA O RISCO DE MERCADO

Secção 1: Instruções

Secção 2: Instrumentos

Secção 3: Carteiras individuais — Instrumento único

Secção 4: Carteiras individuais — Instrumentos múltiplos

Secção 5: Carteiras agregadas

Secção 6: Especificações adicionais para os instrumentos

Secção 7: Carteiras de validação SBM

Secção 1: Instruções

(a) Para efeitos do presente anexo, aplicam-se as seguintes definições:

(i) "data de contabilização", a data e a hora em que as instituições contabilizam as operações para efeitos do exercício de avaliação comparativa,

(ii) "avaliação de mercado inicial (IMV)", o valor a preços de mercado dos instrumentos a que se refere a secção 2 do presente anexo, na data e hora de referência da IMV,

(iii) "data de referência da IMV", a data e a hora em que as instituições devem determinar a IMV das operações na carteira de referência,

(iv) "data de envio da IMV", a data até à qual as instituições devem apresentar os resultados da IMV das operações na carteira de referência,

(v) "VaR", o valor em risco,

(vi) "sVaR", o valor em risco em situação de esforço,

(vii) "IRC", o requisito de fundos próprios para riscos adicionais,

(viii) "CTP", a carteira de negociação de correlação,

(ix) "APR", o valor de todos os riscos de preço, calculado em conformidade com o artigo 377.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013,

(x) "medidas do risco" (RM), o valor do VaR, do sVaR e, quando exigido, do IRC e do APR para as carteiras, como estabelecido nas secções 3, 4 e 5 do presente anexo, entre a data de referência inicial e a data de referência final das RM,

(xi) "data de referência inicial das RM", a data em que as instituições começam a calcular os valores das RM,

(xii) "data de referência final das RM", a data em que as instituições devem terminar o cálculo dos valores das RM,

(xiii) "data de envio da RM", a data até à qual as instituições devem apresentar os resultados da RM das operações na carteira de referência,

(xiv) "valor atual (PV)", o valor a preços de mercado das carteiras, estabelecido na secção 3 do presente anexo, na data de referência final das RM,

(xv) "ATM", "com valor intrínseco equivalente" em termos da posição relativa do preço atual ou futuro do ativo subjacente a um derivado quando comparada com o preço de exercício desse derivado,

(xvi) "OTM", "com valor intrínseco negativo" em termos da posição relativa do preço atual ou futuro do ativo subjacente a um derivado quando comparada com o preço de exercício desse derivado,

(xvii) "ITM", "com valor intrínseco positivo" em termos da posição relativa do preço atual ou futuro do ativo subjacente a um derivado quando comparada com o preço de exercício desse derivado,

(xviii) "longo" significa "comprado" e "curto" significa "vendido",

(xix) "CDS", swaps de risco de incumprimento,

(xx) no que respeita aos swaps de risco de incumprimento, "longo" significa "proteção adquirida" e "curto" significa "proteção vendida",

(xxi) "MLN", milhões,

(xxii) "OTC", mercado de balcão,

(xxiii) "ASA", o método padrão alternativo referido na parte III, título IV, capítulo 1-A, secção 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013,

(xxiv) "SBM", o método baseado nas sensibilidades referido na parte III, título IV, capítulo 1-A, secção 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013,

(xxv) "DRC", o requisito de fundos próprios para risco de incumprimento referido na parte III, título IV, capítulo 1-A, secção 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013,

(xxvi) "RRAO", o acréscimo dos riscos residuais referido na parte III, título IV, capítulo 1-A, secção 4, do Regulamento (UE) n.º 575/2013.

(b) As seguintes datas aplicam-se ao exercício de avaliação comparativa:

(i) a data de contabilização é 30 de janeiro de 2025,

(ii) a data de referência da IMV (e inicial do SBM) é 6 de fevereiro de 2025 (às 17h30 HEC),

(iii) a data de envio da IMV (e inicial do SBM, e de validação do SBM) é 28 de fevereiro de 2025,

(iv) a data de referência inicial das RM é 2 de junho de 2025,

(v) a data de referência final das RM (e final do ASA) é 13 de junho de 2025,

(vi) a data de envio das RM (e final do ASA) é 18 de julho de 2025.

(c) Salvo disposição expressa em contrário na secção 2 do presente anexo, todas as posições devem ser contabilizadas na data de contabilização referida na alínea b), subalínea i), da presente secção. Uma vez contabilizadas as posições, cada carteira evoluirá durante a duração do exercício de análise comparativa, devendo ser calculada com base no pressuposto de que a instituição não toma qualquer medida para gerir a carteira de forma alguma durante todo o período do exercício de análise comparativa. Salvo indicação expressa em contrário nas especificações de um determinado instrumento, os preços de exercício das posições sobre opções devem ser determinados em relação aos preços de mercado do instrumento subjacente, conforme registados aquando do encerramento do mercado na data de contabilização.

(d) Para efeitos da avaliação de mercado inicial, a avaliação de cada instrumento deve ser apresentada à autoridade competente da instituição até à data de envio da IMV. Até essa data, a instituição deve apresentar uma nota explicativa juntamente com os resultados, em conformidade com a alínea e). A IMV deve ser fornecida em conformidade com a avaliação dos serviços operativos da instituição, sempre que possível. Caso as IMV não sejam fornecidas pelos serviços operativos da instituição, a instituição deve especificar na nota explicativa a identidade da fonte de dados sobre a IMV.

(e) A nota explicativa que as instituições devem apresentar juntamente com a IMV deve incluir todos os seguintes elementos para cada instrumento:

(i) os fatores de risco utilizados para calcular a IMV do instrumento,

(ii) o modelo de fixação de preços utilizado para calcular a IMV do instrumento e uma descrição desse modelo de determinação de preços,

(iii) os fatores de risco incluídos no modelo VaR para o instrumento,

(iv) os fatores de risco incluídos no modelo VaR que constituem também dados de avaliação para a IMV do instrumento,

(v) as especificidades do modelo VaR no que se refere ao instrumento,

(vi) dados de referência disponíveis para o instrumento no formato da instituição,

(vii) os aspetos referidos nas alíneas h), i), k), m), n), o), v), w), y), gg) e kk) da presente secção.

(f) Para efeitos da alínea e), subalínea v), devem ser comunicados todos os seguintes elementos:

(i) descrições concisas do modelo VaR,

(ii) métodos de reavaliação aplicados,

(iii) função aplicada para a modelização dos rendimentos (por exemplo, absolutos, relativos, outros métodos),

(iv) informações qualitativas sobre as séries cronológicas utilizadas para calibrar o modelo VaR em relação ao instrumento (como fonte, metodologia de normalização, escalões aplicados, outras informações consideradas relevantes pelas instituições para explicar os resultados fornecidos).

(g) A nota explicativa referida na alínea d) deve ser atualizada cada vez que é apresentado um novo valor, refletindo as diferenças entre as apresentações. A nota explicativa deve conter uma secção que enumera todas as datas de apresentação e os motivos das novas apresentações.

(h) Os riscos das posições devem ser calculados sem ter em conta os custos de financiamento. Se aplicável, as instituições devem utilizar a taxa overnight da moeda do instrumento como taxa de desconto. O acordo de garantia deve ser considerado em vigor para os instrumentos derivados referidos na secção 2 do presente anexo. Se tal não for possível, deve ser fornecida uma justificação na nota explicativa referida na alínea d).

(i) O risco de crédito de contraparte e o risco de ajustamento da avaliação de crédito ("CVA") não devem ser tidos em conta na avaliação dos riscos das carteiras. Se tal não for possível, deve ser fornecida uma justificação na nota explicativa referida na alínea d) da presente secção. As instituições devem comunicar os casos em que a IMV inclui outras tipologias de ajustamentos de avaliação e explicar, para cada instrumento financeiro, a metodologia e o impacto na nota explicativa a que se refere a alínea d) da presente secção.

(j) Para as transações que incluem posições longas em CDS, as instituições devem assumir que uma comissão inicial imediata é paga pela entrada na posição, de acordo com as normas e convenções do mercado. A data de vencimento de todos os CDS deve corresponder às datas de rescisão trimestrais convencionais.

(k) As especificações adicionais necessárias para efetuar os cálculos dos preços das posições sobre CDS devem ser coerentes com as normas e convenções de mercado comummente utilizadas e devem ser explicadas na nota explicativa referida na alínea d) da presente secção.

(l) A data de vencimento deve permitir que a transação se aproxime o mais possível do prazo de vencimento especificado, em conformidade com as normas e convenções de mercado.

(m) No que diz respeito aos pormenores dos instrumentos não referidos na secção 2 do presente anexo, as instituições devem apresentar os pressupostos que foram utilizados, incluindo a convenção sobre a contagem de dias e a escolha de um instrumento negociável e líquido, quando permitido, juntamente com os resultados, na nota explicativa referida na alínea d) da presente secção.

(n) As instituições que considerem que outros pressupostos para além dos especificados na presente secção são relevantes para a interpretação dos resultados do seu exercício, incluindo o momento de cessação da negociação, prolongamento de cupões, identificação em função de índices e outros, devem apresentar uma descrição desses pressupostos na nota explicativa referida na alínea d) da presente secção.

(o) A nota explicativa referida na alínea d) da presente secção deve incluir explicações sobre os riscos não contemplados pelo modelo para os instrumentos referidos na secção 2 do presente anexo.

(p) Todas as opções devem ser tratadas como se fossem negociadas no mercado de balcão, salvo indicação explícita em contrário.

(q) O calendário normalizado para as opções OTC deve ser respeitado. O prazo de vencimento de uma opção a n meses ocorre dentro de n meses. Caso as opções expirem noutro dia que não um dia de negociação, as instituições devem ajustar os prazos de vencimento em função do dia útil, de acordo com as normas e convenções do mercado.

(r) Todas as opções OTC devem ser tratadas do seguinte modo:

i) como opções "americanas" no que respeita às matérias-primas e ações uninominais,

ii) como opções "europeias" no que respeita aos índices de ações, operações cambiais e opções sobre swaps ("swaptions").

(s) Todas as opções OTC devem ser consideradas "a nu", de modo a excluir o prémio da avaliação de mercado inicial.

(t) No que se refere às CTP, as instituições autorizadas a utilizar o modelo APR devem posteriormente fornecer informações pormenorizadas sobre os pressupostos e as normas e convenções de mercado mais relevantes no que se refere aos instrumentos CTP mencionados na secção 2 do presente anexo, incluindo os rácios de cobertura que calcularam para tornar os instrumentos CTP neutros em termos de CS01 na data de contabilização.

(u) A IMV para cada instrumento deve ser fornecida na moeda do instrumento da EBA especificada na secção 2 do presente anexo para esse instrumento.

(v) No caso das carteiras compostas por um ou mais instrumentos denominados em moedas de instrumentos da EBA que sejam diferentes da moeda da carteira da EBA, o resultado deve ser convertido na moeda de carteira da EBA comunicada, utilizando a taxa de câmbio à vista do BCE da data relevante. O resultado convertido deve ser explicado na nota explicativa referida na alínea d) da presente secção.

(w) Ao contabilizarem posições, as instituições devem seguir as convenções de mercado adequadas, salvo especificação em contrário nas instruções contidas nas descrições dos instrumentos (secção 2 do presente anexo).

(x) Caso um instrumento ou um instrumento que serve de subjacente a um derivado seja objeto de uma operação empresarial com efeitos no exercício de avaliação comparativa (por exemplo, exercício de uma opção de compra pelo emitente, incumprimento ou qualquer situação similar), as instituições devem excluir esse instrumento do exercício, juntamente com todos os CDS ou opções conexos.

(y) No que diz respeito a uma série de índices, a expressão "on-the-run" refere-se à série mais líquida e mais facilmente negociável desse índice disponível no mercado. As instituições devem explicar a sua escolha da série "on-the-run", juntamente com os respetivos resultados, na nota explicativa de acompanhamento referida na alínea d) da presente secção.

(z) Salvo indicação em contrário, as instituições devem aplicar o Regulamento Índices de Referência da UE para a taxa de juro, a fim de contabilizar os instrumentos especificados na secção 2 do presente anexo. As instituições devem especificar a taxa aplicada, além das especificadas na secção 2 do presente anexo alternativa, na nota explicativa referida na alínea d) das presentes instruções.

(aa) As medidas do risco para as carteiras referidas nas secções 3, 4 e 5 do presente anexo, juntamente com o valor atual, devem ser calculadas a partir da "data de referência inicial das RM" até à "data de referência final das RM". As medidas do risco ASA FRTB (SBM, DRC e RRAO) devem ser calculadas para a "data de referência final das RM". As instituições devem apresentar os resultados desses cálculos à respetiva autoridade competente até à data de envio das RM. Deve comunicar-se a IMV e o SBM para cada instrumento. As medidas do risco, o SBM, o DRC, o RRAO e o valor atual, quando aplicável, devem ser comunicados para cada carteira, tanto individual como agregada. O SBM, o RDC e o RRAO, quando aplicável, devem ser comunicados pelo menos para as mesmas carteiras para as quais são comunicadas medidas do risco.

(bb) Para as carteiras a que se refere a secção 7 do presente anexo, as instituições devem comunicar os resultados do SBM e apresentá-los em conformidade com as datas de comunicação da apresentação das IMV.

(cc) Apenas as instituições às quais tenha sido autorizado modelar riscos específicos de instrumentos de dívida devem comunicar as carteiras de spread de crédito. Para as carteiras de taxas de juro que incluam o risco como parte de certos instrumentos, as carteiras individuais e agregadas devem ser modelizadas pelas instituições às quais tenha sido concedida autorização para modelar o risco de interesse geral, bem como pelas instituições às quais tenha sido concedida autorização para modelar o risco de taxa de juro geral e específico.

(dd) Os resultados tanto para as carteiras individuais como para as carteiras agregadas só devem ser apresentados quando os resultados dos instrumentos que fazem parte delas também são apresentados.

(ee) Na secção 2 (Instrumentos) do presente anexo, "ano T" significa "2025" e "ano T + X" significa "2025 + X", em que X corresponde ao especificado na secção 2.

(ff) Na secção 2 do presente anexo (Instrumentos), as instituições devem determinar o dia do termo de validade/vencimento de acordo com as seguintes instruções:

(i) caso seja especificada uma data, deve utilizar-se essa data específica,

(ii) caso não seja especificada uma data, deve utilizar-se a convenção de mercado, quando disponível. Caso exista, por exemplo, uma convenção de mercado segundo a qual o dia do termo de validade/vencimento é a 3.ª sexta-feira do mês, então "junho ano T" significa a 3.ª sexta-feira do mês do ano T,

(iii) por final do mês, quando for especificado "fim de", deve entender-se o último dia de calendário do mês,

(iv) para um período fixo a seguir à "data de contabilização", se o período for definido como um número de dias, é o último dia do período. Caso o período seja definido em semanas, meses ou anos, é o mesmo dia da semana, mês ou ano seguinte relativamente à data de contabilização ou, se o último mês ou ano do período for mais curto, o último dia desse mês ou ano; caso a "data de contabilização + período x" seja um feriado, selecionar o dia útil seguinte,

(v) salvo indicação em contrário, devem ser utilizados os seguintes pressupostos: Convenção sobre a contagem de dias: Act/360; Calendário: Meta2.

(gg) Na secção 2 do presente anexo (Instrumentos), aplicam-se os seguintes requisitos para todos os CDS, salvo indicação explícita em contrário:

(i) frequência do cupão: trimestral,

(ii) cupão (pontos de base): 100,

(iii) contagem de dias: Número efetivo de dias/360,

(iv) ano das definições ISDA: 2014,

(v) cláusula de reestruturação: Reestruturação modificada-modificada (MMR),

(vi) prazo de vencimento: dezembro ano T+4,

(vii) tipo de dívida: prioritária,

(viii) período de vigência: 5 anos,

(ix) data-valor igual à data de contabilização,

(x) a curva de desconto e a taxa de recuperação utilizadas devem ser explicadas na nota explicativa referida na alínea d) do presente anexo.

(hh) A avaliação de mercado inicial (IMV) de instrumentos na forma de obrigações deve incluir os juros vencidos.

(ii) As instituições devem fornecer as informações relativas ao momento da avaliação do valor atual ("PV") mencionando esse momento na nota explicativa referido na alínea d) da presente secção. Sempre que possível, a avaliação do PV deve ser calculada no final do dia útil.

(jj) As medidas do risco para as carteiras devem ser calculadas na moeda da carteira, não incluindo qualquer risco cambial, também relacionada com a moeda de comunicação das instituições. O risco cambial só deve ser tido em conta se estiver intrinsecamente incluído nos instrumentos. Caso tanto os resultados na comunicação de comunicação como os resultados na moeda de carteira sejam comunicados como parte do exercício, para os valores ASA, os resultados calculados na moeda de comunicação da instituição devem ser convertidos para a moeda da carteira da EBA por conversão à vista, utilizando a taxa de câmbio à vista do BCE associada à data do cálculo. A transposição para a moeda de carteira da EBA não implica uma alteração dos fatores de risco cambial.

(kk) Caso seja aplicável o artigo 325.º-Q, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 ("método da moeda de base"), ao efetuarem os cálculos do SBM e ao comunicarem as sensibilidades SBM, as instituições devem ter em conta os fatores de risco cambial resultantes da aplicação do método da moeda de base. Os valores comunicados não devem ser expressos na moeda de base escolhida, mas sim na moeda de comunicação das instituições, aplicando a conversão à vista utilizando a taxa de câmbio à vista do BCE associada à data relevante.

Secção 2: Instrumentos

As instituições devem fornecer a avaliação de mercado inicial ("IMV"), em conformidade com as instruções estabelecidas na secção 1 do presente anexo, para os seguintes instrumentos financeiros, quando tiverem de fornecer as medidas de risco e o valor atual das carteiras especificadas nas Secções 3 e 4:

CAPITAIS PRÓPRIOS

101. Posição longa num futuro índice EURO STOXX 50 (Ticker: FESX).

Nocional: equivalente ao valor do índice multiplicado por 1 000 EUR

Bolsa: Eurex

Data de vencimento: junho do ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

102. Posição longa sobre 10 000 ações BAYER (Ticker: BAYN GR).

Bolsa: Xetra

Moeda do instrumento da EBA: EUR

103. Posição curta num futuro sobre ações BAYER (Ticker: BAYN GR).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Bolsa: Eurex

Data de vencimento: junho do ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

104. Posição curta num futuro sobre ações STELLANTIS (Ticker: STLA FP).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Bolsa: Euronext

Data de vencimento: junho do ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

105. Posição curta num futuro sobre ações ALLIANZ (Ticker: ALV GR).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Bolsa: Eurex

Data de vencimento: junho do ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

106. Posição curta num futuro sobre ações BARCLAYS (Ticker: BARC LN).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Bolsa: Eurex

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: GBP

107. Posição curta num futuro sobre ações DEUTSCHE BANK (Ticker: DBK GR).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Bolsa: Eurex

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

108. Posição curta num futuro sobre ações CRÉDIT AGRICOLE (Ticker: ACA FP).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Bolsa: Euronext

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

109. Posição longa em opções de compra. Subjacente BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

110. Posição curta em opções de compra. Subjacente BAYER (Ticker: BAYN GR), ATM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: dezembro ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

111. Posição longa em opções de compra. Subjacente PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: USD

112. Posição longa em opções de venda. Subjacente PFIZER (Ticker PFE US) 10 % OTM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: USD

113. Posição longa em opções de compra. Subjacente BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % ATM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: dezembro ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

114. Posição curta em opções de compra. Subjacente BAYER (Ticker: BAYN GR), 10 % ATM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

115. Posição longa em opções de compra. Subjacente AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % ATM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: dezembro ano T

Moeda do instrumento da EBA: GBP

116. Posição longa em opções de venda. Subjacente AVIVA (Ticker: AV/LN), 10 % ATM (1 contrato = 100 ações).

Nocional: equivalente ao valor de 10 000 ações do ativo subjacente

Data de vencimento: dezembro do ano T

Moeda do instrumento da EBA: GBP

117. Posição curta num futuro sobre o NIKKEI 225 (Ticker: NKY).

Nocional: equivalente ao valor do índice multiplicado por 20 000 JPY

Bolsa: CME

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: JPY

118. Instrumento de capital próprio com possibilidade de reembolso antecipado automático.

Posição longa

Contabilização na “data de contabilização”

Montante nocional (“capital”): 1 000 000 EUR

Subjacente: Índice EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E)

Moeda do instrumento da EBA: EUR

prazo de vencimento: 5 anos

Pagamento anual e observação anual (“Data de contabilização + 1 ano”, “Data de contabilização + 2 anos”, “Data de contabilização + 3 anos”, “Data de contabilização + 4 anos”, “Data de contabilização + 5 anos”). O pagamento é efetuado 10 dias após a data de referência.

Cupão: 6 %

Nível de reembolso antecipado automático (“valor inicial”): Fim do dia da data de contabilização + 1 mês

Pagamento de cupão de barreira a 60 % do nível de reembolso antecipado automático

Barreira de proteção: 55 % do nível de reembolso antecipado automático

— Capital não garantido se o índice estiver abaixo da barreira de proteção (o capital devolvido no ano 5 será proporcional se o nível for inferior à barreira de proteção: por exemplo, se o SX5E = 40 % do seu nível inicial, o capital a devolver será de 40 %);

— Se o SX5E >= 60 % (cupão de barreira) do valor inicial no final de qualquer ano, é pago um cupão de 6 %;

— Se SX5E >= 100 % do valor inicial no final de qualquer ano, a opção de compra é exercida e é pago o cupão e o capital (100 %);

— Se o SX5E < 60 % (cupão de barreira) do valor inicial no final de qualquer ano, não é pago qualquer cupão;

— Se o SX5E < 55 % (barreira de proteção) do valor inicial no final do ano 5, o capital só é pago de forma proporcional. Pelo contrário, se o SX5E >= 55 % (barreira de proteção) do valor inicial no final do ano 5, o capital é pago integralmente.

119. Posição longa em opções de compra. Subjacente índice EURO STOXX 50 (Ticker: SX5E), ATM.

Nocional: equivalente ao valor do índice multiplicado por 1 000 EUR

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

120. Posição longa em opções de compra. Subjacente índice EURO STOXX 600 (Ticker: SXXP), ATM.

Nocional: equivalente ao valor do índice multiplicado por 10 000 EUR

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: EUR

121. Posição longa em opções de compra. Subjacente VIX (CBOE), ATM.

Nocional: equivalente ao valor do índice multiplicado por 100 000 USD

Data de vencimento: junho ano T

Moeda do instrumento da EBA: USD

IR

201. IRS EUR a 5 anos – Receber a taxa fixa e pagar a taxa variável.

Componente a taxa fixa: a receber anualmente

Taxa variável: EURIBOR a 6 meses, pagamento semestral Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

Nocional: 10 000 000 EUR

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização (ou seja, as taxas a utilizar devem ser as taxas de fecho de mercado na data de contabilização).

prazo de vencimento: setembro ano T+4.

Moeda do instrumento da EBA: EUR

202. Opção sobre swaps (swaption) sobre IRS EUR a 5 anos – Pagar a taxa fixa e receber uma taxa variável.

Nocional: 10 000 000 EUR.

A instituição é o vendedor da opção sobre o swap. A contraparte da instituição adquire o direito de proceder a um swap com a instituição; se a contraparte exercer esse direito, a contraparte deve receber a taxa fixa, enquanto a instituição recebe a taxa variável.

Opção sobre swaps (swaption) com prazo de vencimento a dois anos (data de contabilização + 2 anos) sobre IRS, definida como se segue: Componente fixa: a receber anualmente; Taxa variável: EURIBOR a 6 meses, a receber semestralmente; Nocional: 10 000 000 EUR; Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão. Data de entrada em vigor do swap subjacente: Data de contabilização + 2 anos

Data de vencimento do swap subjacente: Data de contabilização + 7 anos

Prémio pago à data de contabilização (Data de contabilização). Liquidação em numerário

O preço de exercício baseia-se na taxa ATM do swap inicial a prazo definido neste instrumento.

Moeda do instrumento da EBA: EUR

203. IRS USD a 5 anos. Recebimento a taxa fixa e pagamento a taxa variável.

Taxa fixa: a receber anualmente

Taxa variável: taxa SOFR USD a 3 meses, pagamento trimestral

Nocional: 1 000 000 USD

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização (ou seja, as taxas a utilizar devem ser as taxas de fecho de mercado na data de contabilização).

Data de vencimento: setembro ano T+4.

Moeda do instrumento da EBA: USD

204. IRS GBP a 2 anos. Recebimento a taxa fixa e pagamento a taxa variável.

Taxa fixa: a receber anualmente

Taxa variável: Taxa SONIA (overnight) acumulada e paga trimestralmente Contagem de dias: Número efetivo de dias/365

Nocional: 10 000 000 GBP

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização (ou seja, as taxas a utilizar devem ser as taxas de fecho de mercado na data de contabilização).

prazo de vencimento: Data de contabilização + 2 anos

Moeda do instrumento da EBA: GBP

205. Obrigação a 10 anos com taxa variável mínima e máxima vendida pela UBS

Montante nocional (capital): 1 000 000 USD.

As notas de taxa flutuante (“notas”) são obrigações prioritárias não garantidas da UBS AG (“UBS”).

Moeda do instrumento da EBA: USD

— As notas produzem juros a uma taxa anual igual à SOFR USD a três meses acrescida de 1,5 % ao ano (“taxa de juro variável”), sob reserva de uma taxa de juro máxima de 7,5 % ao ano (“limite máximo da taxa de juro”) e de uma taxa de juro mínima de 2,5 % ao ano (“limite mínimo da taxa de juro”).

