

Anexo à Instrução nº 112/96

PARTE III-B
 PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
 A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JUROS E TAXAS DE CÂMBIO
 (MÉTODO: AVALIAÇÃO EM FUNÇÃO DO RISCO INICIAL)

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		
TAXAS DE JURO (26)												
1. COM VENCIMENTO INICIAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO	0%	0%	0,25%	0,1%	0,25%	0,1%	0%	0,1%	0,1%	0,25%	0,25%	
2. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO												
3. SUBTOTAL PONDERADO (1.x2.)												
4. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 2 ANOS												
5. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	0,5%	0,2%	0,5%	0,2%	0%	0,2%	0,2%	0,5%	0,5%	
6. SUBTOTAL PONDERADO (4.x5.)												
7. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 2 ANOS												
8. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO (30)	0%	0%	(1%+A%)x50%=	(1%+A%)x20%=	(1%+A%)x50%=	(1%+A%)x20%=	0%	(1%+A%)x20%=	(1%+A%)x20%=	(1%+A%)x50%=	(1%+A%)x50%=	
9. SUBTOTAL PONDERADO (7.x8.)												
TAXAS DE CÂMBIO (27)												
10. COM VENCIMENTO INICIAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
11. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	1%	0,4%	1%	0,4%	0%	0,4%	0,4%	1%	1%	
12. SUBTOTAL PONDERADO (10.x11.)												
13. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 2 ANOS												
14. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	2,5%	1%	2,5%	1%	0%	1%	1%	2,5%	2,5%	
15. SUBTOTAL PONDERADO (13.x14.)												
16. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 2 ANOS												
17. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO (30)	0%	0%	(5%+3A%)x50%=	(5%+3A%)x20%=	(5%+3A%)x50%=	(5%+3A%)x20%=	0%	(5%+3A%)x20%=	(5%+3A%)x20%=	(5%+3A%)x50%=	(5%+3A%)x50%=	
18. SUBTOTAL PONDERADO (16.x17.)												
19. TOTAL PONDERADO (31)												

20. TOTAL (29)