

Anexo à Instrução nº 15/2005

Banco de Portugal

Departamento de Supervisão Bancária

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/03

PARTES II - A1

PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS

A CONTRATOS SOBRE METAS PRECIOSOS COM EXCEÇÃO DO ORO (38)

(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

MODELO 9

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

Instituição:

Data:

Ano:

Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

ELIM. EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A T.C.M. SIMO E T.C. DE CÂMBIO TENHO POR CONTRAPARTE, OU COM GARANTIA EXPRESSA DE, OU CAUCIONADOS POR TÍTULOS NEGOCIÁVEIS REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES EMITIDOS POR (13), OU POR DEPÓSITOS JUNTOS 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		BIBLIOTECAS MULTILÍNGUAS DE DESENVOLVIMENTO	INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL
	EM MOEDA DO PAÍS EMITENTE E EM OUTRAS MOEDAS			PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			
	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII	XIII	XIV
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	20%	0%	20%	20%	20%	50%	50%	
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO														
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO														
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
3. MONTEANTE TÉCNICO 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%	7,0%	
5. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.1)														
6. SUBTOTAL PONDERADO (14.2)														
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS														
7. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
8. MONTEANTE TÉCNICO 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%	7,0%	
10. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.1)														
11. SUBTOTAL PONDERADO (14.2)														
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS														
12. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
13. MONTEANTE TÉCNICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS														
14. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	0,0%	
15. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.1)														
16. SUBTOTAL PONDERADO (14.2)														
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO														
17. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
18. PREÇO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (12)														
19. SUBTOTAL PONDERADO (14.2)														
20. TOTAL PONDERADO (14.1+14.2+14.3+14.4)														
21. TOTAL (38)														

Data de validação no Banco de Portugal

a) do método a que se refere a parte final do ponto 6.3. da parte I do Anexo ao Aviso nº 1/03

b) da identificação das contrapartes e dos tipos de operações abrangidos pelos contratos de compensação (ponto 6.5. da parte I do Anexo ao Aviso nº 1/03)