— Qualquer pagamento relativo às notas, incluindo o pagamento dos juros e do capital na data de vencimento, deve estar sujeito à qualidade de crédito da UBS AG. As instituições devem utilizar uma curva de desconto adequada, cuja explicação deverá constar da nota explicativa.

— Rendimentos: As notas pagarão juros trimestrais a uma taxa igual à taxa de juro variável, desde que, em qualquer data de determinação do valor do cupão: i) se a taxa de juro variável for inferior ao limite mínimo da taxa de juro, a taxa de juro aplicável ao período de juros correspondente será igual ao limite mínimo da taxa de juro, ou ii) se a taxa de juro variável for superior ao limite máximo da taxa de juro, a taxa de juro aplicável ao período de juros correspondente será igual ao limite máximo da taxa de juro.

Montante dos pagamentos de juros	O montante dos juros a pagar em relação às notas para um determinado período de contagem dos juros deve ser igual ao produto: a) do montante correspondente ao capital das notas; b) da taxa de juro aplicável para esse período de contagem de juros; e c) uma fração, cujo numerador é o número de dias do período de contagem de juros (calculado com base num ano de 360 dias, ou doze meses de 30 dias) e cujo denominador é 360.
Data de transação e de liquidação	"Data de contabilização"
Datas de pagamento de juros	Trimestral, na data de contabilização + 3 meses, data de contabilização + 6 meses, data de contabilização + 9 meses e data de contabilização + 1 ano, com início na data de contabilização + 3 meses, durante o período de validade das notas (sob reserva de ajustamentos, nos termos das mesmas).
Data de vencimento	Data de contabilização + 10 anos
Moeda	USD
Base para a contagem dos dias	30 / 360
Convenção de dias úteis	quando a data de
determinação do valor do cupão não tiver sido ajustada	Para cada período de contagem de juros, o segundo dia útil bancário em Londres imediatamente anterior à data relevante para o pagamento de juros. "Dia útil bancário em Londres", qualquer dia em que os bancos comerciais se encontrem abertos para atendimento geral (incluindo transações em divisas e depósitos em moeda estrangeira) em Londres e em que é possível realizar transações em dólares americanos no mercado interbancário de Londres.

206. Posição longa GERMANY GOVT (Inflação) no valor de 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030583).

prazo de vencimento: 15 de abril de 2033

Moeda do instrumento da EBA: EUR

207. Posição curta GERMANY GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN DE0001030708).

prazo de vencimento: 15 de agosto de 2030

Moeda do instrumento da EBA: EUR

208. Posição longa ITALY GOVT (inflação) no valor de 1 000 000 EUR (ISIN IT0005138828).

prazo de vencimento: 15 de setembro de 2032

Moeda do instrumento da EBA: EUR

209. Posição longa ITALY GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN IT0005340929).

prazo de vencimento: 1 de dezembro de 2028

Moeda do instrumento da EBA: EUR

210. Posição longa SPAIN GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN ES00000127A2).

prazo de vencimento: 30 de julho de 2030

Moeda do instrumento da EBA: EUR

211. Posição curta FRANCE GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN FR0012993103).

prazo de vencimento: 25 de maio de 2031

Moeda do instrumento da EBA: EUR

212. Posição curta GERMANY GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN DE0001135176).

prazo de vencimento: 4 de janeiro de 2031

Moeda do instrumento da EBA: EUR

213. Posição longa UNITED KINGDOM GOVT no valor de 1 000 000 GBP (ISIN GB0004893086).

prazo de vencimento: 7 de junho de 2032

Moeda do instrumento da EBA: GBP

214. Posição longa PORTUGAL GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN PTOTEXOE0024).

prazo de vencimento: 15 de junho de 2029

Moeda do instrumento da EBA: EUR

215. Posição curta UNITED STATES GOVT no valor de 1 000 000 USD (ISIN US91282CAV37).

prazo de vencimento: 15 de novembro de 2030

Moeda do instrumento da EBA: USD

216. Posição longa BRAZIL GOVT no valor de 1 000 000 USD (ISIN US105756BZ27).

prazo de vencimento: 13 de janeiro de 2028

Moeda do instrumento da EBA: USD

217. Posição longa MEXICO GOVT no valor de 1 000 000 USD (ISIN US91087BAT70).

prazo de vencimento: 19 de maio de 2033

Moeda do instrumento da EBA: USD

218. IRS EURO a 10 anos – Receber a taxa variável e pagar a taxa fixa.

Componente a taxa fixa: a pagar anualmente

Taxa variável: EURIBOR a 3 meses, recebimento trimestral Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

Nocional: 10 000 000 EUR

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização (ou seja, as taxas a utilizar devem ser as taxas de fecho de mercado na data de contabilização)

prazo de vencimento: Data de contabilização + 10 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

219. IRS EURO a 5 anos – Receber a taxa variável e pagar a taxa fixa.

Componente a taxa fixa: a pagar anualmente

Taxa variável: EURIBOR a 6 meses, recebimento semestral Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

Nocional: 10 000 000 EUR

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização (ou seja, as taxas a utilizar devem ser as taxas de fecho de mercado na data de contabilização)

prazo de vencimento: Data de contabilização + 5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

220. Swap de divisas cruzadas EUR/USD a 5 anos a preços de mercado. Receber em USD e pagar em EUR.

EUR ESTER a 3 meses acumulada, pagamento trimestral com 2 dias de diferimento Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

USD SOFR a 3 meses acumulada, recebimento trimestral com 2 dias de diferimento Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

Componente 1 – USD: nocional equivalente a 10 000 000 EUR, ajustado numa base trimestral

Componente 2 – EUR: nocional de 10 000 000 EUR

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização + 6 meses

prazo de vencimento: Data de contabilização + 5,5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Ver também secção 6 do presente anexo – Especificações adicionais para os instrumentos

221. IRS EURO a 10 anos – Receber à taxa ESTER e pagar à taxa EURIBOR.

Componente ESTER: a receber anualmente Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

Componente EURIBOR: EURIBOR a 3 meses + valor-base, pagamento trimestral Contagem de dias: Número efetivo de dias/360

Nocional: 10 000 000 EUR

Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão

Data-valor igual à data de contabilização (ou seja, as taxas a utilizar devem ser as taxas de fecho de mercado na data de contabilização).

prazo de vencimento: setembro ano T + 9 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

222. Posição longa (com possibilidade de reembolso antecipado) ITALY GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN IT0005387052).

prazo de vencimento: 15 de maio de 2030

Moeda do instrumento da EBA: EUR

223. *Swap* de cupão zero de inflação EUR a 5 anos – Receber um rendimento indexado à inflação e pagar uma taxa fixa (r).

Índice de inflação: IPC (HIPC x T)

Componente fixa (pagamento fixo): $[(1 + r)^5 - 1]$

Rendimento indexado à inflação a receber:: $\left[\left(\frac{IPC \text{ no fim da data de vencimento}}{IPC \text{ na data de ínicio}}\right) - 1\right]$

Nocional: 10 000 000 EUR

Data de fixação do valor-base: junho do ano T+1

Fixação final: agosto ano T+4

prazo de vencimento: setembro ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

224. Opção sobre swaps (swaption) sobre IRS EUR a 5 anos – Receber a taxa fixa e pagar uma taxa variável.

Nocional: 10 000 000 EUR.

A instituição é o vendedor da opção sobre o swap. A contraparte da instituição adquire o direito de proceder a um swap com a instituição; se a contraparte exercer esse direito, a contraparte deve receber a taxa variável, enquanto a instituição recebe a taxa fixa.

Opção sobre swaps (swaption) com prazo de vencimento a dois anos (data de contabilização + 2 anos) sobre IRS, definida como se segue: Componente fixa: a receber anualmente; Taxa variável: EURIBOR a 6 meses, pagamento semestral; Nocional: 10 000 000 EUR; Data de encerramento dos períodos e calendário: padrão. Data de entrada em vigor do swap subjacente: Data de contabilização + 2 anos

Data de vencimento do swap subjacente: Data de contabilização + 7 anos

Prémio pago à data de contabilização (Data de contabilização). Liquidação em numerário

O preço de exercício baseia-se na taxa ATM à vista do swap inicial a prazo definido neste instrumento + 100 bps

Moeda do instrumento da EBA: EUR

FX

301. Contrato a prazo USD/EUR a 6 meses. Liquidação em numerário. Posição longa USD – Posição curta EUR; Nocional: 10 000 000 USD; Preço de exercício do contrato forward igual a 100 % da taxa de referência à vista do BCE no final da data de contabilização.

Moeda do instrumento da EBA: EUR

302. Contrato a prazo EUR/GBP a 6 meses. Liquidação em numerário. Posição longa EUR – Posição curta GBP; Nocional 10 000 000 de GBP; Preço de exercício do contrato forward igual a 100 % da taxa de referência à vista do BCE no final da data de contabilização.

Moeda do instrumento da EBA: EUR

303. Posição longa 10 000 000 USD de tesouraria.

Posição de tesouraria. A considerar como tendo um risco cambial intrínseco, tal como descrito na alínea kk)

Moeda do instrumento da EBA: EUR

304. Opção de compra longa EUR/USD (longa EUR, curta USD). Liquidação em numerário. Nocional: 10 000 000 EUR. Montante equivalente com base na taxa de referência à vista EUR/USD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Preço de exercício: 110 % da taxa de referência EUR/USD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Data de vencimento: Data de contabilização + 1 ano

Moeda do instrumento da EBA: EUR

305. Opção de compra longa EUR/USD (longa EUR, curta USD). Liquidação em numerário. Nocional: 10 000 000 EUR. Montante equivalente com base na taxa de referência à vista EUR/USD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Preço de exercício: 90 % da taxa de referência EUR/USD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Data de vencimento: Data de contabilização + 1 ano

Moeda do instrumento da EBA: EUR

306. Opção de compra longa EUR/USD (curta EUR, longa USD). Liquidação em numerário. Nocional: 10 000 000 EUR. Montante equivalente com base na taxa de referência à vista EUR/USD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Preço de exercício: 100 % da taxa de referência EUR/USD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Data de vencimento: Data de contabilização + 1 ano

Moeda do instrumento da EBA: EUR

307. Opção de compra curta EUR/GBP (curta EUR, longa GBP). Liquidação em numerário. Nocional: 10 000 000 EUR. Montante equivalente com base na taxa de referência à vista EUR/GBP do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Preço de exercício: 110 % da taxa de referência EUR/GBP do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Data de vencimento: Data de contabilização + 1 ano

Moeda do instrumento da EBA: EUR

308. Opção de venda longa EUR/JPY (curta EUR, longa JPY). Liquidação em numerário. Nocional: 10 000 000 EUR. Montante equivalente com base na taxa de referência à vista EUR/JPY do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Preço de exercício: 110 % da taxa de referência EUR/JPY do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Data de vencimento: Data de contabilização + 1 ano

Moeda do instrumento da EBA: EUR

309. Opção de venda curta EUR/AUD (longa EUR, curta AUD). Liquidação em numerário. Nocional: 10 000 000 EUR. Montante equivalente com base na taxa de referência à vista EUR/AUD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Preço de exercício: 110 % da taxa de referência EUR/AUD do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização.

Data de vencimento: Data de contabilização + 1 ano

Moeda do instrumento da EBA: EUR

310. Contrato a prazo EUR/DKK a 6 meses (longa EUR, curta DKK). Liquidação em numerário. Nocional de 10 000 000 EUR. Taxa de referência à vista EUR/DKK do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização para determinar a taxa a prazo.

Moeda do instrumento da EBA: EUR

311. Contrato a prazo não executável EUR/BRL a 6 meses. (longa EUR, curta BRL); Nocional de 10 000 000 EUR. Taxa de referência à vista EUR/BRL do BCE no fecho do dia que corresponde à data de contabilização para determinar a taxa a prazo.

Moeda do instrumento da EBA: EUR

MERCADORIAS

401. Posição longa sobre
3 500 onça troy London Gold Forward a 6 meses (longa ouro, curta USD). Liquidação em numerário. Preço de exercício: Preço a prazo de 6 meses no final do dia na data de contabilização.

Moeda do instrumento da EBA: USD

402. Posição curta sobre 3 500 onças troy London Gold Forward a 12 meses (curta ouro, longa USD). Liquidação em numerário. Preço de exercício: Preço a prazo de 12 meses no final do dia na data de contabilização.

Moeda do instrumento da EBA: USD

403. Opção de compra longa sobre 30 000 barris Brent Crude Oil (longa WTI, curta USD). Liquidação em numerário. Preço de exercício: Preço a prazo de 12 meses no final do dia na data de contabilização. Data de vencimento: Data de contabilização + 6 meses

Moeda do instrumento da EBA: USD

404. Opção de venda curta sobre 30 000 barris Brent Crude Oil (longa WTI, curta USD). Liquidação em numerário. Preço de exercício: Preço a prazo de 12 meses no final do dia na data de contabilização. Data de vencimento: Data de contabilização + 6 meses

Moeda do instrumento da EBA: USD

405. Opção de compra longa sobre 5 000 onças troy London Gold (longa ouro, curta USD). Liquidação em numerário. Preço de exercício: Preço a prazo de 18 meses no final do dia na data de contabilização. Data de vencimento: Data de contabilização + 18 meses

Moeda do instrumento da EBA: USD

SPREAD DE CRÉDITO

501. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida PORTUGUESA.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL

Moeda do instrumento da EBA: USD

502. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida ITALIANA.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL
Moeda do instrumento da EBA: USD

503. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida ESPANHOLA.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL
Moeda do instrumento da EBA: USD

504. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida MEXICANA.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL
Moeda do instrumento da EBA: USD

505. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida BRASILEIRA.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL
Moeda do instrumento da EBA: USD

506. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida BRITÂNICA.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL
Moeda do instrumento da EBA: USD

507. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Telefonica (Ticker: TEF SM).

Moeda do instrumento da EBA: EUR

508. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Telefonica (Ticker: TEF SM).

prazo de vencimento: dezembro ano T+2
Moeda do instrumento da EBA: EUR

509. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Aviva (Ticker: AV LN).

Definições ISDA 2003
Moeda do instrumento da EBA: EUR

510. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Aviva (Ticker: AV LN).

Definições ISDA 2003
prazo de vencimento: dezembro ano T+2
Moeda do instrumento da EBA: EUR

511. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Vodafone (Ticker: VOD LN).

Moeda do instrumento da EBA: EUR

512. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da ENI SpA (Ticker: ENI IM).

Moeda do instrumento da EBA: EUR

513. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida da Ely Lilly (Ticker: LLY US).

cláusula de reestruturação: Sem reestruturação (XR14)
Moeda do instrumento da EBA: USD

514. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Unilever (Ticker: UNA NA).

Moeda do instrumento da EBA: EUR

515. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida da Total SA (Ticker: FP FP).

Moeda do instrumento da EBA: EUR

516. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 EUR sobre a dívida do Grupo Volkswagen (Ticker: VOW GR).

Moeda do instrumento da EBA: EUR

517. Posição longa em notas do TURKEY Govt. no valor de 1 000 000 USD (ISIN US900123CT57).

prazo de vencimento: 26 de abril de 2029

Moeda do instrumento da EBA: USD

518. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida TURCA. Data-valor igual à data de contabilização.

cláusula de reestruturação: INTEGRAL

Moeda do instrumento da EBA: USD

519. Posição longa em notas da Telefonica no valor de 1 000 000 EUR (ISIN XS1681521081).

prazo de vencimento: 12 de janeiro de 2028

Moeda do instrumento da EBA: EUR

520. Posição longa em notas do Grupo Volkswagen no valor de 1 000 000 EUR (ISIN XS2234567233).

prazo de vencimento: 22 de setembro de 2028

Moeda do instrumento da EBA: EUR

521. Posição curta em notas do Grupo Volkswagen no valor de 1 000 000 EUR (ISIN XS1167667283).

prazo de vencimento: 16 de janeiro de 2030

Moeda do instrumento da EBA: EUR

522. Posição longa em notas da Total SA no valor de 1 000 000 EUR (ISIN XS1856281834).

prazo de vencimento: 11 de julho de 2033

Moeda do instrumento da EBA: EUR

523. Posição longa AUSTRIA GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN AT0000A04967).

prazo de vencimento: 15 de março de 2037

Moeda do instrumento da EBA: EUR

524. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida AUSTRÍACA.

prazo de vencimento: junho ano T+15

Moeda do instrumento da EBA: USD

525. Posição longa NETHERLANDS GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN NL0013552060).

prazo de vencimento: 15 de janeiro de 2040

Moeda do instrumento da EBA: EUR

526. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida NEERLANDESA.

prazo de vencimento: junho ano T+20

Moeda do instrumento da EBA: USD

527. Posição longa BELGIUM GOVT no valor de 1 000 000 EUR (ISIN BE0000348574).

prazo de vencimento: 22 de junho de 2050

Moeda do instrumento da EBA: EUR

528. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 1 000 000 USD sobre a dívida BELGA.

prazo de vencimento: junho ano T+30

Moeda do instrumento da EBA: USD

529. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 10 000 000 EUR sobre a série OTR do índice iTraxx Europe.

prazo de vencimento: junho ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

530. Opção de venda curta. 10 000 000 EUR. Subjacente série OTR do índice iTraxx Europe (mesmo instrumento do ponto 529).

Preço de exercício: ATM

Data de vencimento: Data de contabilização + 6 meses

Moeda do instrumento da EBA: EUR

531. Posição longa (com possibilidade de reembolso antecipado) na AXA SA no valor de 1 000 000 EUR (ISIN XS1799611642).

prazo de vencimento: 28 de maio de 2049

Moeda do instrumento da EBA: EUR

532. Posição longa (com possibilidade de reembolso antecipado) na AT&T Bond no valor de 1 000 000 USD (ISIN US00206RFW79).

prazo de vencimento: 15 de agosto de 2037

Moeda do instrumento da EBA: USD

533. Posição longa (com possibilidade de reembolso antecipado) na BAYER AG no valor de 1 000 000 EUR (ISIN XS2199266268).

prazo de vencimento: 6 de janeiro de 2030

Moeda do instrumento da EBA: EUR

534. Posição longa (com possibilidade de reembolso antecipado) na ORANGE SA Bond no valor de 1 000 000 EUR (ISIN FR0013323870).

prazo de vencimento: 20 de março de 2028

Moeda do instrumento da EBA: EUR

CTP (carteira de negociação de correlação)

601. Posição curta (ou seja, venda de proteção) na série OTR do índice iTraxx Europe.

Ponto de conexão: 3 %

Ponto de desconexão: 6 %

Nocional: 5 000 000 EUR

prazo de vencimento: 5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

602. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 5 000 000 EUR sobre a série OTR mais recente do índice iTraxx Europe.

prazo de vencimento: junho ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Nocional ajustado para cobrir integralmente o CS01 do ponto 601 sem necessidade de cobertura adicional

603. Posição longa (ou seja, compra de proteção) na série OTR do índice iTraxx Europe.

Ponto de conexão: 3 %

Ponto de desconexão: 6 %

Nocional: 5 000 000 EUR

prazo de vencimento: 5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

604. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 5 000 000 EUR sobre a série OTR mais recente do índice iTraxx Europe.

prazo de vencimento: junho ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Nocional ajustado para cobrir integralmente o CS01 do ponto 603 sem necessidade de cobertura adicional

605. Posição curta (ou seja, venda de proteção) na série OTR do índice iTraxx Europe.

Ponto de conexão: 12 %

Ponto de desconexão: 100 %

Nocional: 5 000 000 EUR

prazo de vencimento: 5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

606. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 5 000 000 EUR sobre a série OTR mais recente do índice iTraxx Europe.

prazo de vencimento: junho ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Nocional ajustado para cobrir integralmente o CS01 do ponto 605 sem necessidade de cobertura adicional

607. Posição longa (ou seja, compra de proteção) na série OTR do índice iTraxx Europe.

Ponto de conexão: 12 %

Ponto de desconexão: 100 %

Nocional: 5 000 000 EUR

prazo de vencimento: 5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

608. CDS curto (ou seja, venda de proteção) no valor de 5 000 000 EUR sobre a série OTR mais recente do índice iTraxx Europe.

prazo de vencimento: junho ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Nocional ajustado para cobrir integralmente o CS01 do ponto 607 sem necessidade de cobertura adicional

609. Posição curta (ou seja, venda de proteção) na série OTR do índice iTraxx Europe.

Ponto de conexão: 3 %

Ponto de desconexão: 6 %

Nocional: 5 000 000 EUR

prazo de vencimento: 5 anos

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Taxa de recuperação: 40 % (fixa).

610. CDS longo (ou seja, compra de proteção) no valor de 5 000 000 EUR sobre a série OTR mais recente do índice iTraxx Europe.

prazo de vencimento: junho ano T+4

Moeda do instrumento da EBA: EUR

Nocional ajustado para cobrir integralmente o CS01 do ponto 609 sem necessidade de cobertura adicional

Secção 3: Carteiras individuais — Instrumento único

As instituições devem apresentar as medidas do risco exigidas, juntamente com o valor atual, das seguintes carteiras individuais:

Carteira	*Combinação de instrumentos:* O primeiro valor representa o instrumento (conforme referido no ponto 2 do presente anexo). O segundo valor representa a quantidade de cada instrumento ou o número de contratos, consoante o caso.	Moeda da carteira da EBA	Medidas do risco exigidas
1001	101 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1002	102 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1003	103 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1004	104 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1005	105 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1006	106 – 1 instrumento	GBP	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1007	107 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1008	108 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1009	109 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1010	110 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1011	111 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1012	112 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1013	113 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1014	114 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1015	115 – 1 instrumento	GBP	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1016	116 – 1 instrumento	GBP	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1017	117 – 1 instrumento	JPY	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1018	118 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO

1019	119 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1020	120 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1021	121 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2001	201 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2002	202 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2003	203 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2004	204 – 1 instrumento	GBP	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2005	205 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2006	206 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2007	207 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2008	208 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2009	209 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2010	210 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2011	211 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2012	212 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2013	213 – 1 instrumento	GBP	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2014	214 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2015	215 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2016	216 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2017	217 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2018	218 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2019	219 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2020	220 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2021	221 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2022	222 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO

2023	223 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2024	224 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3001	301 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3002	302 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3003	303 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3004	304 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3005	305 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3006	306 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3007	307 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3008	308 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3009	309 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3010	310 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3011	311 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4001	401 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4002	402 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4003	403 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4004	404 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4005	405 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
5001	501 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5002	502 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5003	503 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5004	504 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5005	505 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5006	506 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5007	507 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO

5008	508 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5009	509 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5010	510 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5011	511 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5012	512 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5013	513 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5014	514 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5015	515 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5016	516 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5017	517 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5018	518 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5019	519 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5020	520 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5021	521 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5022	522 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5023	523 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5024	524 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5025	525 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5026	526 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5027	527 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5028	528 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5029	529 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5030	530 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5031	531 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5032	532 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO

5033	533 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5034	534 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
6001	601 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6002	602 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6003	603 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6004	604 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6005	605 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6006	606 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6007	607 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6008	608 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6009	609 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6010	610 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO

Secção 4: Carteiras individuais — Instrumentos múltiplos

As instituições devem apresentar as medidas do risco exigidas, juntamente com o valor atual, das seguintes carteiras individuais:

Carteira	*Combinação de instrumentos:* O primeiro valor representa o instrumento (conforme referido no ponto 2 do presente anexo). O segundo valor representa a quantidade de cada instrumento ou o número de contratos, consoante o caso.	Moeda da carteira da EBA	Medidas do risco exigidas
1101	103 – 1 instrumento 104 – 1 instrumento 105 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1102	113 – 1 instrumento 110 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1103	115 – 1 instrumento 116 – 1 instrumento	GBP	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1104	109 – 1 instrumento 110 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO

1105	111 – 1 instrumento 112 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1106	102 – 1 instrumento 114 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1107	106 – 1 instrumento 107 – 1 instrumento 108 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1108	101 – 1 instrumento 103 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1109	101 – 1 instrumento 103 – 1 instrumento 104 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
1110	102 – 1 instrumento 104 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2201	206 – 1 instrumento 207 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2202	206 – 1 instrumento 207 – 1 instrumento 208 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2203	206 – 1 instrumento 207 – 1 instrumento 208 – 1 instrumento 209 – 1 instrumento 210 – 1 instrumento 211 – 1 instrumento 212 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2204	201 – 1 instrumento 218 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2205	201 – 1 instrumento 219 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2206	218 – 1 instrumento 219 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2207	201 – 1 instrumento 202 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
2208	215 – 1 instrumento 216 – 1 instrumento 217 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2209	203 – 1 instrumento 215 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO

2210	208 – 1 instrumento 209 – 1 instrumento 210 – 1 instrumento 214 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2211	209 – 1 instrumento 219 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
2212	201 – 1 instrumento 223 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3301	301 – 1 instrumento 302 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3302	303 – 1 instrumento 304 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3303	304 – 1 instrumento 305 – 1 instrumento 306 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
3304	307 – 1 instrumento 308 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4401	401 – 1 instrumento 402 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4402	403 – 1 instrumento 404 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
4403	401 – 1 instrumento 404 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
5501	501 – 1 instrumento 502 – 1 instrumento 503 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5502	504 – 1 instrumento 505 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5503	507 – 1 instrumento 508 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5504	503 – 1 instrumento 504 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5505	509 – 1 instrumento 510 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5506	511 – 1 instrumento 512 – 1 instrumento 514 – 1 instrumento 515 – 1 instrumento 516 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO

