

Anexo à Instrução nº 14/2001 (altera a Folha 17 do Anexo à Instrução nº 25/97)

Individual

Consolidado

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93  
 PARTE III - A1  
 PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS  
 A CONTRATOS SOBRE TAXAS DE JURO (28)  
 (MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

MODELO RS01

Entidade: \_\_\_\_\_

Ano: \_\_\_\_\_

Mes: \_\_\_\_\_

ELEM. EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A TAXAS 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 DEPOSITOS 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%		
CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO													
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO													
3. SUBTOTAL PONDERADO (2.1)													
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS													
4. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO													
5. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS													
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. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (6.5)													
8. SUBTOTAL PONDERADO (4.7) x1													
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS													
9. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO													
10. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS													
11. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%		
12. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (11.5) x1													
13. SUBTOTAL PONDERADO (9.12) x1													
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO													
14. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS C/ COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (29)													
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (30)													
16. SUBTOTAL PONDERADO (14.15) x1													
17. TOTAL PONDERADO (3.8 + 13.16)													

18. TOTAL (31)

Data da notificação ao Banco de Portugal:

a) do método a que se refere a parte final do ponto 6.3. da parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93 \_\_\_/\_\_\_/\_\_\_.

b) da identificação das contrapartes e dos tipos de operações abrangidas pelos contratos de compensação (ponto 6.6. da parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93 \_\_\_/\_\_\_/\_\_\_).