

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

Individual

Consolidado

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93

PARTE III - A5  
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS  
A CONTRATOS SOBRE MERCADORIAS QUE NÃO SEJAM METAIS PRECIOSOS (38)  
(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	
			PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B				
						PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	PRAZO RESIDUAL <=1ANO	PRAZO RESIDUAL >1ANO			
			I	II		III	IV	V	VI			VII
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	30%	20%	30%	20%	0%	20%	20%	30%	50%	
<b>CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO</b>												
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	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	
5. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (4x3)												
6. SUBTOTAL PONDERADO (5+2)x1.												
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	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	12,0%	
10. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (9x8)												
11. SUBTOTAL PONDERADO (10+7)x1.												
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	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14x13)												
16. SUBTOTAL PONDERADO (15+12)x1.												
<b>CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO</b>												
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)x1.												
20. TOTAL PONDERADO (6+11+16+19)												

21. TOTAL (39)

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) \_\_\_\_/\_\_\_\_/\_\_\_\_.