

Anexo à Instrução nº 14/2005

Banco de Portugal  
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO RS01-III/AS

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 (40)  
(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 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 |                         |                        |       |
|   |   |       |  |       |                                |       | EM MOEDA DO (GA-RIANTE E) MUTUÁRIC            | OUTRAS MOEDAS           | PRÓPRIA INSTITUIÇÃO | OUTRAS           | PRAZO RESIDUAL <= 1 ANO | PRAZO RESIDUAL > 1 ANO | IX    |
| 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  | 10,0%   | 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 (4.x3)   |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| 6. SUBTOTAL PONDERADO (5.2)jt.  |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| <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  | 12,0%   | 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 (9.x3)  |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| 11. SUBTOTAL PONDERADO (10.7)jt.  |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| <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   | 15,0%   | 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 (14.x3)   |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| 16. SUBTOTAL PONDERADO (15.12)jt.   |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| <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)jt.   |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |
| <b>20. TOTAL PONDERADO (6.11.-16.-19.)</b>  |   |       |  |       |                                |       |   |                         |                     |                  |                         |                        |       |

21. TOTAL (41)

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)

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

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