5507	517 – 1 instrumento 518 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5508	519 – 1 instrumento 520 – 1 instrumento 522 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5509	520 – 1 instrumento 521 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5510	519 – 1 instrumento 508 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5511	515 – 1 instrumento 522 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5512	520 – 1 instrumento 521 – 1 instrumento 516 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5513	506 – 1 instrumento 503 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5514	502 – 1 instrumento 209 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5515	504 – 1 instrumento 217 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5516	505 – 1 instrumento 216 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5517	504 – 1 instrumento 217 – 1 instrumento 505 – 1 instrumento 216 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5518	502 – 1 instrumento 209 – 1 instrumento 219 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5519	523 – 1 instrumento 525 – 1 instrumento 527 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5520	524 – 1 instrumento 526 – 1 instrumento 528 – 1 instrumento	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
5521	523 – 1 instrumento 524 – 1 instrumento 525 – 1 instrumento 526 – 1 instrumento 527 – 1 instrumento 528 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO

5522	529 – 1 instrumento 530 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
6601	601 – 1 instrumento 602 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6602	603 – 1 instrumento 604 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6603	605 – 1 instrumento 606 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6604	607 – 1 instrumento 608 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO
6605	609 – 1 instrumento 610 – 1 instrumento	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO

Secção 5: Carteiras agregadas

As instituições devem apresentar as medidas do risco exigidas, juntamente com o valor atual, das seguintes carteiras financeiras agregadas:

Agreg. Carteira	Descrição	*Combinação de carteiras individuais* (carteiras individuais, tal como identificadas pelo respetivo número nas secções 3 e 4 do presente anexo)	Moeda da carteira da EBA	Medidas do risco exigidas
10000	ALL-IN não CTP	1001, 1101, 1104, 1106, 2001, 2002, 2203, 2206, 3301, 3303, 3304, 4401, 4402, 5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
11000	CAPITAL PRÓPRIO cumulativo	1001, 1101, 1104, 1106	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
12000	IR cumulativo	2001, 2002, 2203, 2206	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
13000	FX cumulativo	3301, 3303, 3304	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
14000	Mercadorias cumulativo	4401, 4402	USD	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; SBM; DRC; RRAO
15000	Spread de crédito cumulativo	5503, 5506, 5508, 5521	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais); SBM; DRC; RRAO
16000	CTP cumulativo em EUR	6601, 6602	EUR	VaR (valor em risco); VaR em situação de esforço; APR; SBM; DRC; RRAO

Secção 6: Especificações adicionais para os instrumentos

As instituições devem aplicar as seguintes especificações adicionais aos instrumentos financeiros descritos na secção 2 do presente anexo:

Instrumento:	220
Descrição:	Swap de divisas cruzadas EUR/USD a 5 anos a preços de mercado Receber em USD e pagar em EUR Nocional: 10 000 000 EUR, (10 000 000 EUR * FX USD/EUR) USD
Pagar:	Elemento variável 2
Receber:	Elemento variável 1
Câmbio e revisão do nocional:	Na data-valor e na data de vencimento. Além disso, em cada data de pagamento de cupão, é efetuado um pagamento adicional correspondente ao ajustamento do valor nocional em USD do elemento variável 2. O valor nocional em USD é ajustado para 10 000 000 EUR, à taxa de câmbio à vista 2 dias úteis antes de cada data de pagamento.
Saldo de tesouraria	Incluído
Elemento variável 1	
Nocional:	Equivalente a 10 000 000 de EUR convertidos em USD à taxa de câmbio à vista na data-valor; valor equivalente ajustado trimestralmente
Data-valor:	Data de contabilização + 6 meses
Data de vencimento:	Data de contabilização + 5,5 anos
Geração da data de pagamento:	A partir da data-valor
Frequência do pagamento do cupão:	Trimestral
Taxa de cupão:	SOFR a 3 meses + 0 pontos de base
Frequência de revisão da taxa de cupão:	Trimestral
Convenção sobre a fixação das taxas de cupão:	Determinada diariamente ao longo do período de 3 meses
Frequência de cálculo da taxa de cupão:	Juro simples
Contagem de dias:	Número efetivo de dias/360
Dia útil para o pagamento:	LON, NYC, TARGET
Convenção de dias úteis para o pagamento:	Alterado na sequência de
Dia útil para a revisão do nocional:	LON, NYC, TARGET
Convenção de dias úteis para a revisão do nocional:	Anterior
Dia útil para a revisão da taxa de cupão:	LON, NYC, TARGET
Convenção de dias úteis para a revisão da taxa de cupão:	Anterior

Elemento variável 2	
Nocional:	10 000 000 EUR
Data-valor:	Data de contabilização + 6 meses
Data de vencimento:	Data de contabilização + 5,5 anos
Geração da data de pagamento:	A partir da data-valor
Frequência do pagamento do cupão:	Trimestral
Taxa de cupão:	ESTER a 3 meses + 0 pontos de base
Frequência de revisão da taxa de cupão:	Trimestral
Convenção sobre a fixação das taxas de cupão:	Determinada diariamente ao longo do período de 3 meses
Frequência de cálculo da taxa de cupão:	Juro simples
Contagem de dias:	Número efetivo de dias/360
Dia útil para o pagamento:	LON, NYC, TARGET
Dia útil para o pagamento	Alterado na sequência de
Dia útil para a revisão do nocional:	LON, NYC, TARGET
Convenção de dias úteis para a revisão do nocional:	Anterior
Dia útil para a revisão da taxa de cupão:	LON, NYC, TARGET
Convenção de dias úteis para a revisão da taxa de cupão:	Anterior"

Secção 7: Carteiras de validação SBM

(a) As instituições devem fornecer a medida do risco SBM das carteiras definidas no anexo X (carteiras de validação SBM) como parte da apresentação da IMV e apresentá-las em consonância com as datas de relato da apresentação da IMV.

(b) Para a apresentação dos resultados correspondentes às carteiras de validação SBM aplica-se o seguinte:

i. As instituições devem relatar apenas o modelo C120.02 e limitar o relato neste modelo aos resultados na moeda de relato (ou seja, a coluna 0060 do modelo C120.02 não deve ser preenchida e os modelos C 106.00 e C 106.01 não devem ser relatados para as carteiras de validação SBM);

ii. As instituições devem partir do princípio de que as sensibilidades ao risco e as posições de risco de curvatura definidas pelos instrumentos especificados no anexo X são expressas na moeda de relato da instituição e que as informações são fornecidas no formato especificado nas instruções de relato dos modelos C 106.01 / C 120.01 e no quadro correspondente com orientações para o relato destes modelos no anexo VI (Instruções sobre modelos).»

ANEXO III

«ANEXO VI

RESULTADOS DAS CARTEIRAS DE ANÁLISE COMPARATIVA PARA FINS DE SUPERVISÃO

INSTRUÇÕES RESPEITANTES AOS MODELOS

C 106.00 — Avaliação de mercado inicial e justificação da exclusão 57
C 106.01 — SBM. Sensibilidades ao risco por instrumento 57
C 107.01 — VaR e sVaR Não CTP. Informações pormenorizadas. 61
C 107.02 — VaR, sVaR e PV Não CTP. Resultados na moeda da carteira da EBA 63
C 108.00 — Série temporal dos resultados 64
C 109.01 — IRC. Informações pormenorizadas sobre o modelo 65
C 109.02 — IRC. Informações pormenorizadas por carteira 65
C 109.03 — IRC. Montante por carteira/data. 66
C 110.01 – CT. Informações pormenorizadas sobre o modelo. 67
C 110.02 – CT. Informações pormenorizadas por carteira. 68
C 110.03 — CT. APR por Carteira/Data 69
C 120.01 — SBM. SENSIBILIDADES AO RISCO POR INSTRUMENTO/CARTEIRA 69
C 120.02 — SBM. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA 72
C 120.04 — DRC. VALORES DE MERCADO E MONTANTES BRUTOS POR JTD POR INSTRUMENTO/CARTEIRA 74
C 120.05 — DRC. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA 80
C 120.06 — ASA. REQUISITO DE FUNDOS PRÓPRIOS (OFR) 82

INSTRUÇÕES RESPEITANTES AOS MODELOS

C 106.00 – Avaliação de mercado inicial e justificação da exclusão

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Número do instrumento	Anexo V secção 2	Deve comunicar-se o número do instrumento retirado do anexo V.
0020	Instrumento modelizado para VaR e para sVaR (VERDADEIRO/FALSO)		Deve comunicar-se VERDADEIRO ou FALSO.
0030	Instrumento modelizado para IRC (VERDADEIRO/FALSO)		Deve comunicar-se VERDADEIRO ou FALSO.
0040	Instrumento modelizado para negociação de correlação (VERDADEIRO/FALSO)		Deve comunicar-se VERDADEIRO ou FALSO.
0050	Justificação da exclusão	Artigo 3.º, n.º 2	Deve comunicar-se um dos seguintes: (a) Modelo não autorizado pelo regulador; (b) Instrumento ou subjacente não autorizado a nível interno; (c) Subjacente ou característica de modelização não considerado a nível interno; (d) Outras razões que justificam a exclusão. Explicar essas razões na coluna 0060.
0060	Caixa de texto livre		As instituições podem prestar quaisquer informações adicionais nesta coluna.
0070	Avaliação de mercado inicial ("IMV")		O valor a preços de mercado de cada instrumento às 17h30 HEC (hora da Europa Central) da data de referência [conforme referido no anexo V, secção 1, alínea b).] Esta célula deve ser deixada em branco se a instituição não pretender apresentar uma IMV para uma determinada carteira (ou seja, o valor zero só deve ser comunicado se o resultado do cálculo for zero).

C 106.01 — SBM. Sensibilidades ao risco por instrumento

As instituições devem comunicar as sensibilidades em relação aos fatores de risco a que o instrumento está exposto. Deve comunicar-se um fator de risco/sensibilidade por linha. A posição líquida de risco de curvatura ascendente desse fator de risco (CVRk+) ou a posição líquida de risco de curvatura descendente desse fator de risco (CVRk-), conforme especificado no artigo 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013, deve ser comunicada em linhas individuais. Todos os valores devem reportar-se à "data de referência da IMV (e inicial do SBM)" especificada no anexo V, secção 1, alínea b), subalínea ii), do presente regulamento. As instituições devem comunicar cada combinação de Número do instrumento, Identificador de risco (coluna 0010), Escalão (coluna 0020) e Identificador adicional (coluna 0030) apenas uma vez.

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Número do instrumento	Secção 2 do anexo V	Deve comunicar-se o número do instrumento retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Identificador do fator de risco	Artigos 325.º-L, 325.º-M, 325.º-N, 325.º-O, 325.º-P e 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o identificador do fator de risco especificado no quadro no final do presente anexo.
0020	Escalão	Artigo 325.º-D, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o escalão, caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponda à classe de risco: — Risco de taxa de juro geral, a resposta deve ser a designação da moeda da taxa isenta de risco, inflação ou fator de risco de base cambial relevantes (de acordo com a designação da moeda ISO 4217, por exemplo, "EUR"). — Risco de spread de crédito de não titularizações, a resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AH, n.º 1, quadro 4, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. — Risco de spread de crédito de titularizações não incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (não CSR ACTP), a resposta deve ser o número de escalão previsto no artigo 325.º-AM, n.º 1, quadro 7, desse regulamento. — Risco de spread de crédito de titularizações incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR ACTP), a resposta deve ser o número de escalão previsto no artigo 325.º-AK, quadro 6, desse regulamento. — Risco de títulos de capital próprio, a resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AP, n.º 1, quadro 8, desse regulamento. — Risco de mercadorias, a resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AS, quadro 9, desse regulamento. — Risco cambial e os componentes Delta ou Curvatura, a resposta deve ser o nome da moeda (por exemplo, "USD", os códigos de moeda comunicados devem seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas). — Risco cambial e componente Vega, a resposta deve ser o nome do par de moedas (por exemplo, "EUR_USD", os códigos de moeda comunicados devem seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas).
0030	Identificador adicional1	Artigos 325.º-L a 325.º-Q e 325.º-AI do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Devem comunicar-se as seguintes informações, que distinguem o fator de risco ao nível dos escalões. Caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponda à classe de risco: — Risco de taxa de juro geral e a componente Delta, a resposta deve ser o nome da curva isenta de risco ou outro identificador único correspondente. — Risco de spread de crédito de não titularizações ou classe de risco de spread de crédito de titularizações incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR ACTP), a resposta deve ser o nome do emitente ou outro identificador único correspondente e é idêntico para quaisquer duas sensibilidades comunicadas em relação a dois fatores

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			de risco que recebem um parâmetro de correlação $\rho_{kL}^{(nome)}$ igual a 1 nos termos do artigo 325.º-AI, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. — Risco de spread de crédito de titularizações não incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR não-ACTP), a resposta deve ser o nome da tranche ou outro identificador único correspondente. — Risco de títulos de capital próprio, a resposta deve ser o nome do emitente de títulos de capital ou um identificador único correspondente. — Risco de mercadorias, a resposta deve ser o nome da mercadoria ou outro identificador único correspondente. Caso não se aplique nenhum desses casos, as instituições devem relatar um valor explícito (NULL) como não aplicável.
0050	Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda de comunicação)	Artigo 325.º-D, n.º 2, e artigos 325.º-G, 325.º-R, 325.º-S, 325.º-Te 325.º-AX do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As sensibilidades ao risco (sensibilidades delta/vega e posições de risco de curvatura) devem ser comunicadas ao nível de cada instrumento para todos os fatores de risco relevantes, conforme especificado nas colunas 0010 a 0030. Os valores devem ser comunicados na moeda de comunicação da instituição. Caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponda à: — Componente de risco delta do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se a sensibilidade líquida ao fator de risco (S_k) como especificado no artigo 325.º-R do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Caso as instituições tenham obtido autorização da sua autoridade competente para utilizar definições alternativas de sensibilidades ao risco Delta em conformidade com o artigo 325.º-T, n.º 5, do referido regulamento, devem remeter para essas definições alternativas para a comunicação de informações. — Componente de risco vega do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se a sensibilidade ao risco vega de uma opção para um determinado fator de risco (Sk) como especificado no artigo 325.º-S do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Caso as instituições tenham obtido autorização da sua autoridade competente para utilizar cálculos alternativos das sensibilidades ao risco Vega nos termos do artigo 325.º-T, n.º 6, do referido regulamento, devem referir-se a esses cálculos alternativos para efeitos da comunicação de informações. Independentemente de a instituição utilizar a definição do artigo 325.º-S ou um cálculo alternativo nos termos do artigo 325.º-T, n.º 6, do referido regulamento, a sensibilidade deve ser comunicada após ponderação pela volatilidade implícita correspondente. — Componente do risco de curvatura do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se a posição líquida de risco de curvatura ascendente desse fator de risco (CVR_k^+) ou a posição líquida de risco de curvatura descendente desse fator de risco (CVR_k^-) como especificado no artigo 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013. O valor comunicado deve ser expresso em números decimais, com uma precisão mínima de duas casas decimais. Só deve ser comunicado o valor zero caso o resultado do cálculo seja efetivamente zero.
0060	Moeda de comunicação		Deve comunicar-se o nome da moeda de comunicação da instituição (o valor comunicado deve seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas, por exemplo, "EUR").

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0070	Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda do instrumento da EBA)	Secção 2 do anexo V do presente regulamento e Artigo 325.º-D, n.º 2, e artigos 325.º-G, 325.º-R, e 325.º-S, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores devem ser comunicados de acordo com as instruções para a coluna 0050, mas convertidos à taxa de câmbio à vista do BCE associada à moeda do instrumento, como definido no anexo V, secção 2, do presente regulamento.
0080	Modelo de fixação de preços	Artigo 325.º-T do Regulamento (UE) n.º 575/2013	A instituição deve especificar o modelo de fixação de preços que aplica para inferir as sensibilidades. Deve comunicar-se um dos seguintes: (a) "Modelos de fixação de preços da instituição que servem de base para o reporte de lucros e perdas à direção de topo" [como no artigo 325.º-T, n.º 1, primeiro parágrafo, do Regulamento (UE) n.º 575/2013]; (b) "Método dos modelos internos da instituição" (como no artigo 325.º-T, n.º 1, segundo parágrafo, desse regulamento);
0090	Definição de sensibilidades	Artigos 325.º-R, 325.º-S e 325.º-T do Regulamento (UE) n.º 575/2013	A instituição deve especificar a definição de sensibilidades que aplica no cálculo dos requisitos de fundos próprios. Deve comunicar-se um dos seguintes: (a) "Definição de sensibilidades dos artigos 325.º-R e 325.º-S do Regulamento (UE) n.º 575/2013"; (b) "Definição de sensibilidades em conformidade com o artigo 325.º-T, n.ºs 5 e 6, do Regulamento (UE) n.º 575/2013". Caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponda ao componente de risco de curvatura do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se o valor indicado na alínea b) se qualquer das sensibilidades utilizadas no cálculo da posição em risco ao risco de curvatura comunicada se basearem numa definição da sensibilidade em conformidade com o artigo 325.º-T, n.ºs 5 e 6, do Regulamento (UE) n.º 575/2013; caso contrário, deve ser comunicado o valor indicado na alínea a).
0100	Caixa de texto livre		Uma instituição pode fornecer informações adicionais nesta coluna sobre o modelo de fixação de preços e a definição de sensibilidades aplicados.
0110	Identificador adicional2	Artigo 325.º-P, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Se o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponder à classe de risco "Risco de Mercadoria" e ao componente de risco delta do método baseado nas sensibilidades, a resposta deve ser o conjunto de termos jurídicos relativos ao local de entrega ou outro identificador único correspondente. Caso não se aplique nenhum desses casos, as instituições devem relatar um valor explícito (NULL) como não aplicável.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0120	Categoria de qualidade de crédito	Artigo 325.º-M, n.º 1, e artigo 325.º-AH, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Se o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponder à categoria de risco de spread de crédito de não titularizações e à componente de risco delta do método baseado nas sensibilidades, a resposta deve ser uma das seguintes: (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Nenhum CQS atribuído (não classificado)". Caso não se aplique nenhum desses casos, as instituições devem relatar um valor explícito (NULL) como não aplicável.

C 107.01 – VaR e sVaR Não CTP. Informações pormenorizadas.

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010 - 0060	VaR (valor em risco);		
0010	Metodologia		Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) Simulação histórica; (b) Simulação Monte Carlo; (c) Metodologia paramétrica; (d) Combinação / outra metodologia (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção d) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas na coluna 0020.
0020	Cálculo do horizonte de 10 dias	Artigo 365.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) 1 dia reescalonado para 10 dias; (b) 10 dias com períodos sobrepostos; (c) Outra metodologia a 10 dias. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0030	Duração do período de observação	Artigo 365.º, n.º 1, alínea d), do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) Até 1 ano; (b) Mais de 1 e até 2 anos; (c) Mais de 2 e até 3 anos; (d) Mais de 3 anos. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0040	Ponderação dos dados	Artigo 365.º, n.º 1, alínea d), do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) Não ponderados (ponderação dos dados VaR); (b) Ponderados (ponderação dos dados VaR); (c) O mais alto entre o valor ponderado e não ponderado (ponderação dos dados VaR) nas alíneas a) e b). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0050	Acréscimo de verificações *a posteriori*	Artigo 366.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Um acréscimo por verificações a posteriori corresponde à aplicação de um fator adicional entre 0 e 1 em conformidade com o artigo 366.º, n.º 2, quadro 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0060	Acréscimo regulamentar VaR	Artigo 366.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 ("pelo menos 3")	Um acréscimo regulamentar VaR corresponde à aplicação de um requisito de fundos próprios adicional pela autoridade competente no que diz respeito ao fator de multiplicação para o VaR (pelo menos 3) em conformidade com o artigo 366.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. O acréscimo regulamentar VaR é a soma do acréscimo de verificações a posteriori e do acréscimo qualitativo, se aplicável, superior a 3. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0070 - 0100	sVaR (valor em risco em situação de esforço)		
0070	Metodologia		Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) Simulação histórica; (b) Simulação Monte Carlo; (c) Metodologia paramétrica; (d) Combinação / outra metodologia (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção d) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas na coluna 0020.
0080	Cálculo do horizonte de 10 dias	Artigo 365.º, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) 1 dia reescalonado para 10 dias; (b) 10 dias com períodos sobrepostos; (c) Outra metodologia a 10 dias. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0090	Acréscimo regulamentar sVaR	Artigo 366.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Um acréscimo regulamentar corresponde à aplicação de um requisito de fundos próprios adicional pela autoridade competente no que diz respeito ao fator de multiplicação para o sVaR (pelo menos 3) em conformidade com o artigo 366.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. O acréscimo regulamentar é a soma de 3, do acréscimo de verificações a posteriori e do acréscimo qualitativo (se aplicável).

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0100	Período do sVaR	Artigo 365.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Na coluna 0010, deve comunicar-se um dos seguintes: (a) Cálculo diário do VaR em situação de esforço calibrado para um período contínuo de 12 meses a partir da data especificada na coluna 0020; (b) Cálculo semanal do VaR em situação de esforço calibrado para um período contínuo de 12 meses a partir da data especificada na coluna 0020; (c) Cálculo diário do VaR em situação de esforço calibrado em função de diferentes períodos contínuos de 12 meses durante as datas de comunicação do VaR em situação de esforço indicadas na coluna 0010 do modelo C107.02 a partir das datas especificadas na coluna 0020; (d) Cálculo semanal do VaR em situação de esforço calibrado em função de diferentes períodos contínuos de 12 meses durante as datas de comunicação do VaR em situação de esforço indicadas na coluna 0010 do modelo C107.02 a partir das datas especificadas na coluna 0020; (e) Valor máximo dos cálculos diários do VaR em situação de esforço calibrados para mais do que um período de 12 meses; (f) Valor máximo dos cálculos semanais do VaR em situação de esforço calibrados para mais do que um período de 12 meses; (g) Outras opções para a calibração do VaR em situação de esforço (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para indicar a data de início no formato "dd/mm/aaaa" caso comunique as opções a) ou b) na coluna 0010 e as datas de início no formato "dd/mm/aaaa" utilizadas para cada cálculo do VaR em situação de esforço caso comunique as opções c) ou d) na coluna 0010. A instituição deve também utilizar a coluna 0020 para prestar mais esclarecimentos sobre o período de 12 meses utilizado para cada cálculo do VaR em situação de esforço, caso tenham sido indicadas as opções e), f) ou g) na coluna 0010.

C 107.02 – VaR, sVaR e PV Não CTP. Resultados na moeda da carteira da EBA

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3,4 e 5	Deve comunicar-se o número do instrumento retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Data		Os resultados em termos de VaR, sVaR e valor atual (PV) devem ser comunicados para todos os 10 dias úteis entre a "data de referência inicial das RM" e a "data de referência final das RM (e final do ASA)", como especificado no anexo V, secção 1, alínea b). Deve adotar-se a convenção "dd/mm/aaaa" para comunicar as datas.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0020	VaR (valor em risco);	Artigo 365.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o VaR regulamentar a 10 dias obtido para cada carteira individual, sem aplicação do fator de multiplicação regulamentar "pelo menos 3". Os valores devem ser comunicados para cada uma das datas indicadas na coluna 0010. Esta célula deve ser deixada em branco se a instituição não calcular um VaR na data indicada na coluna 0010 (ou seja, o valor zero só deve ser comunicado se o resultado do cálculo for zero).
0030	sVaR (valor em risco em situação de esforço)	Artigo 365.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicado o sVaR regulamentar a 10 dias obtido para cada carteira individual, sem aplicação do fator de multiplicação regulamentar "pelo menos 3". Os valores devem ser comunicados para cada uma das datas indicadas na coluna 0010. Esta célula deve ser deixada em branco se a instituição não calcular um sVaR na data indicada na coluna 0010 (ou seja, o valor zero só deve ser comunicado se o resultado do cálculo for zero).
0040	PV		Deve comunicar-se o valor atual (PV) para cada carteira individual. Os valores devem ser comunicados para cada uma das datas indicadas na coluna 0010. Esta célula deve ser deixada em branco se a instituição não calcular um PV na data indicada na coluna 0010 (ou seja, o valor zero só deve ser comunicado se o resultado do cálculo for zero).

C 108.00 — Série temporal dos resultados

O modelo C 108.00 ("Série cronológica dos resultados") deve ser preenchido apenas pelas instituições que calculam o VaR utilizando uma simulação histórica.

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3,4 e 5	Deve comunicar-se o número do instrumento retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Data	Artigo 365.º, n.º 1, alínea d), do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Em cada dia útil, determinado em conformidade com o calendário da respetiva jurisdição, as instituições devem fornecer as séries de resultados (P&L) utilizadas para calcular o VaR na coluna 0010 do modelo C107.02, com um mínimo de 250 observações retrospetivas a contar da "data de referência final das RM (e final do ASA)", conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), subalínea v).
0020	Resultados diários		As instituições que calculem o VaR utilizando uma simulação histórica devem comunicar toda a série cronológica utilizada pela instituição, com uma série de dados no mínimo correspondente a um ano, incluindo a evolução da avaliação da carteira (ou seja, os resultados diários) determinada por via de uma simulação histórica das variações diárias do fator de risco (ou seja, as séries de resultados diários utilizadas para determinar o VaR regulamentar a 1 dia).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			Caso um dia seja feriado bancário na jurisdição em causa, esta célula deve ser deixada em branco (ou seja, só devem ser comunicados resultados iguais a zero se não tiver ocorrido qualquer alteração do valor hipotético da carteira num determinado dia útil).

