

Anexo à Instrução nº 14/2005

Banco de Portugal  
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO RS01-III/4

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93  
PARTE III - A4  
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS  
A CONTRATOS SOBRE METAIS PRECIOSOS COM EXCEÇÃO DO OURO (38)  
(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

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

NÃO EXISTEM 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 CAUÇIONADOS 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				XI
								PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	PRAZO RESIDUAL <= 1 ANO	PRAZO RESIDUAL > 1 ANO			
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%	20%	20%	50%	50%			
<b>CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO</b>														
<b>CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO</b>														
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	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%		
5. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (4.x3)														
6. SUBTOTAL PONDERADO (6.-2).x1														
<b>CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS</b>														
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	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%	7,0%		
10. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (9.x8)														
11. SUBTOTAL PONDERADO (10.-7).x1														
<b>CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS</b>														
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	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%		
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.x13)														
16. SUBTOTAL PONDERADO (15.-12).x1														
<b>CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO</b>														
17. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS C/ COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (31)														
18. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (32)														
19. SUBTOTAL PONDERADO (18.-17).x1														
<b>20. TOTAL PONDERADO (6.-11.-16.-19.)</b>														
													21. TOTAL (38)	

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)

\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_/\_\_\_\_

\_\_\_\_\_/\_\_\_\_\_/\_\_\_\_