

Anexo à Instrução nº 112/96

PARTE III-A  
 PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS  
 A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JUROS E TAXAS DE CÂMBIO  
 MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO

ELEM. EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A TX. DE JURO E TX. DE CÂMBIO TENDO POR CONTRAPARTE, OU COM GARANTIA EXPRESSA DE, OU CAUCIONADOS POR TÍTULOS NEGOCIÁVEIS REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES EMITIDOS POR (11), OU POR DEPÓSITOS JUNTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (12):	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA A E C. EUROPEIAS	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B		AUTORIDADES REGIONAIS E LOCAIS		BEI E BANCOS MULTILATERAIS DE DESENVOLVIMENTO	INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL
		EM MOEDA DO (GARANTE E) MUTUÁRIO	OUTRAS MOEDAS	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			
				PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS		PRAZO RESIDUAL ≤ 1 ANO	PRAZO RESIDUAL > 1 ANO				
		I	II	III	IV		V	VI	VII	VIII		
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%	20%	20%	50%	50%	
TAXAS DE JURO (27)												
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
3. SUBTOTAL PONDERADO (2.x1.)												
4. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO												
5. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO												
6. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	
7. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (5.x6.)												
8. SUBTOTAL PONDERADO (4.+7.)x1.												
TAXAS DE CÂMBIO (28)												
9. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
10. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
11. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	
12. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (10.x11.)												
13. SUBTOTAL PONDERADO (9.+12.)x1.												
14. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO												
15. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO												
16. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	
17. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (15.x16.)												
18. SUBTOTAL PONDERADO (14.+17.)x1.												
19. TOTAL PONDERADO (29)												

20. TOTAL (30)