C 109.01 — IRC. Informações pormenorizadas sobre o modelo

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Número de fatores de modelização		EBA/GL/2012/3 Deve comunicar-se número de fatores de modelização ao nível do modelo IRC global. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) 1 fator de modelização; (b) 2 fatores de modelização; (c) Mais de 2 fatores de modelização. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0020	Fonte das LGD (perdas dado o incumprimento)		EBA/GL/2012/3 Deve comunicar-se a fonte das LGD ao nível do modelo IRC global. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Convenção de mercado; (b) LGD usadas no IRB (Método das Notações Internas); (c) Outra fonte de LGD (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção c) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas nesta coluna.

C 109.02 — IRC. Informações pormenorizadas por carteira

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3,4 e 5	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V, apenas para as carteiras para as quais são solicitados os IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais).

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Horizonte de liquidez	Artigo 374.º, n.º 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	EBA/GL/2012/3 Deve ser comunicado o horizonte de liquidez aplicado ao nível da carteira. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Até 3 meses; (b) Mais de 3 e até 6 meses; (c) Mais de 6 e até 9 meses; (d) Mais de 9 e até 12 meses.
0020	Fonte das PD (probabilidades de incumprimento)		EBA/GL/2012/3 Deve ser comunicada a fonte das PD aplicadas ao nível da carteira. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Agências de notação de risco; (b) IRB (Método das Notações Internas); (c) PD implícitas no mercado; (d) Outra fonte de PD (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção d) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas na coluna 0020.
0030	Fonte das matrizes de transição		EBA/GL/2012/3 Deve ser comunicada a fonte das matrizes de transição aplicadas ao nível da carteira. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Agências de notação de risco; (b) IRB (Método das Notações Internas); (c) Matrizes de transição implícitas no mercado; (d) Outras fontes de matrizes de transição (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção d) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas na coluna 0020.

C 109.03 — IRC. Montante por carteira/data.

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5.	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V, apenas para as carteiras para as quais são solicitados os IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Data		Os IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais) devem ser comunicados para todos os 10 dias úteis entre a "data de referência inicial das RM" e a "data de referência final das RM (e final do ASA)", como especificado no anexo V, secção 1, alínea b). Deve adotar-se a convenção "dd/mm/aaaa" para comunicar as datas.
0020	IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais);	Artigos 372.º a 376.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	EBA/GL/2012/3 Devem ser comunicados os IRC regulamentares obtidos para cada carteira. Os valores devem ser comunicados para cada uma das datas indicadas na coluna 0010. Esta célula deve ser deixada em branco se a instituição não calcular um IRC (requisito de fundos próprios para riscos adicionais) na data indicada na coluna 0010 (ou seja, o valor zero só deve ser comunicado se o resultado do cálculo for zero).

C 110.01 – CT. Informações pormenorizadas sobre o modelo.

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Número de fatores de modelização	Artigo 377.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicado o número de fatores de modelização ao nível do modelo de negociação de correlação global. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) 1 fator de modelização; (b) 2 fatores de modelização; (c) Mais de 2 fatores de modelização. A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010.
0020	Fonte das LGD (perdas dado o incumprimento)	Artigo 377.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicada a fonte das LGD (perdas dado o incumprimento) ao nível do modelo de negociação de correlação global. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Convenção de mercado; (b) LGD usadas no IRB (Método das Notações Internas); (c) Outras fontes de LGD (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção c) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas nesta coluna.

C 110.02 – CT. Informações pormenorizadas por carteira.

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3,4 e 5	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V, apenas para as carteiras para as quais são solicitados os APR (valores de todos os riscos de preço).

Linha	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Horizonte de liquidez	Artigo 377.º, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicado o horizonte de liquidez aplicado ao nível da carteira. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Até 3 meses; (b) Mais de 3 e até 6 meses; (c) Mais de 6 e até 9 meses; (d) Mais de 9 e até 12 meses.
0020	Fonte das PD (probabilidades de incumprimento)	Artigo 377.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicada a fonte das PD aplicadas ao nível da carteira. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Agências de notação de risco; (b) IRB (Método das Notações Internas); (c) PD implícitas no mercado; (d) Outra fonte de PD (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção d) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas na coluna 0020.
0030	Fonte das matrizes de transição	Artigo 377.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicada a fonte das matrizes de transição aplicadas ao nível da carteira. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) Agências de notação de risco; (b) IRB (Método das Notações Internas); (c) Matrizes de transição implícitas no mercado; (d) Outra fonte de matrizes de transição (especificar). A instituição deve utilizar a coluna 0020 para clarificar a resposta dada na coluna 0010. Caso tenha sido selecionada a opção d) na coluna 0010, a instituição deve fornecer informações pormenorizadas na coluna 0020.

C 110.03 — CT. APR por Carteira/Data

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V, apenas para as carteiras para as quais são solicitados os APR (valores de todos os riscos de preço).

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Data	Artigo 377.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores de todos os riscos de preço (APR) devem ser comunicados para todos os 10 dias úteis entre a "data de referência inicial das RM" e a "data de referência final das RM (e final do ASA)", como especificado no anexo V, secção 1, alínea b). Deve adotar-se a convenção "dd/mm/aaaa" para comunicar as datas.
0060	APR (valores de todos os riscos de preço);	Artigo 377.º do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Devem comunicar-se os resultados obtidos com a aplicação do modelo de negociação de correlação regulamentar a cada uma das carteiras. Os valores devem ser comunicados para cada uma das datas indicadas na coluna 0010. Esta célula deve ser deixada em branco caso a instituição não utilize um modelo de negociação de correlação na data indicada na coluna 0010 (ou seja, o valor zero só deve ser comunicado se o resultado do cálculo for zero).

C 120.01 — SBM. SENSIBILIDADES AO RISCO POR INSTRUMENTO/CARTEIRA

As instituições devem comunicar, instrumento a instrumento, as sensibilidades em relação aos fatores de risco a que o instrumento está exposto. Deve comunicar-se um fator de risco/sensibilidade por linha. A posição líquida de risco de curvatura ascendente desse fator de risco (CVRk+) ou a posição líquida de risco de curvatura descendente desse fator de risco (CVRk-), conforme especificado no artigo 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013, deve ser comunicada em linhas individuais. Todos os valores devem reportar-se à "data de referência final das RM (e final do ASA)" [conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), subalínea v), do presente regulamento]. As instituições devem comunicar cada combinação de Carteira, Número do instrumento (coluna 0010), Identificador de risco (coluna 0020), Escalão (coluna 0030) e Identificador adicional (coluna 0040) apenas uma vez.

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5.	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Número do instrumento	Anexo V, secção 2	Deve comunicar-se o número do instrumento retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0020	Identificador do fator de risco	Artigos 325.º-L, 325.º-M, 325.º-N, 325.º-O, 325.º-P e 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o identificador do fator de risco especificado no quadro no final do presente anexo.
0030	Escalão	Artigo 325.º-D, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o escalão, caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0020 corresponda à classe de risco: — Risco de taxa de juro geral. A resposta deve ser a designação da moeda da taxa isenta de risco, inflação ou fator de risco de base cambial relevantes (de acordo com a designação da moeda ISO 4217, por exemplo, "EUR"). — Risco de spread de crédito de não titularizações A resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AH, n.º 1, quadro 4, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. — Risco de spread de crédito de titularizações não incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR não-ACTP). A resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AM, n.º 1, quadro 7, desse regulamento. — Risco de spread de crédito de titularizações incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR ACTP). A resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AK, quadro 6, desse regulamento. — Risco de títulos de capital próprio. A resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AP, n.º 1, quadro 8, desse regulamento. — Risco de mercadorias. A resposta deve o número do escalão previsto no artigo 325.º-AS, quadro 9, desse regulamento. — Risco cambial e os componentes Delta ou Curvatura. A resposta deve ser o nome da moeda (por exemplo, "USD", os códigos de moeda comunicados devem seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas). — Risco cambial e o componente Vega. A resposta deve ser o nome do par de moedas (por exemplo, "EUR_USD", os códigos de moeda comunicados devem seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas).
0040	Identificador adicional1	Artigos 325.º-I a 325.º-Q e 325.º-AI do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Devem comunicar-se as seguintes informações, que distinguem o fator de risco ao nível dos escalões. Caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0020 corresponda à classe de risco: — Risco de taxa de juro geral e a componente Delta, a resposta deve ser o nome da curva isenta de risco ou outro identificador único correspondente. — Risco de spread de crédito para não titularizações ou risco de spread de crédito da classe de risco para titularização incluída na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR ACTP), a resposta deve ser o nome do emitente ou outro identificador único correspondente e deve ser idêntica para quaisquer duas sensibilidades comunicadas em relação a dois fatores de risco que recebem um parâmetro de correlação ρ_{kl} (^{nome}) igual a 1 nos termos do artigo 325.º-AI, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. — Risco de spread de crédito de titularizações não incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR não-ACTP), a resposta deve ser o nome da tranche ou outro identificador único correspondente. — Risco de títulos de capital próprio, a resposta deve ser o nome do emitente de títulos de capital ou um identificador único correspondente.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			— Risco de mercadorias, a resposta deve ser o nome da mercadoria ou outro identificador único correspondente. Caso não se aplique nenhum desses casos, as instituições devem relatar um valor explícito (NULL) como não aplicável.
0060	Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda de comunicação)	Artigo 325.º-D, n.º 2, e artigos 325.º-G, 325.º-R, 325.º-S, 325.º-Te 325.º-AX do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As sensibilidades ao risco (sensibilidades delta/vega e posições de risco de curvatura) devem ser comunicadas ao nível de cada instrumento para todos os fatores de risco relevantes, conforme especificado nas colunas 0020 a 0040. Os valores devem ser comunicados na moeda de comunicação da instituição. Caso o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0020 corresponda à: — Componente de risco delta do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se a sensibilidade líquida ao fator de risco (S_k) como especificado no artigo 325.º-R do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Caso as instituições tenham obtido autorização da sua autoridade competente para utilizar definições alternativas de sensibilidades ao risco Delta em conformidade com o artigo 325.º-T, n.º 5, do referido regulamento, devem remeter para essas definições alternativas para a comunicação de informações. — Componente de risco vega do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se a sensibilidade ao risco vega de uma opção para um determinado fator de risco (Sk) como especificado no artigo 325.º-S do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Caso as instituições tenham obtido autorização da sua autoridade competente para utilizar cálculos alternativos das sensibilidades ao risco Vega nos termos do artigo 325.º-T, n.º 6, do referido regulamento, devem referir-se a esses cálculos alternativos para efeitos da comunicação de informações. Independentemente de a instituição utilizar o cálculo do artigo 325.º-S ou um cálculo alternativo nos termos do artigo 325.º-T, n.º 6, do referido regulamento, a sensibilidade deve ser comunicada após ponderação pela volatilidade implícita correspondente. — Componente do risco de curvatura do método baseado nas sensibilidades, deve comunicar-se a posição líquida de risco de curvatura ascendente desse fator de risco (CVR_k^+) ou a posição líquida de risco de curvatura descendente desse fator de risco (CVR_k^-) como especificado no artigo 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013. O valor comunicado deve ser expresso em números decimais, com uma precisão mínima de duas casas decimais. Só deve ser comunicado o valor zero caso o resultado do cálculo seja efetivamente zero.
0070	Moeda de comunicação		Deve comunicar-se o nome da moeda de comunicação da instituição (o valor comunicado deve seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas, por exemplo, "EUR").
0080	Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda da carteira da EBA)	Anexo V, secções 3 e 4, do presente regulamento e Artigo 325.º-D, n.º 2, e artigos 325.º-G, 325.º-R, 325.º-S, 325.º-Te 325.º-AX do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores devem ser comunicados de acordo com as instruções para a coluna 0060, mas convertidos à taxa de câmbio à vista do BCE associada à moeda da carteira, como definido no anexo V, secções 3 e 4, do presente regulamento.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0090	Ponderador de risco	Parte 3, título IV, capítulo 1-A, secção 6, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o ponderador de risco correspondente ao fator de risco especificado nas colunas 0020 a 0040. Se o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0020 corresponder à componente de risco de curvatura, deve comunicar-se o ponderador de risco utilizado para determinar a variação relativa aplicável. O valor comunicado deve ser expresso em números decimais, com uma precisão mínima de quatro casas decimais.
0110	Identificador adicional2	Artigo 325.º-P, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Se o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponder à classe de risco "Risco de Mercadoria" e ao componente de risco delta do método baseado nas sensibilidades, a resposta deve ser o conjunto de termos jurídicos relativos ao local de entrega ou outro identificador único correspondente. Caso não se aplique nenhum desses casos, as instituições devem relatar um valor explícito (NULL) como não aplicável.
0120	Categoria de qualidade de crédito	Artigo 325.º-M, n.º 1, e artigo 325.º-AH, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Se o identificador do fator de risco selecionado na coluna 0010 corresponder à categoria de risco de spread de crédito de não titularizações e à componente de risco delta do método baseado nas sensibilidades, a resposta deve ser uma das seguintes: (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Nenhum CQS atribuído (não classificado)". Caso não se aplique nenhum desses casos, as instituições devem relatar um valor explícito (NULL) como não aplicável.

C 120.02 — SBM. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5.	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V.

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Classe de risco	Artigo 325.º-D, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se a classe de risco. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Risco de taxa de juro geral (GIRR)"; (b) "Risco de spread de crédito. Não titularizações CSR" (risco de spread de crédito de não titularizações); (c) "Risco de spread de crédito. CSR não ACTP" [risco de spread de crédito de titularizações não incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR não ACTP)]; (d) "Risco de spread de crédito. CSR ACTP" [risco de spread de crédito de titularizações incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR ACTP)]; (e) "Risco de títulos de capital próprio"; (f) "Risco de mercadorias"; (g) "Risco cambial".
0020	Componente	Artigo 325.º-E, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se a componente do método baseado nas sensibilidades. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Risco Delta"; (b) "Risco Vega"; (c) "Risco de curvatura";
0030	Cenário de correlação	Artigo 325.º-H do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o cenário de correlação. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Cenário de correlações médias"; (b) "Cenário de correlações elevadas"; (c) "Cenário de correlações baixas".
0040	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda de comunicação)	Artigo 325.º-H do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores dos requisitos de fundos próprios devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" [conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento] para cada carteira para todas as combinações relevantes de classe de risco, componente e cenário de correlação. Os valores devem ser comunicados na moeda de comunicação da instituição e expressos com uma precisão mínima de duas casas decimais.
0050	Moeda de comunicação		Deve comunicar-se a moeda de comunicação da instituição (o valor comunicado deve seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas).
0060	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda da carteira da EBA)	Secções 3 e 4 do anexo V do presente regulamento e artigo 325.º-H do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores devem ser comunicados de acordo com as instruções para a coluna 0040, mas convertidos à taxa de câmbio à vista do BCE associada à moeda da carteira, como definido no anexo V, secções 3 e 4, do presente regulamento.
0070	Posições sem opcionalidade sujeitas a requisitos de fundos próprios para risco de curvatura	Artigo 325.º-E, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a componente selecionada na coluna 0020 corresponda ao risco de curvatura: (a) Deve comunicar-se "VERDADEIRO" se a instituição aplicar o método estabelecido no artigo 325.º-E, n.º 3, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 no cálculo do resultado comunicado nas colunas 0040 e 0060. (b) Nos restantes casos, deve comunicar-se "FALSO". Caso não se aplique nenhum dos casos referidos, deve comunicar-se "FALSO".

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0080	Método da moeda de base aplicado aos riscos delta e de curvatura do risco cambial	Artigo 325.º-Q, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a classe de risco da coluna 0010 corresponda ao risco cambial e a componente da coluna 0020 corresponda ao risco delta ou ao risco de curvatura: (a) Deve comunicar-se "VERDADEIRO" se a instituição aplicar o método estabelecido no artigo 325.º-Q, n.º 7, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 no cálculo do resultado comunicado nas colunas 0040 e 0060. (b) Nos restantes casos, deve comunicar-se "FALSO". Caso não se aplique nenhum dos casos referidos, deve comunicar-se "FALSO".
0090	Divisão dos componentes do risco de curvatura para o risco cambial por escalar	Artigo 325.º-Q, n.º 6, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a classe de risco da coluna 0010 corresponda ao risco cambial e a componente da coluna 0020 corresponda ao risco de curvatura: (a) Deve comunicar-se "VERDADEIRO" se a instituição aplicar o método estabelecido no artigo 325.º-Q, n.º 6, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 no cálculo do resultado comunicado nas colunas 0040 e 0060. (b) Nos restantes casos, deve comunicar-se "FALSO". Caso não se aplique nenhum dos casos referidos, deve comunicar-se "FALSO".
0095	Apresentação dos resultados da carteira de validação SBM	Artigo 325.º-E, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Se a carteira para a qual são comunicadas informações for uma carteira de validação SBM a que se refere o anexo V, secção 7: a) "Apresentado" deve ser comunicado se a instituição apresentar resultados correspondentes a esta carteira; b) "Não apresentado - sem exposição a um fator de risco" deve ser comunicado se a instituição optar por não apresentar resultados para a carteira de validação SBM relevante, uma vez que não existe aprovação interna pela direção dessa instituição para operar em instrumentos que gerariam exposição sobre o fator de risco relevante. "Não aplicável" deve ser comunicado se a carteira para a qual são comunicadas informações for uma carteira a que se refere o anexo V, secções 4, 5 ou 3.
0100	Caixa de texto livre		As instituições podem prestar quaisquer informações adicionais nesta coluna.

C 120.04 — DRC. VALORES DE MERCADO E MONTANTES BRUTOS POR JTD POR INSTRUMENTO/CARTEIRA

As instituições devem comunicar, instrumento a instrumento, as posições em risco correspondentes ao instrumento. Deve comunicar-se uma posição em risco por linha. Todos os valores devem reportar-se à "data de referência final das RM (e final do ASA)" [conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), subalínea v), do presente regulamento]. As posições em risco devem ser comunicadas antes de qualquer compensação, mas após fases de replicação ou decomposição [tal como definido nos artigos 325.º-Z e 325.º-AC do Regulamento (UE) n.º 575/2013], quando aplicável.

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5.	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Número do instrumento	Anexo V, secção 2	Deve comunicar-se o número do instrumento retirado do anexo V.
0020	Classe de risco	Artigo 325.º-V, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se a classe de risco para a qual o requisito para o risco de incumprimento (DRC) é comunicado nas colunas 0030 e 0040. A resposta deve ser um dos seguintes tipos de instrumentos: (a) "Instrumentos que não sejam posições de titularização"; (b) "Posições de titularização não incluídas na ACTP"; (c) "Posições de titularização incluídas na ACTP".
0030	Escalão1	Artigo 325.º-Y, n.º 3, artigo 325.º-AA, n.º 4, e artigo 325.º-AD, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o escalão. Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "não titularizações", a resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Empresas"; (b) "Entidades soberanas"; (c) "Administrações locais/municípios". Se, em vez disso, a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponder "titularizações não incluídas na ACTP", a resposta deve ser a) acima ou uma das seguintes respostas: (d) "ABCP - Ásia"; (e) "ABCP - Europa"; (f) "ABCP - América do Norte"; (g) "ABCP - Resto do mundo"; (h) "Empréstimos/locações automóveis - Ásia"; (i) "Empréstimos/locações automóveis - Europa"; (j) "Empréstimos/locações automóveis - América do Norte"; (k) "Empréstimos/locações automóveis - Resto do mundo"; (l) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - Ásia"; (m) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - Europa"; (n) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - América do Norte"; (o) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - Resto do mundo"; (p) "Obrigações de empréstimo garantidas - Ásia"; (q) "Obrigações de empréstimo garantidas - Europa"; (r) "Obrigações de empréstimo garantidas - América do Norte"; (s) "Obrigações de empréstimo garantidas - Resto do mundo"; (t) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - Ásia"; (u) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - Europa"; (v) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - América do Norte"; (w) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - Resto do mundo"; (x) "Cartões de crédito - Ásia"; (y) "Cartões de crédito - Europa"; (z) "Cartões de crédito - América do Norte"; (aa) "Cartões de crédito - Resto do mundo"; (bb) "Outro retalho - Ásia"; (cc) "Outro retalho - Europa"; (dd) "Outro retalho - América do Norte";

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			(ee) "Outro retalho - Resto do mundo"; (ff) "Outro grossista - Ásia"; (gg) "Outro grossista - Europa"; (hh) "Outro grossista - América do Norte"; (ii) "Outro grossista - Resto do mundo"; (jj) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - Ásia"; (kk) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - Europa"; (ll) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - América do Norte"; (mm) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - Resto do mundo"; (nn) "Pequenas e médias empresas (PME) - Ásia"; (oo) "Pequenas e médias empresas (PME) - Europa"; (pp) "Pequenas e médias empresas (PME) - América do Norte"; (qq) "Pequenas e médias empresas (PME) - Resto do mundo"; (rr) "Empréstimos a estudantes - Ásia"; (ss) "Empréstimos a estudantes - Europa"; (tt) "Empréstimos a estudantes - América do Norte"; (uu) "Empréstimos a estudantes - Resto do mundo"; Se, em vez disso, a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponder "titularizações incluídas na ACTP", a resposta deve ser "titularizações incluídas na ACTP".
0040	Escalão2	Artigo 325.º-AD, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "titularizações incluídas na ACTP", a resposta deve ser o nome do índice; caso contrário, deve ser comunicado o valor (NUL).
0050	Devedor	Artigo 325.º-V, n.º 2, artigo 325.º-X, n.º 1, e artigos 325.º-Z e 325.º-AC do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar informações relativas ao devedor. Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a: — "Instrumentos que não sejam posições de titularização", a resposta deve ser a designação do devedor; — "Posições de titularização não incluídas na ACTP", a resposta deve ser o nome do devedor ou um identificador único que indique o conjunto de ativos subjacentes e a tranche; — "Posições de titularização incluídas na ACTP", a resposta deve ser um identificador único que indique a família do índice, a série e a tranche.
0060	Categoria de qualidade de crédito	Artigo 325.º-Y, n.ºs 1 e 2, artigo 325.º-AA, n.º 1, e artigo 325.º-AD, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar a qualidade de crédito. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) "CQS 1"; (b) "CQS 2"; (c) "CQS 3"; (d) "CQS 4"; (e) "CQS 5"; (f) "CQS 6"; (g) "Nenhum CQS atribuído (não classificado)";

