

Individual

Consolidado

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93

PARTE III - A2
**PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
 A CONTRATOS SOBRE TAXAS DE CÂMBIO E OURO (32)**
 (MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

MODELO RS01

Entidade: _____

Ano: _____

Mes: _____

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 (GA-RANTE E) MUTUÁRIO	OUTRAS MOEDAS	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			
							PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	FRAZO RESIDUAL <=1ANO	FRAZO RESIDUAL >1ANO		
		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												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
3. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
4. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	1,0%	
5. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (4.x3)												
6. SUBTOTAL PONDERADO (5.+2).xl.												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS												
7. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
8. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS												
9. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	5,0%	
10. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (9.x8)												
11. SUBTOTAL PONDERADO (10.+7).xl.												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS												
12. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
13. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS												
14. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.x13)												
16. SUBTOTAL PONDERADO (15.+12).xl.												
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO												
17. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS C/ COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (29)												
18. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (30)												
19. SUBTOTAL PONDERADO (18.+17).xl.												
20. TOTAL PONDERADO (6.+11.+16.+19).												
												21. TOTAL (33)

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) ___/___/___.