

Anexo à Instrução nº 14/2005

Banco de Portugal
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO RS01-III/1

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93
PARTE III - A1
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO (30)
(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

Instituição: _____ Base: _____ Ano: _____
Mês: _____

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

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
	I	II	III	IV	V	VI		PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			
								PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	PRAZO RESIDUAL < 1 ANO	PRAZO RESIDUAL > 1 ANO		
EM MOEDA DO (GARANTE E) MUTUÁRIO		OUTRAS MOEDAS											
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.x1)													
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.x5)													
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.x10)													
13. SUBTOTAL PONDERADO (9-12).x1													
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO													
14. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS C/ COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (31)													
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (32)													
16. SUBTOTAL PONDERADO (14-15).x1													
17. TOTAL PONDERADO (3.+8.+13.+16.)													
												18. 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)

_____/_____/_____

_____/_____/_____