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			(h) "Nenhum CQS atribuído (em incumprimento)"; (i) "Nenhum CQS atribuído (ponderador de risco 0 %)". Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "titularizações incluídas na ACTP" ou "titularizações não incluídas na ACTP", a resposta deve ser uma das respostas acima ou uma das seguintes: (j) "CQS 7"; (k) "CQS 8"; (l) "CQS 9"; (m) "CQS 10"; (n) "CQS 11"; (o) "CQS 12"; (p) "CQS 13"; (q) "CQS 14"; (r) "CQS 15"; (s) "CQS 16"; (t) "CQS 17"; (u) "CQS Todos os Outros".
0070	Ponderador de risco de incumprimento	Artigo 325.º-V, n.º 1, alínea f), artigo 325.º-Y, n. os 1 e 2, artigo 325.º-AA, n.º 1, e artigo 325.º-AD, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar o ponderador de risco relevante. Os ponderadores de risco aplicados às posições em risco de titularização devem ser comunicados após multiplicação por 8 % em conformidade com o artigo 325.º-AA, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013.
0080	Grau de prioridade	Artigo 325.º-W, n. os 3 e 6, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicado o grau de prioridade da posição em risco. Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização" ou "titularizações não incluídas na ACTP", a resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Instrumentos de capital próprio"; (b) "Instrumentos de dívida não sénior"; (c) "Instrumentos de dívida sénior"; (d) "Obrigações cobertas". Caso não se aplique nenhum dos casos referidos, o campo deve ser deixado em branco.
0090	Prazo de vencimento	Artigos 325.º-X, 325.º-Z e 325.º-AC do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve ser comunicado o prazo de vencimento da posição em risco. Deve adotar-se a convenção "dd/mm/aaaa" para comunicar as datas.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0100	Taxa de recuperação	Artigo 325.º-V, n.º 1, alínea e), do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar a taxa de recuperação. A taxa de recuperação deve ser calculada utilizando a perda dado o incumprimento (LGD) aplicável como taxa de recuperação = 1 - LGD. O valor da taxa de recuperação comunicado deve ser expresso em números decimais, entre 0 e 1, com uma precisão mínima de quatro casas decimais.
0110	Sentido	Artigo 325.º-V, n.º 1, alíneas a) e b), do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar o sentido da posição em risco em conformidade com as definições do artigo 325.º-V, n.º 1, alíneas a) e b), do Regulamento (UE) n.º 575/2013. A resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Posição em risco curta"; (b) "Posição em risco longa".
0120	Ponto de conexão (%)	Artigos 325.º-AA e 325.º-AD do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a posição em risco comunicada se referir a uma tranche, as instituições devem comunicar o ponto de conexão da tranche. O valor comunicado deve ser expresso em números decimais, com uma precisão mínima de quatro casas decimais.
0130	Ponto de desconexão (%)	Artigos 325.º-AA e 325.º-AD do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a posição em risco comunicada se referir a uma tranche, as instituições devem comunicar o ponto de desconexão da tranche. O valor comunicado deve ser expresso em números decimais, com uma precisão mínima de quatro casas decimais.
0140 - 0170	Resultados na moeda de comunicação		Os valores devem ser comunicados com referência à moeda de comunicação da instituição e expressos com uma precisão mínima de duas casas decimais, quando aplicável.
0140	Nocional	Artigo 325.º-W, n.os 1, 2 e 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização", as instituições devem comunicar o montante nocional do instrumento. O valor deve corresponder ao termo $V_{nocional}$ constante do artigo 325.º-W, n.os 1 e 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 ou ao termo V constante do artigo 325.º-W, n.º 5, do mesmo regulamento, consoante o tipo de posição em risco. O campo deve ser deixado em branco se não for aplicável nenhum dos casos referidos ou se a instituição não calcular ou utilizar explicitamente o montante a comunicar nesta coluna para estimar o montante bruto por incumprimento (JTD).
0150	P&L + Ajustamento	Artigo 325.º-W, n.os 1, 2 e 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar a soma do P&L + Ajustamento para cada posição em risco: — Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização" e a posição em risco comunicada for uma posição em risco longa, as instituições devem comunicar a soma de $P\&L_{longo}$ e $Ajustamento_{longo}$ em conformidade com o artigo 325.º-W, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. — Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização" e a posição em risco comunicada for uma posição em risco curta, as instituições devem comunicar a soma de $P\&L_{curto}$ e $Ajustamento_{curto}$ em conformidade com o artigo 325.º-W, n.º 2, do referido regulamento.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			O campo deve ser deixado em branco se não for aplicável nenhum dos casos referidos ou se a instituição não calcular ou utilizar explicitamente o montante a comunicar nesta coluna para estimar o montante bruto por JTD.
0160	Montante bruto por JTD	Artigo 325.º-V, n.º 1, alínea c), artigo 325.º-W, n.os 1, 2 e 5, artigo 325.º-Z, n.º 1, e artigo 325.º-AC, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar o montante bruto por incumprimento súbito (JTD) para a posição em risco específica.
0170	Moeda		Deve comunicar-se a moeda de comunicação da instituição (o valor comunicado deve seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas).
0180 - 0200	Resultados na moeda da carteira da EBA	Secções 3 e 4 do anexo V do presente regulamento e artigos 325.º-Y, 325.º-AA e 325.º-AD do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores devem ser comunicados de acordo com as instruções para a coluna 0030, mas convertidos à taxa de câmbio à vista do BCE associada à moeda da carteira, como definido no anexo V, secções 3 e 4, do presente regulamento.
0180	Nocional	Artigo 325.º-W, n.os 1, 2 e 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização", as instituições devem comunicar o montante nocional do instrumento. O valor deve corresponder ao termo $V_{nocional}$ constante do artigo 325.º-W, n.os 1 e 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013 ou ao termo V constante do artigo 325.º-W, n.º 5, do mesmo regulamento, consoante o tipo de posição em risco. O campo deve ser deixado em branco se não for aplicável nenhum dos casos referidos ou se a instituição não calcular ou utilizar explicitamente o montante a comunicar nesta coluna para estimar o montante bruto por JTD.
0190	P&L + Ajustamento	Artigo 325.º-W, n.os 1, 2 e 5, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar a soma do P&L + Ajustamento para cada posição em risco: — Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização" e a posição em risco comunicada for uma posição em risco longa, as instituições devem comunicar a soma de $P\&L_{longo}$ e $Ajustamento_{longo}$ em conformidade com o artigo 325.º-W, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. — Caso a classe de risco comunicada na coluna 0020 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização" e a posição em risco comunicada for uma posição em risco curta, as instituições devem comunicar a soma de $P\&L_{curto}$ e $Ajustamento_{curto}$ em conformidade com o artigo 325.º-W, n.º 2, do referido regulamento.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			O campo deve ser deixado em branco se não for aplicável nenhum dos casos referidos ou se a instituição não calcular ou utilizar explicitamente o montante a comunicar nesta coluna para estimar o montante bruto por JTD.
0200	Montante bruto por JTD	Artigo 325.º-V, n.º 1, alínea c), artigo 325.º-W, n.ºs 1, 2 e 5, artigo 325.º-Z, n.º 1, e artigo 325.º-AC, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	As instituições devem comunicar o montante bruto por incumprimento súbito (JTD) para a posição em risco específica.

C 120.05 — DRC. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA

Instruções sobre as folhas (eixo dos z)

Identificador	Referência jurídica	Instruções
Carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5.	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V.

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Classe de risco	Artigo 325.º-V, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se a classe de risco para a qual foram comunicados os requisitos para o risco de incumprimento nas colunas 0030 e 0040. A resposta deve ser um dos seguintes tipos de instrumentos: (a) "Instrumentos que não sejam posições de titularização"; (b) "Posições de titularização não incluídas na ACTP"; (c) "Posições de titularização incluídas na ACTP".
0020	Escalão1	Artigo 325.º-Y, n.º 3, artigo 325.º-AA, n.º 4, e artigo 325.º-AD, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Deve comunicar-se o escalão. Caso a classe de risco comunicada na coluna 0010 corresponda a "Instrumentos que não sejam posições de titularização", a resposta deve ser uma das seguintes: (a) "Empresas"; (b) "Entidades soberanas"; (c) "Administrações locais/municípios".

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			Se, em vez disso, a classe de risco comunicada na coluna 0010 corresponder a "posições de titularização não incluídas na ACTP", a resposta deve ser uma das seguintes: (d) "ABCP - Ásia"; (e) "ABCP - Europa"; (f) "ABCP - América do Norte"; (g) "ABCP - Resto do mundo"; (h) "Empréstimos/locações automóveis - Ásia"; (i) "Empréstimos/locações automóveis - Europa"; (j) "Empréstimos/locações automóveis - América do Norte"; (k) "Empréstimos/locações automóveis - Resto do mundo"; (l) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - Ásia"; (m) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - Europa"; (n) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - América do Norte"; (o) "Obrigações de dívida garantidas ao quadrado (CDO-squared) - Resto do mundo"; (p) "Obrigações de empréstimo garantidas - Ásia"; (q) "Obrigações de empréstimo garantidas - Europa"; (r) "Obrigações de empréstimo garantidas - América do Norte"; (s) "Obrigações de empréstimo garantidas - Resto do mundo"; (t) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - Ásia"; (u) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - Europa"; (v) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - América do Norte"; (w) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários comerciais (CMBS) - Resto do mundo"; (x) "Cartões de crédito - Ásia"; (y) "Cartões de crédito - Europa"; (z) "Cartões de crédito - América do Norte"; (aa) "Cartões de crédito - Resto do mundo"; (bb) "Outro retalho - Ásia"; (cc) "Outro retalho - Europa"; (dd) "Outro retalho - América do Norte"; (ee) "Outro retalho - Resto do mundo"; (ff) "Outro grossista - Ásia"; (gg) "Outro grossista - Europa"; (hh) "Outro grossista - América do Norte"; (ii) "Outro grossista - Resto do mundo"; (jj) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - Ásia"; (kk) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - Europa"; (ll) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - América do Norte"; (mm) "Valores mobiliários garantidos por créditos hipotecários residenciais (RMBS) - Resto do mundo"; (nn) "Pequenas e médias empresas (PME) - Ásia"; (oo) "Pequenas e médias empresas (PME) - Europa"; (pp) "Pequenas e médias empresas (PME) - América do Norte"; (qq) "Pequenas e médias empresas (PME) - Resto do mundo"; (rr) "Empréstimos a estudantes - Ásia";

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
			(ss) "Empréstimos a estudantes - Europa"; (tt) "Empréstimos a estudantes - América do Norte"; (uu) "Empréstimos a estudantes - Resto do mundo"; Se, em vez disso, a classe de risco comunicada na coluna 0010 corresponder a "posições de titularização incluídas na ACTP", a resposta deve ser "titularizações incluídas na ACTP".
0030	Escalão2	Artigo 325.º-AD, n.º 2, do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Caso a classe de risco comunicada na coluna 0010 corresponda a "posições de titularização incluídas na ACTP", a resposta deve ser o nome do índice; caso contrário, deve ser comunicado o valor (NUL).
0040	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda de comunicação)	Artigos 325.º-Y, 325.º-AA e 325.º-AD do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para risco de incumprimento devem ser comunicados para a "data de referência final das RM (e final do ASA)" [conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento]. Os valores devem ser comunicados na moeda de comunicação da instituição e expressos com uma precisão mínima de duas casas decimais.
0050	Moeda de comunicação		Deve comunicar-se a moeda de comunicação da instituição (o valor comunicado deve seguir a norma ISO 4217 relativa à designação de moedas).
0060	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda da carteira da EBA)	Secções 3 e 4 do anexo V do presente regulamento e artigos 325.º-Y, 325.º-AA e 325.º-AD do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os valores devem ser comunicados de acordo com as instruções para a coluna 0030, mas convertidos à taxa de câmbio à vista do BCE associada à moeda da carteira, como definido no anexo V, secções 3 e 4, do presente regulamento.

C 120.06 — ASA. REQUISITO DE FUNDOS PRÓPRIOS (OFR)

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0010	Número da carteira	Anexo V, secções 3, 4 e 5.	Deve ser comunicado o número da carteira retirado do anexo V.
0020 - 0040	Resultados na moeda de comunicação	Anexo V, secções 3 e 4.	

Coluna	Identificador	Referência jurídica	Instruções
0020	SBM OFR	Artigo 325.º-H do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para o método baseado nas sensibilidades de acordo com o Método-Padrão alternativo devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" (conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento) para cada carteira.
0030	DRC OFR	Artigo 325.º-V do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para o requisito para risco de incumprimento de acordo com o Método-Padrão alternativo devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" (conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento) para cada carteira.
0040	RRAO OFR	Artigo 325.º-U do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para o acréscimo correspondente ao risco residual de acordo com o Método-Padrão alternativo devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" (conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento) para cada carteira.
0050 - 0070	Resultados na moeda da carteira da EBA	Anexo V, secções 3 e 4.	Caso a moeda de comunicação da instituição seja diferente das moedas da carteira da EBA especificadas no anexo V, secções 3 e 4, as instituições devem converter a moeda de comunicação à taxa de câmbio à vista do ECB aplicável.
0050	SBM OFR	Artigo 325.º-H do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para o método baseado nas sensibilidades de acordo com o Método-Padrão alternativo devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" (conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento) para cada carteira.
0060	DRC OFR	Artigo 325.º-V do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para o requisito para risco de incumprimento de acordo com o Método-Padrão alternativo devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" (conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento) para cada carteira.
0070	RRAO OFR	Artigo 325.º-U do Regulamento (UE) n.º 575/2013	Os requisitos de fundos próprios para o acréscimo correspondente ao risco residual de acordo com o Método-Padrão alternativo devem ser comunicados relativamente à "data de referência final das RM (e final do ASA)" (conforme especificado no anexo V, secção 1, alínea b), do presente regulamento) para cada carteira.

Quadro: orientações para o preenchimento dos modelos 106.01 (coluna 0010) e 120.01 (coluna 0020)

— A coluna "classe de risco" refere-se ao artigo 325.º-D, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. São utilizados os seguintes acrónimos para designar as classes de risco:

a) "GIRR" (risco de taxa de juro geral);

b) "CSR_NON_SEC" [risco de spread de crédito (CSR) de não titularizações];

c) "CSR_SEC_NON_ACTP" [risco de spread de crédito de titularizações não incluídas na carteira de negociação de correlação alternativa (CSR não-ACTP)];

d) "CSR_SEC_ACTP" [risco de spread de crédito de titularizações incluídas na carteira de negociação de correlação (CSR ACTP)];

e) "EQ" (risco de títulos de capital próprio);

f) "CM" (risco de mercadorias);

g) "FX" (risco cambial).

— A coluna "componente" refere-se ao artigo 325.º-E, n.º 1, do Regulamento (UE) n.º 575/2013. São utilizados os seguintes acrónimos para designar as componentes do método baseado nas sensibilidades:

a) "DELTA" (risco Delta);

b) "VEGA" (risco Vega);

c) "CURVATURA" (risco de curvatura).

— A coluna "prazo de vencimento" refere-se ao prazo de vencimento do fator de risco, caso os fatores de risco sejam definidos em função de vértices especificados de acordo com o disposto nos artigos 325.º-L, 325.º-M, 325.º-N, 325.º-O, 325.º-P e 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013. Para os fatores de risco Vega de taxa de juro geral especificados no artigo 325.º-L, n.º 7, desse regulamento, indicam-se dois prazos de vencimento, separados por um hífen (por exemplo "0,5 anos - 0,5 anos"), em que o primeiro se refere ao prazo de vencimento da opção e o segundo ao prazo de vencimento residual do subjacente da opção na data de vencimento da opção.

— A coluna "Especificações adicionais" especifica mais pormenorizadamente o respetivo fator de risco no que diz respeito à distinção entre os fatores de risco de inflação e os fatores de risco de base cambial em conformidade com o artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013, à distinção entre os fatores de risco relacionados com instrumentos de dívida e os fatores de risco relacionados com swaps de risco de incumprimento em conformidade com os artigos 325.º-M e 325.º-N desse regulamento, à distinção entre os fatores de risco dos preços à vista dos títulos de capital e os fatores de risco das taxas dos acordos de recompra de títulos de capital em conformidade com o artigo 325.º-O desse regulamento e à distinção entre a posição líquida de risco de curvatura ascendente desse fator de risco (CVRk +) ou a posição líquida do risco de curvatura descendente desse fator de risco (CVRk-), conforme especificado no artigo 325.º-G desse regulamento.

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
CM	DELTA	0 anos		CM_D_00.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	0,25 anos		CM_D_00.25	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	0,5 anos		CM_D_00.50	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	1 ano		CM_D_01.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	2 anos		CM_D_02.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	3 anos		CM_D_03.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	5 anos		CM_D_05.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	10 anos		CM_D_10.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	15 anos		CM_D_15.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	20 anos		CM_D_20.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	DELTA	30 anos		CM_D_30.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	VEGA	0,5 anos		CM_V_00.50	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	VEGA	1 ano		CM_V_01.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	VEGA	3 anos		CM_V_03.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	VEGA	5 anos		CM_V_05.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	VEGA	10 anos		CM_V_10.00	Artigo 325.º-P do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CM	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	CM_CU	Artigos 325.º-P e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
CM	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	CM_CD	Artigos 325.º-P e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 anos	Instrumento de dívida	CSR_NON_SEC_D_00.50_DEBT	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 ano	Instrumento de dívida	CSR_NON_SEC_D_01.00_DEBT	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 anos	Instrumento de dívida	CSR_NON_SEC_D_03.00_DEBT	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 anos	Instrumento de dívida	CSR_NON_SEC_D_05.00_DEBT	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 anos	Instrumento de dívida	CSR_NON_SEC_D_10.00_DEBT	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	0,5 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_NON_SEC_D_00.50_CDS	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	1 ano	Swap de risco de incumprimento	CSR_NON_SEC_D_01.00_CDS	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	3 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_NON_SEC_D_03.00_CDS	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	5 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_NON_SEC_D_05.00_CDS	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	DELTA	10 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_NON_SEC_D_10.00_CDS	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	0,5 anos		CSR_NON_SEC_V_00.50	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	1 ano		CSR_NON_SEC_V_01.00	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	3 anos		CSR_NON_SEC_V_03.00	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	5 anos		CSR_NON_SEC_V_05.00	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	VEGA	10 anos		CSR_NON_SEC_V_10.00	Artigo 325.º-M do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_NON_SEC	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	CSR_NON_SEC_CU	Artigos 325.º-M e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
CSR_NON_SEC	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	CSR_NON_SEC_CD	Artigos 325.º-M e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 ano	Instrumento de dívida	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	0,5 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_ACTP_D_00.50_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	1 ano	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_ACTP_D_01.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	3 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_ACTP_D_03.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	5 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_ACTP_D_05.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	DELTA	10 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_ACTP_D_10.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	0,5 anos		CSR_SEC_ACTP_V_00.50	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	1 ano		CSR_SEC_ACTP_V_01.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	3 anos		CSR_SEC_ACTP_V_03.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	5 anos		CSR_SEC_ACTP_V_05.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	VEGA	10 anos		CSR_SEC_ACTP_V_10.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_ACTP	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	CSR_SEC_ACTP_CU	Artigos 325.º-N e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
CSR_SEC_ACTP	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	CSR_SEC_ACTP_CD	Artigos 325.º-N e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_00.50_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 ano	Instrumento de dívida	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_01.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_03.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_05.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 anos	Instrumento de dívida	CSR_SEC_NO-N_ACTP_D_10.00_DEBT	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	0,5 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_NON_ACTP_D_00.50_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	1 ano	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_NON_ACTP_D_01.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	3 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_NON_ACTP_D_03.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	5 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_NON_ACTP_D_05.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	DELTA	10 anos	Swap de risco de incumprimento	CSR_SEC_NON_ACTP_D_10.00_CDS	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	0,5 anos		CSR_SEC_NON_ACTP_V_00.50	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	1 ano		CSR_SEC_NON_ACTP_V_01.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	3 anos		CSR_SEC_NON_ACTP_V_03.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	5 anos		CSR_SEC_NON_ACTP_V_05.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	VEGA	10 anos		CSR_SEC_NON_ACTP_V_10.00	Artigo 325.º-N do Regulamento (UE) n.º 575/2013
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	CSR_SEC_NON_ACTP_CU	Artigos 325.º-N e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
CSR_SEC_NO-N_ACTP	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	CSR_SEC_NON_ACTP_CD	Artigos 325.º-N e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	DELTA		Preço à vista	EQ_D_SPOT	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	DELTA		Taxa de recompra	EQ_D_REPO	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	VEGA	0,5 anos		EQ_V_00.50	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	VEGA	1 ano		EQ_V_01.00	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	VEGA	3 anos		EQ_V_03.00	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	VEGA	5 anos		EQ_V_05.00	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	VEGA	10 anos		EQ_V_10.00	Artigo 325.º-O do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	EQ_CU	Artigos 325.º-O e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
EQ	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	EQ_CD	Artigos 325.º-O e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	DELTA			FX_D	Artigo 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	VEGA	0,5 anos		FX_V_00.50	Artigo 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	VEGA	1 ano		FX_V_01.00	Artigo 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	VEGA	3 anos		FX_V_03.00	Artigo 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	VEGA	5 anos		FX_V_05.00	Artigo 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	VEGA	10 anos		FX_V_10.00	Artigo 325.º-Q do Regulamento (UE) n.º 575/2013
FX	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	FX_CU	Artigos 325.º-Q e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
FX	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	FX_CD	Artigos 325.º-Q e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	0,25 anos		GIRR_D_00.25	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	0,5 anos		GIRR_D_00.50	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	1 ano		GIRR_D_01.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	2 anos		GIRR_D_02.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	3 anos		GIRR_D_03.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	5 anos		GIRR_D_05.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	10 anos		GIRR_D_10.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	15 anos		GIRR_D_15.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	20 anos		GIRR_D_20.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA	30 anos		GIRR_D_30.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA		Inflação	GIRR_D_INF	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA		Base cambial (sobre EUR)	GIRR_D_ CRO_EUR	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	DELTA		Base cambial (sobre USD)	GIRR_D_CRO_USD	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos - 0,5 anos		GIRR_V_00.50_00.50	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano - 0,5 anos		GIRR_V_01.00_00.50	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos - 0,5 anos		GIRR_V_03.00_00.50	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
GIRR	VEGA	5 anos - 0,5 anos		GIRR_V_05.00_00.50	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos - 0,5 anos		GIRR_V_10.00_00.50	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos - 1 ano		GIRR_V_00.50_01.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano - 1 ano		GIRR_V_01.00_01.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos - 1 ano		GIRR_V_03.00_01.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos - 1 ano		GIRR_V_05.00_01.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos - 1 ano		GIRR_V_10.00_01.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos - 3 anos		GIRR_V_00.50_03.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano - 3 anos		GIRR_V_01.00_03.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos - 3 anos		GIRR_V_03.00_03.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos - 3 anos		GIRR_V_05.00_03.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos - 3 anos		GIRR_V_10.00_03.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos - 5 anos		GIRR_V_00.50_05.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano - 5 anos		GIRR_V_01.00_05.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos - 5 anos		GIRR_V_03.00_05.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos - 5 anos		GIRR_V_05.00_05.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos - 5 anos		GIRR_V_10.00_05.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
GIRR	VEGA	0,5 anos - 10 anos		GIRR_V_00.50_10.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano - 10 anos		GIRR_V_01.00_10.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos - 10 anos		GIRR_V_03.00_10.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos - 10 anos		GIRR_V_05.00_10.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos - 10 anos		GIRR_V_10.00_10.00	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos	Inflação	GIRR_V_00.50_INF	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano	Inflação	GIRR_V_01.00_INF	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos	Inflação	GIRR_V_03.00_INF	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos	Inflação	GIRR_V_05.00_INF	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos	Inflação	GIRR_V_10.00_INF	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos	Base cambial (sobre EUR)	GIRR_V_00.50_CRO_EUR	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano	Base cambial (sobre EUR)	GIRR_V_01.00_CRO_EUR	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	3 anos	Base cambial (sobre EUR)	GIRR_V_03.00_CRO_EUR	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos	Base cambial (sobre EUR)	GIRR_V_05.00_CRO_EUR	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos	Base cambial (sobre EUR)	GIRR_V_10.00_CRO_EUR	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	0,5 anos	Base cambial (sobre USD)	GIRR_V_00.50_CRO_USD	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	1 ano	Base cambial (sobre USD)	GIRR_V_01.00_CRO_USD	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013

Classe de risco	Componente	Prazo de vencimento	Especificações adicionais	Identificador do fator de risco	Referência jurídica
GIRR	VEGA	3 anos	Base cambial (sobre USD)	GIRR_V_03.00_CRO_USD	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	5 anos	Base cambial (sobre USD)	GIRR_V_05.00_CRO_USD	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	VEGA	10 anos	Base cambial (sobre USD)	GIRR_V_10.00_CRO_USD	Artigo 325.º-L do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	CURVA-TURA		Variação no sentido ascendente	GIRR_CU	Artigos 325.º-L e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013
GIRR	CURVA-TURA		Variação no sentido descendente	GIRR_CD	Artigos 325.º-L e 325.º-G do Regulamento (UE) n.º 575/2013»

ANEXO IV

«ANEXO VII -

Resultados das carteiras de análise comparativa para fins de supervisão RISCO DE MERCADO

RESULTADOS DAS CARTEIRAS DE ANÁLISE COMPARATIVA. RISCO DE MERCADO			
Número do modelo	**Código do modelo**	**Nome do modelo/grupo de modelos**	**Abreviatura**
		AVALIAÇÃO DE MERCADO INICIAL	
106,1	C 106.00	AVALIAÇÃO DE MERCADO INICIAL E JUSTIFICAÇÃO DA EXCLUSÃO	AVALIAÇÃO DE MERCADO INICIAL (IMV)
106,2	C 106.01	SENSIBILIDADES AO RISCO POR INSTRUMENTO	SENSIBILIDADES
		VaR, sVaR e PV	
107,1	C 107.01	INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS	VaR e sVaR 1
107,2	C 107.02	RESULTADOS NA MOEDA DA **CARTEIRA DA EBA**	VaR e sVaR 2
		SÉRIE CRONOLÓGICA DOS RESULTADOS	
108	C 108.00	SÉRIE CRONOLÓGICA DOS RESULTADOS	RESULTADOS
		REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS PARA RISCOS ADICIONAIS («IRC»)	
109,1	C 109.01	IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais). INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS SOBRE O MODELO	IRC 1
109,2	C 109.02	IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais). INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS POR CARTEIRA	IRC 2
109,3	C 109.03	IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais). MONTANTE POR CARTEIRA/DATA	IRC 3
		NEGOCIAÇÃO DE CORRELAÇÃO («CT»)	
110,1	C 110.01	INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS SOBRE O MODELO	CT 1
110,2	C 110.02	CT. INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS POR CARTEIRA	CT 2
110,3	C 110.03	CT. MONTANTE POR CARTEIRA/DATA	CT 3
		ASA (SBM & DRC)	
120,1	C 120.01	SBM. SENSIBILIDADES AO RISCO POR INSTRUMENTO/CARTEIRA	SBM 1
120,2	C 120.02	SBM. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA	SBM 2
120,4	C 120.04	DRC. VALORES DE MERCADO E MONTANTES BRUTOS DO JTD POR INSTRUMENTO/CARTEIRA	DRC 1
120,5	C 120.05	DRC. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA	DRC 2
120,6	C 120.06	ASA. OFR POR CARTEIRA	ASA OFR

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 106.00 - AVALIAÇÃO DE MERCADO INICIAL E JUSTIFICAÇÃO DA EXCLUSÃO

Número do instrumento	Instrumento modelizado para VaR e para sVaR (Verdadeiro/Falso)	Instrumento modelizado para IRC (Verdadeiro/Falso)	Instrumento modelizado para negociação de correlação (Verdadeiro/Falso)	Justificação da exclusão	Caixa de texto livre	Avaliação de mercado inicial («IMV»)
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070

C 106.01 - SENSIBILIDADES AO RISCO POR INSTRUMENTO

Número do instrumento

Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda de comunicação)	Moeda de comunicação	Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda do instrumento da EBA)	Modelo de fixação de preços	Definição de sensibilidades	Caixa de texto livre	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito
0010	0020	0030	0050	0060	0070	0080	0090	0100	110	120

C 107.01 - VaR, sVaR e PV. INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS

		Opção	Caixa de texto livre
		0010	0020
VaR (valor em risco);			
0010	**Metodologia**		
0020	**Computação do horizonte a 10 dias**		

