

Anexo à Instrução nº 15/2005

Banco de Portugal
Departamento de Supervisão Bancária

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93

PARTIC. 8. A3

MÓDULO 8

PODERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIAMENTAIS RELATIVOS
A CONTRATOS SOBRE TÍTULOS DE CAPITAL (36)
(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

Tendo por referência contas preparadas de acordo com as NCA ou de acordo com as NIC

Instituição	Nome	Ano
		Mês

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros

ELEM. EXTRAPATRIAMENTAIS RELATIVOS A TÍTULOS DE JURO E TÍTULOS DE CAPITAL TENDO POR CONTRAPARTIDA, OU COM GARANTIA EXPRESSA DE RECUPERAÇÃO, POR TÍTULOS NEGOCIÁVEIS REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES EMITIDOS POR (13), OU POR DEPÓSITOS, JANTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (14).	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU DE BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B		AUTORIDADES REGIONAIS E LOCAIS		BIBLIOTECAS MULTILATINAIS DE COOPERAÇÃO		INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL		
	PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA A							
	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	PRAZO RESIDUAL - JURO	PRAZO RESIDUAL - CAPITAL				
	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII		
1. COEFICIENTE DE PODERAÇÃO DA CONTRAPARTIDA	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%	20%	20%	50%	50%			
CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO														
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO														
1.1. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
1.2. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO														
1.3. COEFICIENTE DE PODERAÇÃO DOS CONTRATOS	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%	6,0%			
1.4. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.3)														
1.5. SUBSTITUIÇÃO POTENCIAL (14.3)														
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS														
1.1. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
1.2. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS														
1.3. COEFICIENTE DE PODERAÇÃO DOS CONTRATOS	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%	8,0%			
1.4. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.3)														
1.5. SUBSTITUIÇÃO POTENCIAL (14.3)														
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS														
1.1. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
1.2. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS														
1.3. COEFICIENTE DE PODERAÇÃO DOS CONTRATOS	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%	10,0%			
1.4. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.3)														
1.5. SUBSTITUIÇÃO POTENCIAL (14.3)														
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO														
1.1. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO COM VALOR POSITIVO (16)														
1.2. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REALIZADO (16)														
1.3. SUBSTITUIÇÃO POTENCIAL (16.17)														
26. TOTAL PODERADO (6.18-16.18-19)														

21. TOTAL (37)

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)

Assinatura