

Anexo à Instrução nº 14/2005

Banco de Portugal  
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO RS01-III B

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93  
PARTE III - B  
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS  
A CONTRATOS SOBRE TAXAS DE JURO E TAXAS DE CÂMBIO E OURO  
(MÉTODO: AVALIAÇÃO EM FUNÇÃO DO RISCO INICIAL)

Instituição: \_\_\_\_\_ Base: \_\_\_\_\_ Ano: \_\_\_\_\_  
Mês: \_\_\_\_\_

NÃO EXITEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros

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 (13), OU POR DEPÓSITOS JUNTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (14):	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
<b>TAXAS DE JURO (30)</b>													
1. Com vencimento inicial inferior ou igual a 1 ano													
2. Coeficiente de ponderação	0%	0%	0,25%	0,1%	0,25%	0,1%	0%	0,1%	0,1%	0,25%	0,25%		
3. VALOR PONDERADO (1x2)													
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. VALOR PONDERADO (4x5)													
7. Com vencimento inicial superior a 2 anos													
8. Coeficiente de ponderação (40)	0%	0%					0%						
9. VALOR PONDERADO (7x8)													
<b>TAXAS DE CÂMBIO E OURO (34)</b>													
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. VALOR PONDERADO (10x11)													
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. VALOR PONDERADO (13x14)													
16. Com vencimento inicial superior a 2 anos													
17. Coeficiente de ponderação (42)	0%	0%					0%						
18. VALOR PONDERADO (16x17)													
19. TOTAL PONDERADO (43)													

20. TOTAL (44)