		Opção	Caixa de texto livre
		0010	0020
0030	**Duração do período de observação**		
0040	**Ponderação dos dados**		
0050	**Acréscimo de verificações a posteriori**		
0060	**Acréscimo regulamentar VaR**		
sVaR (valor em risco em situação de esforço)			
0070	**Metodologia**		
0080	**Computação do horizonte a 10 dias**		
0090	**Acréscimo regulamentar sVaR**		
0100	**Período do sVaR**		

C 107.02 - VaR e sVaR NÃO CTP. RESULTADOS NA MOEDA DA CARTEIRA DA EBA

Carteira

Data	VaR (valor em risco);	sVaR (valor em risco em situação de esforço)	PV
0010	0020	0030	0040

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 108.00- SÉRIE CRONOLÓGICA DOS RESULTADOS

Carteira

Data	**Resultados diários**
0010	0020

C 109.01 - IRC. INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS SOBRE O MODELO

		Opção	**Caixa de texto livre**
Linha	**Elemento**	0010	0020
0010	**Número de fatores de modelização**		
0020	**Fonte das LGD (perdas dado o incumprimento)**		

C 109.02 - IRC. INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS POR CARTEIRA

Carteira

		Opção	Caixa de texto livre
Linha	**Elemento**	0010	0020
0010	**Horizonte de liquidez**		
0020	**Fonte das PD (probabilidades de incumprimento)**		
0030	**Fonte das matrizes de transição**		

C 109.03 - IRC. MONTANTE POR CARTEIRA/DATA

Carteira

Data	IRC (requisitos de fundos próprios para riscos adicionais)
0010	0020

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 110.01 – CT. INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS SOBRE O MODELO

		Opção	Caixa de texto livre
Linha	**Elemento**	0010	0020
0010	**Número de fatores de modelização**		
0020	**Fonte das LGD (perdas dado o incumprimento)**		

C 110.02 – CT. INFORMAÇÕES PORMENORIZADAS POR CARTEIRA

Carteira

		Opção	Caixa de texto livre
Linha	**Elemento**	0010	0020
0010	**Horizonte de liquidez**		
0020	**Fonte das PD (probabilidades de incumprimento)**		
0030	**Fonte das matrizes de transição**		

C 110.03 – CT. APR POR CARTEIRA/DATA

Carteira

Data	**APR (valores de todos os riscos de preço)**
0010	0060

C 120.01 - SBM. SENSIBILIDADES AO RISCO POR INSTRUMENTO/CARTEIRA

Carteira

Número do instrumento	**Identificador do fator de risco**	**Escalão**	**Identificador adicional**	**Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda de comunicação)**	**Moeda de comunicação**	**Sensibilidade ao risco (Resultados na moeda da carteira da EBA)**	**Ponderador de risco**	**Identificador adicional2**	**Categoria de qualidade de crédito**
0010	0020	0030	0040	0060	0070	0080	0090	110	120

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

C 120.02 - SBM. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA

Carteira

Classe de risco	Componente de risco	Cenário de correlações	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda de comunicação)	Moeda de comunicação	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda da carteira da EBA)	Posições sem opcionalidade sujeitas a requisitos de fundos próprios para risco de curvatura	Método da moeda de base aplicado aos riscos delta e de curvatura do risco cambial	Divisão dos componentes do risco de curvatura para o risco cambial por escalar	Apresentação dos resultados da carteira de validação SBM	Caixa de texto livre
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0950	0100

C 120.04 - DRC. Valores de mercado e montantes brutos do JTD por instrumento/carteira

Carteira

Número inteiro

Número do instrumento	Classe de risco	Escalão1	Escalão2	Devedor	Categoria de qualidade de crédito	Ponderador de risco de incumprimento	Grau de prioridade	Prazo de vencimento	Taxa de recuperação	Sentido	Ponto de conexão (%)	Ponto de desconexão (%)	Resultados na moeda de comunicação				Resultados na moeda da carteira da EBA		
													Nocional	P&L + Ajustamento	Montante bruto do JTD	Moeda	Nocional	P&L + Ajustamento	Montante bruto do JTD
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070	0080	0090	0100	0110	0120	0130	0140	0150	0160	0170	0180	0190	0200

C 120.05 - DRC. COMPOSIÇÃO DO OFR POR CARTEIRA

Carteira

Número inteiro

Classe de risco	Escalão1	Escalão2	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda de comunicação)	Moeda de comunicação	Requisitos de fundos próprios (resultados na moeda da carteira da EBA)
0010	0020	0030	0040	0050	0060

C 120.06 - ASA. REQUISITO DE FUNDOS PRÓPRIOS («OFR»)

Número da carteira	Resultados na moeda de comunicação			Resultados na moeda da carteira da EBA		
	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR	SBM OFR	DRC OFR	RRAO OFR
0010	0020	0030	0040	0050	0060	0070»

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

ANEXO V

««ANEXO X

Carteiras de validação SBM

Nome da folha	Descrição
Instrumentos	Instrumentos (sensibilidades e posições de risco de curvatura) para efeitos de validação do SBM
Carteiras	Carteiras de validação SBM definidas como combinações dos instrumentos definidos no presente anexo

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_IRV_b25#	GIRR_V_10.00_10.00	USD				400,00
S_IRV_b24#	GIRR_V_10.00_05.00	USD				200,00
S_IRV_b23#	GIRR_V_10.00_03.00	USD				– 900,00
S_IRV_b22#	GIRR_V_10.00_01.00	USD				950,00
S_IRV_b21#	GIRR_V_10.00_00.50	USD				– 350,00
S_IRV_b20#	GIRR_V_05.00_10.00	USD				1 000,00
S_IRV_b19#	GIRR_V_05.00_05.00	USD				– 300,00
S_IRV_b18#	GIRR_V_05.00_03.00	USD				50,00
S_IRV_b17#	GIRR_V_05.00_01.00	USD				300,00
S_IRV_b16#	GIRR_V_05.00_00.50	USD				– 50,00
S_IRV_e3#	GIRR_V_03.00_CRO_USD	BRL				500,00
S_IRV_b15#	GIRR_V_03.00_10.00	USD				– 400,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_IRV_b14#	GIRR_V_03.00_05.00	USD				700,00
S_IRV_b13#	GIRR_V_03.00_03.00	USD				– 800,00
S_IRV_b12#	GIRR_V_03.00_01.00	USD				700,00
S_IRV_b11#	GIRR_V_03.00_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_e2#	GIRR_V_01.00_INF	BRL				750,00
S_IRV_b10#	GIRR_V_01.00_10.00	USD				500,00
S_IRV_b9#	GIRR_V_01.00_05.00	USD				50,00
S_IRV_b8#	GIRR_V_01.00_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_b7#	GIRR_V_01.00_01.00	USD				200,00
S_IRV_b6#	GIRR_V_01.00_00.50	USD				900,00
S_IRV_b5#	GIRR_V_00.50_10.00	USD				100,00
S_IRV_c5#	GIRR_V_00.50_10.00	CLP				– 100,00
S_IRV_d5#	GIRR_V_00.50_10.00	EUR				– 2 000,00
S_IRV_b4#	GIRR_V_00.50_05.00	USD				100,00
S_IRV_c4#	GIRR_V_00.50_05.00	CLP				100,00
S_IRV_d4#	GIRR_V_00.50_05.00	EUR				1 500,00
S_IRV_b3#	GIRR_V_00.50_03.00	USD				– 500,00
S_IRV_c3#	GIRR_V_00.50_03.00	CLP				– 300,00
S_IRV_d3#	GIRR_V_00.50_03.00	EUR				1 000,00
S_IRV_b2#	GIRR_V_00.50_01.00	USD				400,00
S_IRV_c2#	GIRR_V_00.50_01.00	CLP				150,00
S_IRV_d2#	GIRR_V_00.50_01.00	EUR				3 750,00
S_IRV_a1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				– 100,00
S_IRV_b1#	GIRR_V_00.50_00.50	USD				700,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_IRV_c1#	GIRR_V_00.50_00.50	CLP				300,00
S_IRV_d1#	GIRR_V_00.50_00.50	EUR				– 4 750,00
S_IRV_e1#	GIRR_V_00.50_00.50	BRL				– 500,00
S_IRD_b11#	GIRR_D_INF	USD				– 50 000,00
S_IRD_d11#	GIRR_D_INF	CLP				95 000,00
S_IRD_e11#	GIRR_D_INF	EUR	DE			– 65 000,00
S_IRD_e13#	GIRR_D_INF	EUR	FR			– 100 000,00
S_IRD_d12#	GIRR_D_CRO_USD	CLP				10 500,00
S_IRD_e12#	GIRR_D_CRO_USD	EUR				– 85 000,00
S_IRD_b12#	GIRR_D_CRO_EUR	USD				– 65 000,00
S_IRD_b10#	GIRR_D_30.00	USD	OIS			– 50 000,00
S_IRD_c10#	GIRR_D_30.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d10#	GIRR_D_30.00	CLP	OIS			15 000,00
S_IRD_e10#	GIRR_D_30.00	EUR	OIS			– 120 000,00
S_IRD_b9#	GIRR_D_20.00	USD	OIS			200 000,00
S_IRD_c9#	GIRR_D_20.00	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d9#	GIRR_D_20.00	CLP	OIS			90 000,00
S_IRD_e9#	GIRR_D_20.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b8#	GIRR_D_15.00	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_c8#	GIRR_D_15.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d8#	GIRR_D_15.00	CLP	OIS			70 000,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_IRD_e8#	GIRR_D_15.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b7#	GIRR_D_10.00	USD	OIS			2 000,00
S_IRD_c7#	GIRR_D_10.00	USD	Libor3m			– 100 000,00
S_IRD_d7#	GIRR_D_10.00	CLP	OIS			– 25 000,00
S_IRD_e7#	GIRR_D_10.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b6#	GIRR_D_05.00	USD	OIS			– 90 000,00
S_IRD_c6#	GIRR_D_05.00	USD	Libor3m			– 35 000,00
S_IRD_d6#	GIRR_D_05.00	CLP	OIS			– 5 000,00
S_IRD_e6#	GIRR_D_05.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b5#	GIRR_D_03.00	USD	OIS			85 000,00
S_IRD_c5#	GIRR_D_03.00	USD	Libor3m			55 000,00
S_IRD_d5#	GIRR_D_03.00	CLP	OIS			– 100 000,00
S_IRD_e5#	GIRR_D_03.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b4#	GIRR_D_02.00	USD	OIS			– 10 000,00
S_IRD_c4#	GIRR_D_02.00	USD	Libor3m			10 000,00
S_IRD_d4#	GIRR_D_02.00	CLP	OIS			5 000,00
S_IRD_e4#	GIRR_D_02.00	EUR	OIS			100,00
S_IRD_b3#	GIRR_D_01.00	USD	OIS			– 65 000,00
S_IRD_c3#	GIRR_D_01.00	USD	Libor3m			70 000,00
S_IRD_d3#	GIRR_D_01.00	CLP	OIS			10 000,00
S_IRD_e3#	GIRR_D_01.00	EUR	OIS			– 50 000,00
S_IRD_b2#	GIRR_D_00.50	USD	OIS			15 000,00
S_IRD_c2#	GIRR_D_00.50	USD	Libor3m			– 40 000,00
S_IRD_d2#	GIRR_D_00.50	CLP	OIS			45 000,00
S_IRD_e2#	GIRR_D_00.50	EUR	OIS			100,00
S_IRD_a1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			30 000,00
S_IRD_b1#	GIRR_D_00.25	USD	OIS			20 000,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_IRD_c1#	GIRR_D_00.25	USD	Libor3m			– 30 000,00
S_IRD_d1#	GIRR_D_00.25	CLP	OIS			– 30 000,00
S_IRD_e1#	GIRR_D_00.25	EUR	OIS			100,00
S_IRD_f1#	GIRR_D_00.25	DKK	OIS			100,00
S_IRC_a1#	GIRR_CU	USD				– 18 466,83
S_IRC_b1#	GIRR_CU	USD				92 233,09
S_IRC_c1#	GIRR_CU	CLP				– 1 270,00
S_IRC_d1#	GIRR_CU	EUR				– 253,12
S_IRC_e1#	GIRR_CU	VND				– 11 950,00
S_IRC_a1#	GIRR_CD	USD				18 647,66
S_IRC_b1#	GIRR_CD	USD				– 93 178,71
S_IRC_c1#	GIRR_CD	CLP				450,00
S_IRC_d1#	GIRR_CD	EUR				– 3 237,08
S_IRC_e1#	GIRR_CD	VND				– 4 030,00
S_FXV_b4#	FX_V_5.00	EUR_CLP				200,00
S_FXV_d4#	FX_V_5.00	CHF_VND				1 500,00
S_FXV_b3#	FX_V_3.00	EUR_CLP				– 400,00
S_FXV_d3#	FX_V_3.00	CHF_VND				1 000,00
S_FXV_b5#	FX_V_10.00	EUR_CLP				150,00
S_FXV_d5#	FX_V_10.00	CHF_VND				– 2 000,00
S_FXV_b2#	FX_V_1.00	EUR_CLP				300,00
S_FXV_d2#	FX_V_1.00	CHF_VND				3 750,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_FXV_a1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				– 100,00
S_FXV_b1#	FX_V_0.50	EUR_CLP				700,00
S_FXV_c1#	FX_V_0.50	AUD_JPY				450,00
S_FXV_d1#	FX_V_0.50	CHF_VND				– 4 800,00
S_FXD_a1#	FX_D	GBP				5 000,00
S_FXD_b1#	FX_D	GBP				– 8 000,00
S_FXD_c1#	FX_D	CLP				3 000,00
S_FXD_d1#	FX_D	DKK				1 000,00
S_FXD_f1#	FX_D	BGN				1 000,00
S_FXC_a1#	FX_CU	EUR				– 16 037,91
S_FXC_b1#	FX_CU	EUR				80 159,24
S_FXC_c1#	FX_CU	CLP				– 800,00
S_FXC_d1#	FX_CU	JPY				– 1 472,88
S_FXC_e1#	FX_CU	VND				– 3 400,00
S_FXC_f1#	FX_CU	DKK				– 48,61
S_FXC_a1#	FX_CD	EUR				16 162,18
S_FXC_b1#	FX_CD	EUR				– 80 723,02
S_FXC_c1#	FX_CD	CLP				700,00
S_FXC_d1#	FX_CD	JPY				– 1 324,35
S_FXC_e1#	FX_CD	VND				– 2 100,00
S_FXC_f1#	FX_CD	DKK				48,61
S_EQV_a5#	EQ_V_5.00	1	EMITENTE A			100,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQV_aa4#	EQ_V_5.00	5	EMITENTE AA			1 200,00
S_EQV_ac1#	EQ_V_5.00	7	EMITENTE AC			– 50,00
S_EQV_ae4#	EQ_V_5.00	9	EMITENTE AE			600,00
S_EQV_af4#	EQ_V_5.00	10	EMITENTE AF			375,00
S_EQV_b4#	EQ_V_5.00	1	EMITENTE B			50,00
S_EQV_f4#	EQ_V_5.00	5	EMITENTE F			450,00
S_EQV_j4#	EQ_V_5.00	9	EMITENTE J			– 200,00
S_EQV_k4#	EQ_V_5.00	10	EMITENTE K			– 825,00
S_EQV_m1#	EQ_V_5.00	11	EMITENTE M			– 700,00
S_EQV_n4#	EQ_V_5.00	12	ÍNDICE N			850,00
S_EQV_o4#	EQ_V_5.00	12	ÍNDICE O			150,00
S_EQV_y1#	EQ_V_5.00	3	EMITENTE Y			700,00
S_EQV_a4#	EQ_V_3.00	1	EMITENTE A			– 500,00
S_EQV_aa3#	EQ_V_3.00	5	EMITENTE AA			– 850,00
S_EQV_ad1#	EQ_V_3.00	8	EMITENTE AD			300,00
S_EQV_ae3#	EQ_V_3.00	9	EMITENTE AE			– 450,00
S_EQV_af3#	EQ_V_3.00	10	EMITENTE AF			– 725,00
S_EQV_b3#	EQ_V_3.00	1	EMITENTE B			– 500,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQV_f3#	EQ_V_3.00	5	EMITENTE F			250,00
S_EQV_j3#	EQ_V_3.00	9	EMITENTE J			– 900,00
S_EQV_k3#	EQ_V_3.00	10	EMITENTE K			– 975,00
S_EQV_n3#	EQ_V_3.00	12	ÍNDICE N			– 1 250,00
S_EQV_o3#	EQ_V_3.00	12	ÍNDICE O			100,00
S_EQV_x1#	EQ_V_3.00	2	EMITENTE X			– 200,00
S_EQV_z1#	EQ_V_3.00	4	EMITENTE Z			– 800,00
S_EQV_a6#	EQ_V_10.00	1	EMITENTE A			100,00
S_EQV_aa5#	EQ_V_10.00	5	EMITENTE AA			– 300,00
S_EQV_ab1#	EQ_V_10.00	6	EMITENTE AB			– 400,00
S_EQV_ae5#	EQ_V_10.00	9	EMITENTE AE			– 850,00
S_EQV_af5#	EQ_V_10.00	10	EMITENTE AF			525,00
S_EQV_b5#	EQ_V_10.00	1	EMITENTE B			500,00
S_EQV_f5#	EQ_V_10.00	5	EMITENTE F			600,00
S_EQV_j5#	EQ_V_10.00	9	EMITENTE J			150,00
S_EQV_k5#	EQ_V_10.00	10	EMITENTE K			300,00
S_EQV_n5#	EQ_V_10.00	12	ÍNDICE N			225,00
S_EQV_o5#	EQ_V_10.00	12	ÍNDICE O			– 200,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQV_q1#	EQ_V_10.00	13	ÍNDICE Q			– 800,00
S_EQV_a3#	EQ_V_1.00	1	EMITENTE A			400,00
S_EQV_aa2#	EQ_V_1.00	5	EMITENTE AA			– 400,00
S_EQV_ae2#	EQ_V_1.00	9	EMITENTE AE			– 250,00
S_EQV_af2#	EQ_V_1.00	10	EMITENTE AF			– 1 150,00
S_EQV_b2#	EQ_V_1.00	1	EMITENTE B			200,00
S_EQV_f2#	EQ_V_1.00	5	EMITENTE F			– 750,00
S_EQV_j2#	EQ_V_1.00	9	EMITENTE J			350,00
S_EQV_k2#	EQ_V_1.00	10	EMITENTE K			1 050,00
S_EQV_n2#	EQ_V_1.00	12	ÍNDICE N			– 800,00
S_EQV_o2#	EQ_V_1.00	12	ÍNDICE O			400,00
S_EQV_a1#	EQ_V_0.50	1	EMITENTE A			– 100,00
S_EQV_a2#	EQ_V_0.50	1	EMITENTE A			700,00
S_EQV_aa1#	EQ_V_0.50	5	EMITENTE AA			950,00
S_EQV_ae1#	EQ_V_0.50	9	EMITENTE AE			50,00
S_EQV_af1#	EQ_V_0.50	10	EMITENTE AF			– 300,00
S_EQV_b1#	EQ_V_0.50	1	EMITENTE B			900,00
S_EQV_c1#	EQ_V_0.50	2	EMITENTE C			– 500,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQV_d1#	EQ_V_0.50	3	EMITENTE D			600,00
S_EQV_e1#	EQ_V_0.50	4	EMITENTE E			– 800,00
S_EQV_f1#	EQ_V_0.50	5	EMITENTE F			1 000,00
S_EQV_g1#	EQ_V_0.50	6	EMITENTE G			– 400,00
S_EQV_h1#	EQ_V_0.50	7	EMITENTE H			– 50,00
S_EQV_i1#	EQ_V_0.50	8	EMITENTE I			300,00
S_EQV_j1#	EQ_V_0.50	9	EMITENTE J			50,00
S_EQV_k1#	EQ_V_0.50	10	EMITENTE K			– 300,00
S_EQV_l1#	EQ_V_0.50	11	EMITENTE L			1 000,00
S_EQV_n1#	EQ_V_0.50	12	ÍNDICE N			750,00
S_EQV_o1#	EQ_V_0.50	12	ÍNDICE O			– 500,00
S_EQV_p1#	EQ_V_0.50	13	ÍNDICE P			40,00
S_EQD_a1#	EQ_D_SPOT	1	EMITENTE A			16 500,00
S_EQD_a2#	EQ_D_SPOT	1	EMITENTE A			– 35 000,00
S_EQD_b1#	EQ_D_SPOT	1	EMITENTE B			20 000,00
S_EQD_c1#	EQ_D_SPOT	2	EMITENTE C			66 000,00
S_EQD_d1#	EQ_D_SPOT	3	EMITENTE D			1 700,00
S_EQD_e1#	EQ_D_SPOT	4	EMITENTE E			1 100,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQD_f1#	EQ_D_SPOT	5	EMITENTE F			25 000,00
S_EQD_g1#	EQ_D_SPOT	5	EMITENTE G			8 400,00
S_EQD_h1#	EQ_D_SPOT	6	EMITENTE H			22 500,00
S_EQD_i1#	EQ_D_SPOT	7	EMITENTE I			– 12 300,00
S_EQD_j1#	EQ_D_SPOT	8	EMITENTE J			– 450,00
S_EQD_k1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENTE K			– 143,00
S_EQD_l1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENTE L			– 143,00
S_EQD_m1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENTE M			– 100,00
S_EQD_n1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENTE N			– 100,00
S_EQD_o1#	EQ_D_SPOT	11	EMITENTE O			– 19 600,00
S_EQD_q1#	EQ_D_SPOT	12	ÍNDICE Q			1 100,00
S_EQD_r1#	EQ_D_SPOT	12	ÍNDICE R			– 40 000,00
S_EQD_s1#	EQ_D_SPOT	13	ÍNDICE S			– 1 950,00
S_EQD_s2#	EQ_D_SPOT	13	ÍNDICE S			280,00
S_EQD_t2#	EQ_D_SPOT	13	ÍNDICE T			3 150,00
S_EQD_u1#	EQ_D_SPOT	9	EMITENTE U			– 57,00
S_EQD_v1#	EQ_D_SPOT	10	EMITENTE V			– 100,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQD_a3#	EQ_D_REPO	1	EMITENTE A			50 000,00
S_EQD_aa1#	EQ_D_REPO	6	EMITENTE AA			79 000,00
S_EQD_ab1#	EQ_D_REPO	7	EMITENTE AB			31 000,00
S_EQD_ac1#	EQ_D_REPO	8	EMITENTE AC			– 10 000,00
S_EQD_b2#	EQ_D_REPO	1	EMITENTE B			– 39 000,00
S_EQD_f2#	EQ_D_REPO	5	EMITENTE F			90 000,00
S_EQD_g2#	EQ_D_REPO	5	EMITENTE G			60 000,00
S_EQD_k2#	EQ_D_REPO	9	EMITENTE K			– 14 250,00
S_EQD_l2#	EQ_D_REPO	9	EMITENTE L			– 150 000,00
S_EQD_m2#	EQ_D_REPO	10	EMITENTE M			– 85 000,00
S_EQD_n2#	EQ_D_REPO	10	EMITENTE N			– 72 000,00
S_EQD_p1#	EQ_D_REPO	11	EMITENTE P			48 000,00
S_EQD_q2#	EQ_D_REPO	12	ÍNDICE Q			85 000,00
S_EQD_r2#	EQ_D_REPO	12	ÍNDICE R			– 40 000,00
S_EQD_t1#	EQ_D_REPO	13	ÍNDICE T			– 125 000,00
S_EQD_x1#	EQ_D_REPO	2	EMITENTE X			75 000,00
S_EQD_y1#	EQ_D_REPO	3	EMITENTE Y			4 800,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQD_z1#	EQ_D_REPO	4	EMITENTE Z			– 15 000,00
S_EQC_a1#	EQ_CU	1	EMITENTE A			– 37 820,00
S_EQC_a2#	EQ_CU	1	EMITENTE A			77 655,00
S_EQC_aa1#	EQ_CU	2	EMITENTE AA			39 300,00
S_EQC_ab1#	EQ_CU	4	EMITENTE AB			17 262,00
S_EQC_ac1#	EQ_CU	5	EMITENTE AC			7 139,60
S_EQC_ad1#	EQ_CU	6	EMITENTE AD			– 3 642,50
S_EQC_ae1#	EQ_CU	7	EMITENTE AE			3 900,00
S_EQC_af1#	EQ_CU	8	EMITENTE AF			41 550,00
S_EQC_ag1#	EQ_CU	9	EMITENTE AG			36 860,00
S_EQC_ah1#	EQ_CU	10	EMITENTE AH			22 150,00
S_EQC_b1#	EQ_CU	1	EMITENTE B			20 677,50
S_EQC_c1#	EQ_CU	2	EMITENTE C			– 31 440,00
S_EQC_d1#	EQ_CU	3	EMITENTE D			6 238,00
S_EQC_e1#	EQ_CU	4	EMITENTE E			– 21 605,00
S_EQC_f1#	EQ_CU	5	EMITENTE F			– 2 850,00
S_EQC_g1#	EQ_CU	6	EMITENTE G			– 3 642,50

