

Anexo à Instrução nº 15/2005

Banco de Portugal

Departamento de Supervisão Bancária

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/03

PARTICULAR

PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A CONTRATOS SOBRE MERCADORIAS QUE NÃO SEJAM METAS PRECIOSAS (M)

(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

MODELO 18

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

ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A TÍTULOS DE BÍLIO E TÍTULOS DE BÍLIO TENDO POR CONTRAPARTE, OU COM GARANTIA EXPRESSA DE, OU CAUCIONADOS POR TÍTULOS DE BÍLIO REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES EMITIDOS POR (1), 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 DESSENVOLVIMENTO		INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL
	1	2	3	4	5	6	7	8	PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			
									PROPRIA	OUTRA	PROPRIA	OUTRA		
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%	20%	0%	20%	0%	20%	50%	50%
2. QUOTIENTE 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	10,0%	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 (R-CF)														
6. SUBTOTAL PONDERADO (6-1x5)														
7. QUOTIENTE 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	12,0%	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 (R-CF)														
11. SUBTOTAL PONDERADO (11-1x9)														
12. QUOTIENTE 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	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	15,0%	
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (R-CF)														
16. SUBTOTAL PONDERADO (16-1x14)														
17. QUOTIENTE DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO														
18. MONTEANTE TÉCNICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS														
19. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS														
20. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (R-CF)														
21. SUBTOTAL PONDERADO (21-1x19)														
22. TOTAL PONDERADO (6-16-21)														
23. 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 nº 1/03

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 nº 1/03)