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQC_h1#	EQ_CU	7	EMITENTE H			– 7 800,00
S_EQC_i1#	EQ_CU	8	EMITENTE I			– 29 550,00
S_EQC_j1#	EQ_CU	9	EMITENTE J			– 216 320,00
S_EQC_k1#	EQ_CU	10	EMITENTE K			1 950,00
S_EQC_q1#	EQ_CU	11	EMITENTE Q			– 19 142,00
S_EQC_r1#	EQ_CU	11	EMITENTE R			28 713,00
S_EQC_s1#	EQ_CU	3	EMITENTE S			– 17 025,00
S_EQC_t1#	EQ_CU	12	EMITENTE T			7 466,67
S_EQC_u1#	EQ_CU	13	EMITENTE U			11 160,00
S_EQC_v1#	EQ_CU	12	EMITENTE V			– 39 200,00
S_EQC_w1#	EQ_CU	13	EMITENTE W			– 58 590,00
S_EQC_y1#	EQ_CU	1	EMITENTE Y			– 23 930,00
S_EQC_z1#	EQ_CU	1	EMITENTE Z			– 47 860,00
S_EQC_a1#	EQ_CD	1	EMITENTE A			39 157,50
S_EQC_a2#	EQ_CD	1	EMITENTE A			– 80 349,00
S_EQC_aa1#	EQ_CD	2	EMITENTE AA			– 30 600,00
S_EQC_ab1#	EQ_CD	4	EMITENTE AB			– 9 826,00
S_EQC_ac1#	EQ_CD	5	EMITENTE AC			– 5 414,60

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQC_ad1#	EQ_CD	6	EMITENTE AD			2 617,50
S_EQC_ae1#	EQ_CD	7	EMITENTE AE			– 2 720,00
S_EQC_af1#	EQ_CD	8	EMITENTE AF			– 28 250,00
S_EQC_ag1#	EQ_CD	9	EMITENTE AG			– 30 935,00
S_EQC_ah1#	EQ_CD	10	EMITENTE AH			– 15 025,00
S_EQC_b1#	EQ_CD	1	EMITENTE B			– 238 910,00
S_EQC_c1#	EQ_CD	2	EMITENTE C			24 480,00
S_EQC_d1#	EQ_CD	3	EMITENTE D			– 6 068,00
S_EQC_e1#	EQ_CD	4	EMITENTE E			12 310,00
S_EQC_f1#	EQ_CD	5	EMITENTE F			2 160,00
S_EQC_g1#	EQ_CD	6	EMITENTE G			2 617,50
S_EQC_h1#	EQ_CD	7	EMITENTE H			5 440,00
S_EQC_i1#	EQ_CD	8	EMITENTE I			20 050,00
S_EQC_j1#	EQ_CD	9	EMITENTE J			181 560,00
S_EQC_k1#	EQ_CD	10	EMITENTE K			– 2 900,00
S_EQC_q1#	EQ_CD	11	EMITENTE Q			20 052,00
S_EQC_r1#	EQ_CD	11	EMITENTE R			– 30 078,00
S_EQC_s1#	EQ_CD	3	EMITENTE S			– 9 435,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_EQC_t1#	EQ_CD	12	EMITENTE T			– 7 400,00
S_EQC_u1#	EQ_CD	13	EMITENTE U			– 11 040,00
S_EQC_v1#	EQ_CD	12	EMITENTE V			38 850,00
S_EQC_w1#	EQ_CD	13	EMITENTE W			57 960,00
S_EQC_y1#	EQ_CD	1	EMITENTE Y			13 590,00
S_EQC_z1#	EQ_CD	1	EMITENTE Z			27 180,00
S_CNV_a5#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITENTE A			100,00
S_CNV_b4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	1	EMITENTE B			50,00
S_CNV_c4#	CSR_NON_SEC_V_5.00	3	EMITENTE C			150,00
S_CNV_hb1#	CSR_NON_SEC_V_5.00	9	EMITENTE HA			– 750,00
S_CNV_a4#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITENTE A			– 500,00
S_CNV_ab1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	2	EMITENTE AB			325,00
S_CNV_b3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	1	EMITENTE B			– 500,00
S_CNV_c3#	CSR_NON_SEC_V_3.00	3	EMITENTE C			100,00
S_CNV_v1#	CSR_NON_SEC_V_3.00	20	ÍNDICE V			500,00
S_CNV_a6#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITENTE A			100,00
S_CNV_b5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	1	EMITENTE B			500,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CNV_c5#	CSR_NON_SEC_V_10.00	3	EMITENTE C			– 200,00
S_CNV_a3#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITENTE A			400,00
S_CNV_b2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	1	EMITENTE B			200,00
S_CNV_c2#	CSR_NON_SEC_V_1.00	3	EMITENTE C			400,00
S_CNV_a1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENTE A			– 100,00
S_CNV_a2#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENTE A			700,00
S_CNV_b1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	1	EMITENTE B			900,00
S_CNV_c1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	3	EMITENTE C			– 500,00
S_CNV_d1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	4	EMITENTE D			700,00
S_CNV_e1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	5	EMITENTE E			– 800,00
S_CNV_f1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	6	EMITENTE F			700,00
S_CNV_g1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	7	EMITENTE G			– 400,00
S_CNV_h1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	8	EMITENTE H			– 50,00
S_CNV_i1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	10	EMITENTE I			300,00
S_CNV_j1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	11	EMITENTE J			50,00
S_CNV_k1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	12	EMITENTE K			– 300,00
S_CNV_l1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	13	EMITENTE L			1 000,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CNV_m1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	14	EMITENTE M			– 350,00
S_CNV_n1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	15	EMITENTE N			950,00
S_CNV_o1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	16	EMITENTE O			– 900,00
S_CNV_p1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	17	EMITENTE P			200,00
S_CNV_q1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITENTE Q			400,00
S_CNV_r1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	18	EMITENTE R			– 300,00
S_CNV_s1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	ÍNDICE S			850,00
S_CNV_t1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	20	ÍNDICE T			– 650,00
S_CNV_u1#	CSR_NON_SEC_V_0.50	19	ÍNDICE U			– 350,00
S_CND_hb2#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	9	EMITENTE HB			– 17 000,00
S_CND_t1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	3	EMITENTE T			– 6 000,00
S_CND_y1#	CSR_NON_-SEC_D_3.00_DEBT	20	ÍNDICE Y			9 000,00
S_CND_ab2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	2	EMITENTE AC			14 000,00
S_CND_b2#	CSR_NON_SEC_D_3.00_CDS	1	EMITENTE B			– 17 000,00
S_CND_w1#	CSR_NON_-SEC_D_10.00_DEBT	10	EMITENTE W		CQS 1	9 000,00
S_CND_a4#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	1	EMITENTE A			– 10 000,00
S_CND_s1#	CSR_NON_-SEC_D_1.00_DEBT	3	EMITENTE S			– 6 000,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CND_x1#	CSR_NON_SEC_D_1.00_CDS	19	ÍNDICE X			– 18 500,00
S_CND_a1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENTE A			20 000,00
S_CND_a2#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENTE A			– 30 000,00
S_CND_b1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	1	EMITENTE B			12 000,00
S_CND_c1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	3	EMITENTE C			– 6 000,00
S_CND_d1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	4	EMITENTE D			25 000,00
S_CND_e1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	5	EMITENTE E			– 4 000,00
S_CND_f1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	6	EMITENTE F			– 8 000,00
S_CND_g1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	7	EMITENTE G			8 000,00
S_CND_h1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	8	EMITENTE H			3 000,00
S_CND_hb1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	9	EMITENTE HA			– 23 000,00
S_CND_i1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	10	EMITENTE I		CQS 2	– 5 000,00
S_CND_j1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	11	EMITENTE J			2 000,00
S_CND_k1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	12	EMITENTE K			7 000,00
S_CND_l1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	13	EMITENTE L			– 9 000,00
S_CND_m1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	14	EMITENTE M			10 000,00
S_CND_n1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	15	EMITENTE N			– 20 000,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CND_o1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	16	EMITENTE O			5 000,00
S_CND_p1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	17	EMITENTE P			– 3 000,00
S_CND_q1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITENTE Q			10 000,00
S_CND_r1#	CSR_NON_-SEC_D_0.50_DEBT	18	EMITENTE R			– 5 000,00
S_CND_a3#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	1	EMITENTE A			15 000,00
S_CND_ab1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	2	EMITENTE AB			21 000,00
S_CND_u1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	ÍNDICE U			– 32 000,00
S_CND_v1#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	20	ÍNDICE V			– 13 000,00
S_CND_x2#	CSR_NON_SEC_D_0.50_CDS	19	ÍNDICE X			52 500,00
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTE A			– 2 338,64
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTE A			35 116,67
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITENTE AA		CQS 1	– 1 212,50
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CU	2	EMITENTE AB1			– 247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTE B			890,91
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITENTE C			– 500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITENTE D			415,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CU	5	EMITENTE E			– 1 050,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CU	6	EMITENTE F			– 150,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CU	7	EMITENTE G			– 318,75
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CU	8	EMITENTE H			– 425,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CU	9	EMITENTE HB1			– 500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CU	10	EMITENTE I		CQS 2	– 937,50
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CU	11	EMITENTE J			– 4 650,00
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CU	12	EMITENTE K			– 425,00
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CU	13	EMITENTE L			– 27 660,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CU	14	EMITENTE M			– 488,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CU	15	EMITENTE N			13 237,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CU	16	EMITENTE O			– 1 127,50
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CU	17	EMITENTE P			– 5 775,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITENTE Q			– 7 842,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CU	18	EMITENTE R			15 684,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CU	4	EMITENTE S			– 750,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITENTE T			3 550,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITENTE U			1 660,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CU	19	EMITENTE V			– 18 637,50

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CU	20	EMITENTE W			– 8 715,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CU	3	EMITENTE X			– 500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTE Y			– 249,95
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CU	1	EMITENTE Z			– 249,95
S_CNC_a1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTE A			2 363,38
S_CNC_a2#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTE A			– 35 314,65
S_CNC_aa1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITENTE AA		CQS 1	1 150,00
S_CNC_ab1#	CSR_NON_SEC_CD	2	EMITENTE AB1			247,47
S_CNC_b1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTE B			– 5 543,43
S_CNC_c1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITENTE C			500,00
S_CNC_d1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITENTE D			– 385,00
S_CNC_e1#	CSR_NON_SEC_CD	5	EMITENTE E			575,00
S_CNC_f1#	CSR_NON_SEC_CD	6	EMITENTE F			75,00
S_CNC_g1#	CSR_NON_SEC_CD	7	EMITENTE G			287,50
S_CNC_h1#	CSR_NON_SEC_CD	8	EMITENTE H			400,00
S_CNC_hb1#	CSR_NON_SEC_CD	9	EMITENTE HB1			500,00
S_CNC_i1#	CSR_NON_SEC_CD	10	EMITENTE I		CQS 2	750,00
S_CNC_j1#	CSR_NON_SEC_CD	11	EMITENTE J			4 100,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CNC_k1#	CSR_NON_SEC_CD	12	EMITENTE K			387,50
S_CNC_l1#	CSR_NON_SEC_CD	13	EMITENTE L			22 130,00
S_CNC_m1#	CSR_NON_SEC_CD	14	EMITENTE M			160,00
S_CNC_n1#	CSR_NON_SEC_CD	15	EMITENTE N			– 23 437,50
S_CNC_o1#	CSR_NON_SEC_CD	16	EMITENTE O			1 246,25
S_CNC_p1#	CSR_NON_SEC_CD	17	EMITENTE P			6 225,00
S_CNC_q1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITENTE Q			8 752,00
S_CNC_r1#	CSR_NON_SEC_CD	18	EMITENTE R			– 17 504,00
S_CNC_s1#	CSR_NON_SEC_CD	4	EMITENTE S			– 250,00
S_CNC_t1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITENTE T			– 3 500,00
S_CNC_u1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITENTE U			– 1 540,00
S_CNC_v1#	CSR_NON_SEC_CD	19	EMITENTE V			18 375,00
S_CNC_w1#	CSR_NON_SEC_CD	20	EMITENTE W			8 085,00
S_CNC_x1#	CSR_NON_SEC_CD	3	EMITENTE X			500,00
S_CNC_y1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTE Y			– 226,77
S_CNC_z1#	CSR_NON_SEC_CD	1	EMITENTE Z			– 226,77
S_CMV_a5#	CM_V_5.00	1	CARVÃO			– 300,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMV_b4#	CM_V_5.00	1	URÂNIO			450,00
S_CMV_a4#	CM_V_3.00	1	CARVÃO			800,00
S_CMV_b3#	CM_V_3.00	1	URÂNIO			800,00
S_CMV_a6#	CM_V_10.00	1	CARVÃO			100,00
S_CMV_b5#	CM_V_10.00	1	URÂNIO			– 250,00
S_CMV_a3#	CM_V_1.00	1	CARVÃO			– 200,00
S_CMV_b2#	CM_V_1.00	1	URÂNIO			– 750,00
S_CMV_d1#	CM_V_1.00	2	WTI			– 175,00
S_CMV_f1#	CM_V_1.00	3	FUTUROS ELETRICIDADE NE			– 450,00
S_CMV_h1#	CM_V_1.00	4	PANAMAX			– 5 500,00
S_CMV_j1#	CM_V_1.00	5	COBRE			– 200,00
S_CMV_l1#	CM_V_1.00	6	GÁS NATURAL LIQUEFEITO			1 000,00
S_CMV_n1#	CM_V_1.00	7	PRATA			500,00
S_CMV_p1#	CM_V_1.00	8	MILHO			– 1 000,00
S_CMV_r1#	CM_V_1.00	9	SORO DE LEITE			– 125,00
S_CMV_t1#	CM_V_1.00	10	BORRACHA			– 50,00
S_CMV_v1#	CM_V_1.00	11	POTÁSSIO			– 1 800,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMV_a1#	CM_V_0.50	1	CARVÃO			1 000,00
S_CMV_a2#	CM_V_0.50	1	CARVÃO			– 350,00
S_CMV_b1#	CM_V_0.50	1	URÂNIO			150,00
S_CMV_c1#	CM_V_0.50	2	BRENT			200,00
S_CMV_e1#	CM_V_0.50	3	ELETRICIDADE MERCADO À VISTA SE			– 300,00
S_CMV_g1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_i1#	CM_V_0.50	5	AÇO			550,00
S_CMV_k1#	CM_V_0.50	6	GÁS NATURAL			400,00
S_CMV_m1#	CM_V_0.50	7	OURO			– 200,00
S_CMV_o1#	CM_V_0.50	8	SOJA			– 750,00
S_CMV_q1#	CM_V_0.50	9	PESCADO			250,00
S_CMV_s1#	CM_V_0.50	10	CACAU			350,00
S_CMV_u1#	CM_V_0.50	11	VIDRO PLANO			3 000,00
S_CMV_w1#	CM_V_0.50	4	SUPRAMAX			– 5 000,00
S_CMV_x1#	CM_V_0.50 USD	4	PANAMAX			15 000,00
S_CMD_p1#	CM_D_30.00	8	MILHO	OKLAHOMA		– 10 000,00
S_CMD_f1#	CM_D_3.00	3	FUTUROS ELETRICIDADE NE	TEXAS		– 4 500,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMD_h1#	CM_D_3.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		– 68 750,00
S_CMD_n1#	CM_D_20.00	7	PRATA	EU1		5 000,00
S_CMD_r1#	CM_D_20.00	9	SORO DE LEITE	NEWCASTLE		– 1 250,00
S_CMD_d1#	CM_D_2.00	2	WTI	OKLAHOMA		– 1 750,00
S_CMD_l1#	CM_D_15.00	6	GÁS NATURAL LIQUEFEITO	OKLAHOMA		10 000,00
S_CMD_t1#	CM_D_15.00	10	BORRACHA	NEWCASTLE		– 500,00
S_CMD_j1#	CM_D_10.00	5	COBRE	OKLAHOMA		– 2 000,00
S_CMD_v1#	CM_D_10.00	11	POTÁSSIO	NEWCASTLE		– 18 000,00
S_CMD_b1#	CM_D_1.00	1	URÂNIO	OKLAHOMA		1 500,00
S_CMD_g1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_w1#	CM_D_1.00	4	SUPRAMAX	SANTOS		– 62 500,00
S_CMD_x1#	CM_D_1.00	4	PANAMAX	NEW ORLEANS		187 500,00
S_CMD_a4#	CM_D_0.50	1	CARVÃO	NEWCASTLE		8 000,00
S_CMD_a1#	CM_D_0.00	1	CARVÃO	NEWCASTLE		10 000,00
S_CMD_a2#	CM_D_0.00	1	CARVÃO	NEWCASTLE		– 3 500,00
S_CMD_a3#	CM_D_0.00	1	CARVÃO	LONDRES		– 2 000,00
S_CMD_c1#	CM_D_0.00	2	BRENT	LE HAVRE		2 000,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMD_e1#	CM_D_0.00	3	ELETRICIDADE MERCADO À VISTA SE	LONDRES		– 3 000,00
S_CMD_i1#	CM_D_0.00	5	AÇO	LE HAVRE		5 500,00
S_CMD_k1#	CM_D_0.00	6	GÁS NATURAL	LE HAVRE		4 000,00
S_CMD_m1#	CM_D_0.00	7	OURO	UK1		– 2 000,00
S_CMD_o1#	CM_D_0.00	8	SOJA	LE HAVRE		– 7 500,00
S_CMD_q1#	CM_D_0.00	9	PESCADO	LONDRES		2 500,00
S_CMD_s1#	CM_D_0.00	10	CACAU	LONDRES		3 500,00
S_CMD_u1#	CM_D_0.00	11	VIDRO PLANO	LONDRES		30 000,00
S_CMC_a1#	CM_CU	1	CARVÃO			17 335,00
S_CMC_a2#	CM_CU	1	CARVÃO			36 936,00
S_CMC_b1#	CM_CU	1	URÂNIO			6 635,00
S_CMC_c1#	CM_CU	2	BRENT			– 11 600,00
S_CMC_d1#	CM_CU	2	WTI			– 36 900,00
S_CMC_e1#	CM_CU	3	ELETRICIDADE MERCADO À VISTA SE			8 563,00
S_CMC_f1#	CM_CU	3	FUTUROS ELETRICIDADE NE			– 27 250,00
S_CMC_g1#	CM_CU	4	SUPRAMAX			– 36 880,00
S_CMC_h1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMC_i1#	CM_CU	5	AÇO			– 5 850,00
S_CMC_j1#	CM_CU	5	COBRE			14 644,80
S_CMC_k1#	CM_CU	6	GÁS NATURAL			– 6 147,50
S_CMC_l1#	CM_CU	6	GÁS NATURAL LIQUEFEITO			– 6 147,50
S_CMC_m1#	CM_CU	7	OURO			– 1 486,67
S_CMC_n1#	CM_CU	7	PRATA			743,33
S_CMC_o1#	CM_CU	8	SOJA			– 14 535,00
S_CMC_p1#	CM_CU	8	MILHO			20 475,00
S_CMC_q1#	CM_CU	9	PESCADO			– 19 900,00
S_CMC_r1#	CM_CU	9	SORO DE LEITE			3 387,00
S_CMC_s1#	CM_CU	10	CACAU			1 005,00
S_CMC_t1#	CM_CU	10	BORRACHA			10 892,20
S_CMC_u1#	CM_CU	11	VIDRO PLANO			– 13 790,00
S_CMC_v1#	CM_CU	11	POTÁSSIO			20 685,00
S_CMC_x1#	CM_CU	9	LEITE			– 6 300,00
S_CMC_y1#	CM_CU	1	URÂNIO			– 65 864,00
S_CMC_z1#	CM_CU	4	PANAMAX			29 472,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMC_a1#	CM_CD	1	CARVÃO			– 18 260,00
S_CMC_a2#	CM_CD	1	CARVÃO			– 37 630,00
S_CMC_b1#	CM_CD	1	URÂNIO			– 70 460,00
S_CMC_c1#	CM_CD	2	BRENT			8 320,00
S_CMC_d1#	CM_CD	2	WTI			3 550,00
S_CMC_e1#	CM_CD	3	ELETRICIDADE MERCADO À VISTA SE			– 8 233,00
S_CMC_f1#	CM_CD	3	FUTUROS ELETRICIDADE NE			16 370,00
S_CMC_g1#	CM_CD	4	SUPRAMAX			29 110,00
S_CMC_h1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 15 256,00
S_CMC_i1#	CM_CD	5	AÇO			4 080,00
S_CMC_j1#	CM_CD	5	COBRE			– 10 219,80
S_CMC_k1#	CM_CD	6	GÁS NATURAL			4 222,50
S_CMC_l1#	CM_CD	6	GÁS NATURAL LIQUEFEITO			4 222,50
S_CMC_m1#	CM_CD	7	OURO			1 353,33
S_CMC_n1#	CM_CD	7	PRATA			– 676,67
S_CMC_o1#	CM_CD	8	SOJA			10 435,00
S_CMC_p1#	CM_CD	8	MILHO			– 14 735,00

Instrumento	Identificador do fator de risco	Escalão	Identificador adicional	Identificador adicional2	Categoria de qualidade de crédito	Sensibilidade ao risco
S_CMC_q1#	CM_CD	9	PESCADO			6 700,00
S_CMC_r1#	CM_CD	9	SORO DE LEITE			– 3 012,00
S_CMC_s1#	CM_CD	10	CACAU			– 1 415,00
S_CMC_t1#	CM_CD	10	BORRACHA			– 7 817,20
S_CMC_u1#	CM_CD	11	VIDRO PLANO			14 200,00
S_CMC_v1#	CM_CD	11	POTÁSSIO			– 21 300,00
S_CMC_x1#	CM_CD	9	LEITE			– 4 700,00
S_CMC_y1#	CM_CD	1	URÂNIO			– 66 344,00
S_CMC_z1#	CM_CD	4	PANAMAX			– 22 856,00

ELI: http://data.europa.eu/eli/reg_impl/2025/379/oj

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
G000	GIRR	DELTA	S_IRD_a1#
G001	GIRR	DELTA	S_IRD_b1#
G002	GIRR	DELTA	S_IRD_b2#
G003	GIRR	DELTA	S_IRD_b3#
G004	GIRR	DELTA	S_IRD_b4#
G005	GIRR	DELTA	S_IRD_b5#
G006	GIRR	DELTA	S_IRD_b6#
G007	GIRR	DELTA	S_IRD_b7#
G008	GIRR	DELTA	S_IRD_b8#
G009	GIRR	DELTA	S_IRD_b9#
G010	GIRR	DELTA	S_IRD_b10#
G011	GIRR	DELTA	S_IRD_b11#
G012	GIRR	DELTA	S_IRD_b12#
G013	GIRR	DELTA	S_IRD_d1#
G014	GIRR	DELTA	S_IRD_d2#
G015	GIRR	DELTA	S_IRD_d3#
G016	GIRR	DELTA	S_IRD_d4#
G017	GIRR	DELTA	S_IRD_d5#
G018	GIRR	DELTA	S_IRD_d6#
G019	GIRR	DELTA	S_IRD_d7#
G020	GIRR	DELTA	S_IRD_d8#
G021	GIRR	DELTA	S_IRD_d9#
G022	GIRR	DELTA	S_IRD_d10#
G023	GIRR	DELTA	S_IRD_d11#
G024	GIRR	DELTA	S_IRD_d12#
G025	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1#
G026	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10#
G027	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_c1#
G028	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
G029	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11#
G030	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12#
G031	GIRR	DELTA	S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c6#
G032	GIRR	DELTA	S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12#
G033	GIRR	DELTA	S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13#
G034	GIRR	DELTA	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1#
G035	GIRR	VEGA	S_IRV_b1#
G036	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1#
G037	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5#
G038	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b6# S_IRV_b11# S_IRV_b16# S_IRV_b21#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
G039	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25#
G040	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e2#
G041	GIRR	VEGA	S_IRV_e1# S_IRV_e3#
G042	GIRR	VEGA	S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G043	GIRR	VEGA	S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5#
G044	GIRR	VEGA	S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5#
G045	GIRR	VEGA	S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3#
G046	GIRR	CURVATURA	S_IRC_b1#
G047	GIRR	CURVATURA	S_IRC_c1#
G048	GIRR	CURVATURA	S_IRC_a1# S_IRC_b1#
G049	GIRR	CURVATURA	S_IRC_d1#
G050	GIRR	CURVATURA	S_IRC_b1# S_IRC_c1#
G051	GIRR	CURVATURA	S_IRC_c1# S_IRC_e1#
G052	GIRR	CURVATURA	S_IRC_d1# S_IRC_e1#
G053	GIRR	CURVATURA	S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
G054	GIRR	TODOS	S_IRD_a1# S_IRD_b1# S_IRD_b2# S_IRD_b3# S_IRD_b4# S_IRD_b5# S_IRD_b6# S_IRD_b7# S_IRD_b8# S_IRD_b9# S_IRD_b10# S_IRD_b11# S_IRD_b12# S_IRD_c1# S_IRD_c2# S_IRD_c3# S_IRD_c4# S_IRD_c5# S_IRD_c6# S_IRD_c7# S_IRD_c8# S_IRD_c9# S_IRD_c10# S_IRD_d1# S_IRD_d2# S_IRD_d3# S_IRD_d4# S_IRD_d5# S_IRD_d6# S_IRD_d7# S_IRD_d8# S_IRD_d9# S_IRD_d10# S_IRD_d11# S_IRD_d12# S_IRD_e1# S_IRD_e2# S_IRD_e3# S_IRD_e4# S_IRD_e5# S_IRD_e6# S_IRD_e7# S_IRD_e8# S_IRD_e9# S_IRD_e10# S_IRD_e11# S_IRD_e12# S_IRD_e13# S_IRD_f1# S_IRV_a1# S_IRV_b1# S_IRV_b2# S_IRV_b3# S_IRV_b4# S_IRV_b5# S_IRV_b6# S_IRV_b7# S_IRV_b8# S_IRV_b9# S_IRV_b10# S_IRV_b11# S_IRV_b12# S_IRV_b13# S_IRV_b14# S_IRV_b15# S_IRV_b16# S_IRV_b17# S_IRV_b18# S_IRV_b19# S_IRV_b20# S_IRV_b21# S_IRV_b22# S_IRV_b23# S_IRV_b24# S_IRV_b25# S_IRV_c1# S_IRV_c2# S_IRV_c3# S_IRV_c4# S_IRV_c5# S_IRV_d1# S_IRV_d2# S_IRV_d3# S_IRV_d4# S_IRV_d5# S_IRV_e1# S_IRV_e2# S_IRV_e3# S_IRC_a1# S_IRC_a1# S_IRC_b1# S_IRC_b1# S_IRC_c1# S_IRC_c1# S_IRC_d1# S_IRC_d1# S_IRC_e1# S_IRC_e1#
G055	GIRR	DELTA	S_IRD_e11# S_IRD_e13#
G056	GIRR	DELTA	S_IRD_e1# S_IRD_f1#
E001	EQ	DELTA	S_EQD_a2#
E002	EQ	DELTA	S_EQD_c1#
E003	EQ	DELTA	S_EQD_d1#
E004	EQ	DELTA	S_EQD_e1#
E005	EQ	DELTA	S_EQD_f1#
E006	EQ	DELTA	S_EQD_h1#
E007	EQ	DELTA	S_EQD_i1#
E008	EQ	DELTA	S_EQD_j1#
E009	EQ	DELTA	S_EQD_k1#
E010	EQ	DELTA	S_EQD_m1#
E011	EQ	DELTA	S_EQD_o1#
E012	EQ	DELTA	S_EQD_q1#
E013	EQ	DELTA	S_EQD_s1#
E014	EQ	DELTA	S_EQD_a3#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
E015	EQ	DELTA	S_EQD_x1#
E016	EQ	DELTA	S_EQD_y1#
E017	EQ	DELTA	S_EQD_z1#
E018	EQ	DELTA	S_EQD_f2#
E019	EQ	DELTA	S_EQD_aa1#
E020	EQ	DELTA	S_EQD_ab1#
E021	EQ	DELTA	S_EQD_ac1#
E022	EQ	DELTA	S_EQD_k2#
E023	EQ	DELTA	S_EQD_m2#
E024	EQ	DELTA	S_EQD_p1#
E025	EQ	DELTA	S_EQD_q2#
E026	EQ	DELTA	S_EQD_t1#
E027	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2#
E028	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_a3#
E029	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b1#
E030	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_b2#
E031	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_f2#
E032	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g1#
E033	EQ	DELTA	S_EQD_f1# S_EQD_g2#
E034	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_k2#
E035	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1#
E036	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l2#
E037	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_m2#
E038	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n1#
E039	EQ	DELTA	S_EQD_m1# S_EQD_n2#
E040	EQ	DELTA	S_EQD_o1# S_EQD_p1#
E041	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_q2#
E042	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_r1#
E043	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1#
E044	EQ	DELTA	S_EQD_s1# S_EQD_t1# S_EQD_t2#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
E045	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_c1# S_EQD_d1# S_EQD_e1# S_EQD_f1# S_EQD_h1# S_EQD_i1# S_EQD_j1# S_EQD_k1# S_EQD_m1#
E046	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_o1#
E047	EQ	DELTA	S_EQD_q1# S_EQD_s1#
E048	EQ	DELTA	S_EQD_a2# S_EQD_q1#
E049	EQ	DELTA	S_EQD_k1# S_EQD_l1# S_EQD_m1# S_EQD_n1# S_EQD_q1# S_EQD_s2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E050	EQ	DELTA	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1#
E051	EQ	VEGA	S_EQV_a2#
E052	EQ	VEGA	S_EQV_c1#
E053	EQ	VEGA	S_EQV_d1#
E054	EQ	VEGA	S_EQV_e1#
E055	EQ	VEGA	S_EQV_f1#
E056	EQ	VEGA	S_EQV_g1#
E057	EQ	VEGA	S_EQV_h1#
E058	EQ	VEGA	S_EQV_i1#
E059	EQ	VEGA	S_EQV_j1#
E060	EQ	VEGA	S_EQV_k1#
E061	EQ	VEGA	S_EQV_l1#
E062	EQ	VEGA	S_EQV_n1#
E063	EQ	VEGA	S_EQV_p1#
E064	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2#
E065	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6#
E066	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_b1#
E067	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
E068	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5#
E069	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_aa1#
E070	EQ	VEGA	S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5#
E071	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#
E072	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_ae1#
E073	EQ	VEGA	S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5#
E074	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5#
E075	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_af1#
E076	EQ	VEGA	S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5#
E077	EQ	VEGA	S_EQV_l1# S_EQV_m1#
E078	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5#
E079	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_o1#
E080	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E081	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5#
E082	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_c1# S_EQV_d1# S_EQV_e1# S_EQV_f1# S_EQV_g1# S_EQV_h1# S_EQV_i1# S_EQV_j1# S_EQV_k1#
E083	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_m1#
E084	EQ	VEGA	S_EQV_n1# S_EQV_p1#
E085	EQ	VEGA	S_EQV_a2# S_EQV_n1#
E086	EQ	VEGA	S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
E087	EQ	VEGA	S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5# S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1#
E088	EQ	CURVATURA	S_EQC_b1#
E089	EQ	CURVATURA	S_EQC_c1#
E090	EQ	CURVATURA	S_EQC_d1#
E091	EQ	CURVATURA	S_EQC_e1#
E092	EQ	CURVATURA	S_EQC_f1#
E093	EQ	CURVATURA	S_EQC_g1#
E094	EQ	CURVATURA	S_EQC_h1#
E095	EQ	CURVATURA	S_EQC_i1#
E096	EQ	CURVATURA	S_EQC_j1#
E097	EQ	CURVATURA	S_EQC_k1#
E098	EQ	CURVATURA	S_EQC_q1#
E099	EQ	CURVATURA	S_EQC_t1#
E100	EQ	CURVATURA	S_EQC_u1#
E101	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_a2#
E102	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_b1#
E103	EQ	CURVATURA	S_EQC_f1# S_EQC_ac1#
E104	EQ	CURVATURA	S_EQC_j1# S_EQC_ag1#
E105	EQ	CURVATURA	S_EQC_k1# S_EQC_ah1#
E106	EQ	CURVATURA	S_EQC_q1# S_EQC_r1#
E107	EQ	CURVATURA	S_EQC_t1# S_EQC_v1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
E108	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_y1# S_EQC_z1#
E109	EQ	CURVATURA	S_EQC_s1#
E110	EQ	CURVATURA	S_EQC_a2# S_EQC_c1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_f1# S_EQC_g1# S_EQC_h1# S_EQC_i1# S_EQC_j1# S_EQC_k1#
E111	EQ	CURVATURA	S_EQC_a2# S_EQC_q1#
E112	EQ	CURVATURA	S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E113	EQ	CURVATURA	S_EQC_a2# S_EQC_t1#
E114	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_d1# S_EQC_s1#
E115	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_b1# S_EQC_t1# S_EQC_u1#
E116	EQ	CURVATURA	S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
E117	EQ	TODOS	S_EQD_a1# S_EQD_a2# S_EQD_a3# S_EQD_b1# S_EQD_b2# S_EQD_c1# S_EQD_x1# S_EQD_d1# S_EQD_y1# S_EQD_e1# S_EQD_z1# S_EQD_f1# S_EQD_f2# S_EQD_g1# S_EQD_g2# S_EQD_h1# S_EQD_aa1# S_EQD_i1# S_EQD_ab1# S_EQD_j1# S_EQD_ac1# S_EQD_k1# S_EQD_k2# S_EQD_l1# S_EQD_l2# S_EQD_m1# S_EQD_m2# S_EQD_n1# S_EQD_n2# S_EQD_o1# S_EQD_p1# S_EQD_q1# S_EQD_q2# S_EQD_r1# S_EQD_r2# S_EQD_s1# S_EQD_s2# S_EQD_t1# S_EQD_t2# S_EQD_u1# S_EQD_v1# S_EQV_a1# S_EQV_a2# S_EQV_a3# S_EQV_a4# S_EQV_a5# S_EQV_a6# S_EQV_b1# S_EQV_b2# S_EQV_b3# S_EQV_b4# S_EQV_b5# S_EQV_c1# S_EQV_x1# S_EQV_d1# S_EQV_y1# S_EQV_e1# S_EQV_z1# S_EQV_f1# S_EQV_f2# S_EQV_f3# S_EQV_f4# S_EQV_f5# S_EQV_aa1# S_EQV_aa2# S_EQV_aa3# S_EQV_aa4# S_EQV_aa5# S_EQV_g1# S_EQV_ab1# S_EQV_h1# S_EQV_ac1# S_EQV_i1# S_EQV_ad1# S_EQV_j1# S_EQV_j2# S_EQV_j3# S_EQV_j4# S_EQV_j5#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
			S_EQV_ae1# S_EQV_ae2# S_EQV_ae3# S_EQV_ae4# S_EQV_ae5# S_EQV_k1# S_EQV_k2# S_EQV_k3# S_EQV_k4# S_EQV_k5# S_EQV_af1# S_EQV_af2# S_EQV_af3# S_EQV_af4# S_EQV_af5# S_EQV_l1# S_EQV_m1# S_EQV_n1# S_EQV_n2# S_EQV_n3# S_EQV_n4# S_EQV_n5# S_EQV_o1# S_EQV_o2# S_EQV_o3# S_EQV_o4# S_EQV_o5# S_EQV_p1# S_EQV_q1# S_EQC_a1# S_EQC_a1# S_EQC_a2# S_EQC_a2# S_EQC_b1# S_EQC_b1# S_EQC_c1# S_EQC_c1# S_EQC_aa1# S_EQC_aa1# S_EQC_d1# S_EQC_d1# S_EQC_e1# S_EQC_e1# S_EQC_ab1# S_EQC_ab1# S_EQC_f1# S_EQC_f1# S_EQC_ac1# S_EQC_ac1# S_EQC_g1# S_EQC_g1# S_EQC_ad1# S_EQC_ad1# S_EQC_h1# S_EQC_h1# S_EQC_ae1# S_EQC_ae1# S_EQC_i1# S_EQC_i1# S_EQC_af1# S_EQC_af1# S_EQC_j1# S_EQC_j1# S_EQC_ag1# S_EQC_ag1# S_EQC_k1# S_EQC_k1# S_EQC_ah1# S_EQC_ah1# S_EQC_q1# S_EQC_q1# S_EQC_r1# S_EQC_r1# S_EQC_s1# S_EQC_s1# S_EQC_t1# S_EQC_t1# S_EQC_u1# S_EQC_u1# S_EQC_v1# S_EQC_v1# S_EQC_w1# S_EQC_w1# S_EQC_y1# S_EQC_y1# S_EQC_z1# S_EQC_z1#
F001	FX	DELTA	S_FXD_b1#
F002	FX	DELTA	S_FXD_c1#
F003	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1#
F005	FX	DELTA	S_FXD_b1# S_FXD_c1#
F007	FX	DELTA	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1#
F008	FX	VEGA	S_FXV_b1#
F009	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1#
F010	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5#
F011	FX	VEGA	S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F012	FX	VEGA	S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1#
F013	FX	VEGA	S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#
F014	FX	VEGA	S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
F015	FX	CURVATURA	S_FXC_b1#
F016	FX	CURVATURA	S_FXC_c1#
F017	FX	CURVATURA	S_FXC_a1# S_FXC_b1#
F018	FX	CURVATURA	S_FXC_d1#
F019	FX	CURVATURA	S_FXC_b1# S_FXC_c1#
F020	FX	CURVATURA	S_FXC_c1# S_FXC_e1#
F021	FX	CURVATURA	S_FXC_b1# S_FXC_d1# S_FXC_e1#
F022	FX	CURVATURA	S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F023	FX	TODOS	S_FXD_a1# S_FXD_b1# S_FXD_c1# S_FXD_d1# S_FXD_e1# S_FXD_f1# S_FXV_a1# S_FXV_b1# S_FXV_b2# S_FXV_b3# S_FXV_b4# S_FXV_b5# S_FXV_c1# S_FXV_d1# S_FXV_d2# S_FXV_d3# S_FXV_d4# S_FXV_d5# S_FXC_a1# S_FXC_a1# S_FXC_b1# S_FXC_b1# S_FXC_c1# S_FXC_c1# S_FXC_d1# S_FXC_d1# S_FXC_e1# S_FXC_e1# S_FXC_f1# S_FXC_f1#
F024	FX	DELTA	S_FXD_d1#
F026	FX	DELTA	S_FXD_f1#
F028	FX	CURVATURA	S_FXC_f1#
N001	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1#
N002	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_c1#
N003	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_d1#
N004	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_e1#
N005	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1#
N006	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_g1#
N007	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_h1#
N008	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_i1#
N009	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_w1#
N010	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1#
N011	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_k1#
N012	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_l1#
N013	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_m1#
N014	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
N015	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_o1#
N016	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_p1#
N017	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1#
N018	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1#
N019	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1#
N020	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2#
N021	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a3#
N022	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a2# S_CND_a4#
N023	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_a4#
N024	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b1#
N025	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1#
N026	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a4# S_CND_b1#
N027	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_b2#
N028	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_q1# S_CND_r1#
N029	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x2#
N030	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_v1# S_CND_y1#
N031	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_u1# S_CND_x1# S_CND_x2#
N032	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1#
N033	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N034	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N035	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N036	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1#
N037	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N038	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_i1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N039	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1#
N040	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
N041	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_u1# S_CND_v1#
N042	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a3# S_CND_b1# S_CND_c1# S_CND_s1# S_CND_t1#
N043	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1#
N044	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2#
N045	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2#
N046	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6#
N047	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a2# S_CNV_b1#
N048	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5#
N049	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_q1# S_CNV_r1#
N050	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_s1# S_CNV_u1#
N051	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_t1# S_CNV_v1#
N052	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N053	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1#
N054	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N055	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N056	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_c1# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N057	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1#
N058	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N059	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_i1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
N060	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1#
N061	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N062	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_s1# S_CNV_t1#
N063	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_b4# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5#
N064	CSR_NON_SEC	VEGA	S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1#
N065	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_b1#
N066	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_c1#
N067	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_d1#
N068	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_e1#
N069	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1#
N070	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_g1#
N071	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_h1#
N072	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_i1#
N073	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_aa1#
N074	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_j1#
N075	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_k1#
N076	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_l1#
N077	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_m1#
N078	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_n1#
N079	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_o1#
N080	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_p1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
N081	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_q1#
N082	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_t1#
N083	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_u1#
N084	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_a2#
N085	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_b1#
N086	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_q1# S_CNC_r1#
N087	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_t1# S_CNC_v1#
N088	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_u1# S_CNC_w1#
N089	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N090	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_s1#
N091	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1#
N092	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N093	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N094	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N095	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1#
N096	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N097	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_i1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N098	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1#
N099	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N100	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_t1# S_CNC_u1#
N101	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_c1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_z1#
N102	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_b1# S_CNC_d1# S_CNC_s1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
N103	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#
N104	CSR_NON_SEC	TODOS	S_CND_a1# S_CND_a2# S_CND_a3# S_CND_a4# S_CND_b1# S_CND_b2# S_CND_ab1# S_CND_ab2# S_CND_c1# S_CND_d1# S_CND_e1# S_CND_f1# S_CND_g1# S_CND_h1# S_CND_hb1# S_CND_hb2# S_CND_i1# S_CND_j1# S_CND_k1# S_CND_l1# S_CND_m1# S_CND_n1# S_CND_o1# S_CND_p1# S_CND_q1# S_CND_r1# S_CND_s1# S_CND_t1# S_CND_u1# S_CND_v1# S_CND_w1# S_CND_x1# S_CND_x2# S_CND_y1# S_CNV_a1# S_CNV_a2# S_CNV_a3# S_CNV_a4# S_CNV_a5# S_CNV_a6# S_CNV_b1# S_CNV_b2# S_CNV_b3# S_CNV_b4# S_CNV_b5# S_CNV_ab1# S_CNV_c1# S_CNV_c2# S_CNV_c3# S_CNV_c4# S_CNV_c5# S_CNV_d1# S_CNV_e1# S_CNV_f1# S_CNV_g1# S_CNV_h1# S_CNV_hb1# S_CNV_i1# S_CNV_j1# S_CNV_k1# S_CNV_l1# S_CNV_m1# S_CNV_n1# S_CNV_o1# S_CNV_p1# S_CNV_q1# S_CNV_r1# S_CNV_s1# S_CNV_t1# S_CNV_u1# S_CNV_v1# S_CNC_a1# S_CNC_a1# S_CNC_a2# S_CNC_a2# S_CNC_b1# S_CNC_b1# S_CNC_ab1# S_CNC_ab1# S_CNC_c1# S_CNC_c1# S_CNC_d1# S_CNC_d1# S_CNC_e1# S_CNC_e1# S_CNC_f1# S_CNC_f1# S_CNC_g1# S_CNC_g1# S_CNC_h1# S_CNC_h1# S_CNC_hb1# S_CNC_hb1# S_CNC_i1# S_CNC_i1# S_CNC_j1# S_CNC_j1# S_CNC_k1# S_CNC_k1# S_CNC_l1# S_CNC_l1# S_CNC_m1# S_CNC_m1# S_CNC_n1# S_CNC_n1# S_CNC_o1# S_CNC_o1# S_CNC_p1# S_CNC_p1# S_CNC_q1# S_CNC_q1# S_CNC_r1# S_CNC_r1# S_CNC_s1# S_CNC_s1# S_CNC_t1# S_CNC_t1# S_CNC_u1# S_CNC_u1# S_CNC_v1# S_CNC_v1# S_CNC_w1# S_CNC_w1# S_CNC_x1# S_CNC_x1# S_CNC_y1# S_CNC_y1# S_CNC_z1# S_CNC_z1# S_CNC_aa1# S_CNC_aa1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
N104(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_ab1#
N105(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	CURVATURA	S_CNC_hb1#
N106(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_ab1#
N107(CRR2/DA)	CSR_NON_SEC	DELTA	S_CND_hb1#
C001	CM	DELTA	S_CMD_a2#
C002	CM	DELTA	S_CMD_c1#
C003	CM	DELTA	S_CMD_e1#
C004	CM	DELTA	S_CMD_g1#
C005	CM	DELTA	S_CMD_i1#
C006	CM	DELTA	S_CMD_k1#
C007	CM	DELTA	S_CMD_m1#
C008	CM	DELTA	S_CMD_o1#
C009	CM	DELTA	S_CMD_q1#
C010	CM	DELTA	S_CMD_s1#
C011	CM	DELTA	S_CMD_u1#
C012	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2#
C013	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a3#
C014	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_a4#
C015	CM	DELTA	S_CMD_a3# S_CMD_a4#
C016	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_b1#
C017	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1#
C018	CM	DELTA	S_CMD_e1# S_CMD_f1#
C019	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1#
C020	CM	DELTA	S_CMD_i1# S_CMD_j1#
C021	CM	DELTA	S_CMD_k1# S_CMD_l1#
C022	CM	DELTA	S_CMD_m1# S_CMD_n1#
C023	CM	DELTA	S_CMD_o1# S_CMD_p1#
C024	CM	DELTA	S_CMD_q1# S_CMD_r1#
C025	CM	DELTA	S_CMD_s1# S_CMD_t1#
C026	CM	DELTA	S_CMD_u1# S_CMD_v1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
C027	CM	DELTA	S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C028	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_c1# S_CMD_e1# S_CMD_g1# S_CMD_i1# S_CMD_k1# S_CMD_m1# S_CMD_o1# S_CMD_q1# S_CMD_s1#
C029	CM	DELTA	S_CMD_a2# S_CMD_u1#
C030	CM	DELTA	S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C031	CM	DELTA	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1#
C032	CM	VEGA	S_CMV_a2#
C033	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2#
C034	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6#
C035	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5#
C036	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1#
C037	CM	VEGA	S_CMV_e1# S_CMV_f1#
C038	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1#
C039	CM	VEGA	S_CMV_i1# S_CMV_j1#
C040	CM	VEGA	S_CMV_k1# S_CMV_l1#
C041	CM	VEGA	S_CMV_m1# S_CMV_n1#
C042	CM	VEGA	S_CMV_o1# S_CMV_p1#
C043	CM	VEGA	S_CMV_q1# S_CMV_r1#
C044	CM	VEGA	S_CMV_s1# S_CMV_t1#
C045	CM	VEGA	S_CMV_u1# S_CMV_v1#
C046	CM	VEGA	S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C047	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_c1# S_CMV_e1# S_CMV_g1# S_CMV_i1# S_CMV_k1# S_CMV_m1# S_CMV_o1# S_CMV_q1# S_CMV_s1#
C048	CM	VEGA	S_CMV_a2# S_CMV_u1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
C049	CM	VEGA	S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C050	CM	VEGA	S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1#
C051	CM	CURVATURA	S_CMC_b1#
C052	CM	CURVATURA	S_CMC_c1#
C053	CM	CURVATURA	S_CMC_e1#
C054	CM	CURVATURA	S_CMC_g1#
C055	CM	CURVATURA	S_CMC_i1#
C056	CM	CURVATURA	S_CMC_k1#
C057	CM	CURVATURA	S_CMC_m1#
C058	CM	CURVATURA	S_CMC_o1#
C059	CM	CURVATURA	S_CMC_q1#
C060	CM	CURVATURA	S_CMC_s1#
C061	CM	CURVATURA	S_CMC_u1#
C062	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_a2#
C063	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_b1#
C064	CM	CURVATURA	S_CMC_c1# S_CMC_d1#
C065	CM	CURVATURA	S_CMC_e1# S_CMC_f1#
C066	CM	CURVATURA	S_CMC_g1# S_CMC_h1#
C067	CM	CURVATURA	S_CMC_i1# S_CMC_j1#
C068	CM	CURVATURA	S_CMC_k1# S_CMC_l1#
C069	CM	CURVATURA	S_CMC_m1# S_CMC_n1#
C070	CM	CURVATURA	S_CMC_o1# S_CMC_p1#
C071	CM	CURVATURA	S_CMC_q1# S_CMC_r1#
C072	CM	CURVATURA	S_CMC_s1# S_CMC_t1#
C073	CM	CURVATURA	S_CMC_u1# S_CMC_v1#
C074	CM	CURVATURA	S_CMC_a2# S_CMC_b1#
C075	CM	CURVATURA	S_CMC_g1# S_CMC_z1#

Carteira	Classe de risco	Componente	Instrumentos
C076	CM	CURVATURA	S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_e1# S_CMC_g1# S_CMC_i1# S_CMC_k1# S_CMC_m1# S_CMC_o1# S_CMC_q1# S_CMC_s1#
C077	CM	CURVATURA	S_CMC_a2# S_CMC_u1#
C078	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_y1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_x1#
C079	CM	CURVATURA	S_CMC_x1# S_CMC_g1# S_CMC_z1#
C080	CM	CURVATURA	S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#
C081	CM	TODOS	S_CMD_a1# S_CMD_a2# S_CMD_a3# S_CMD_a4# S_CMD_b1# S_CMD_c1# S_CMD_d1# S_CMD_e1# S_CMD_f1# S_CMD_g1# S_CMD_h1# S_CMD_i1# S_CMD_j1# S_CMD_k1# S_CMD_l1# S_CMD_m1# S_CMD_n1# S_CMD_o1# S_CMD_p1# S_CMD_q1# S_CMD_r1# S_CMD_s1# S_CMD_t1# S_CMD_u1# S_CMD_v1# S_CMD_w1# S_CMD_x1# S_CMV_a1# S_CMV_a2# S_CMV_a3# S_CMV_a4# S_CMV_a5# S_CMV_a6# S_CMV_b1# S_CMV_b2# S_CMV_b3# S_CMV_b4# S_CMV_b5# S_CMV_c1# S_CMV_d1# S_CMV_e1# S_CMV_f1# S_CMV_g1# S_CMV_h1# S_CMV_i1# S_CMV_j1# S_CMV_k1# S_CMV_l1# S_CMV_m1# S_CMV_n1# S_CMV_o1# S_CMV_p1# S_CMV_q1# S_CMV_r1# S_CMV_s1# S_CMV_t1# S_CMV_u1# S_CMV_v1# S_CMV_w1# S_CMV_x1# S_CMC_a1# S_CMC_a1# S_CMC_a2# S_CMC_a2# S_CMC_b1# S_CMC_b1# S_CMC_c1# S_CMC_c1# S_CMC_d1# S_CMC_d1# S_CMC_e1# S_CMC_e1# S_CMC_f1# S_CMC_f1# S_CMC_g1# S_CMC_g1# S_CMC_h1# S_CMC_h1# S_CMC_i1# S_CMC_i1# S_CMC_j1# S_CMC_j1# S_CMC_k1# S_CMC_k1# S_CMC_l1# S_CMC_l1# S_CMC_m1# S_CMC_m1# S_CMC_n1# S_CMC_n1# S_CMC_o1# S_CMC_o1# S_CMC_p1# S_CMC_p1# S_CMC_q1# S_CMC_q1# S_CMC_r1# S_CMC_r1# S_CMC_s1# S_CMC_s1# S_CMC_t1# S_CMC_t1# S_CMC_u1# S_CMC_u1# S_CMC_v1# S_CMC_v1# S_CMC_x1# S_CMC_x1# S_CMC_y1# S_CMC_y1# S_CMC_z1# S_CMC_z1#»»