

Banco de Portugal

Departamento de Supervisão Bancária

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGÍVEIS PELO AVALIO Nº 1/83

PARTICULAR B

PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
 A CONTRATOS SOBRE TAXAS DE JURO E TAXAS DE CÂMBIO E OURO
 (MÉTODO: AVALIAÇÃO EM FUNÇÃO DO RISCO FISCAL)

MODELO 11

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

Instituição:

ANO:

MÊS:

Base:

ANO:

MÊS:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros															
ELIEM. EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A TAXAS DE JURO E TAXAS DE CÂMBIO TENDO POR CONTRAPARTE, OU COM GARANTIA EXPRESSA DE, OU CAUCIONADOS POR ELIEM. RECONGACIADOS REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES EMITIDOS POR (YS), OU POR DEPÓSITOS JUNTOS DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (14):	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA A (1)		ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B (2)		AUTORIDADES REGIONAIS E LOCAIS (3)		BID E BANCOS MULTILATERAIS DE DESENVOLVIMENTO (4)		INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO (5)				OUTRAS ENTIDADES (6)		TOTAL (7)
	PAÍSES DA ZONA A (1)		PAÍSES DA ZONA B (2)		PAÍSES DA ZONA A (3)		PAÍSES DA ZONA B (4)		PAÍSES DA ZONA A (5)		PAÍSES DA ZONA B (5)		OUTRAS ENTIDADES (6)		TOTAL (7)
	PAÍSES DA ZONA A (1)		PAÍSES DA ZONA B (2)		PAÍSES DA ZONA A (3)		PAÍSES DA ZONA B (4)		PAÍSES DA ZONA A (5)		PAÍSES DA ZONA B (5)		OUTRAS ENTIDADES (6)		TOTAL (7)
	PAÍSES DA ZONA A (1)		PAÍSES DA ZONA B (2)		PAÍSES DA ZONA A (3)		PAÍSES DA ZONA B (4)		PAÍSES DA ZONA A (5)		PAÍSES DA ZONA B (5)		OUTRAS ENTIDADES (6)		TOTAL (7)
	PAÍSES DA ZONA A (1)		PAÍSES DA ZONA B (2)		PAÍSES DA ZONA A (3)		PAÍSES DA ZONA B (4)		PAÍSES DA ZONA A (5)		PAÍSES DA ZONA B (5)		OUTRAS ENTIDADES (6)		TOTAL (7)
TAXAS DE JURO (38)															
1. Com vencimento inicial inferior ou igual a 1 ano															
2. Coeficiente de ponderação															
3. VALOR PONDERADO (1x2)															
4. Com vencimento inicial superior a 1 ano e inferior ou igual a 2 anos															
5. Coeficiente de ponderação															
6. VALOR PONDERADO (4x5)															
7. Com vencimento inicial superior a 2 anos															
8. Coeficiente de ponderação (40)															
9. VALOR PONDERADO (7x8)															
TAXAS DE CÂMBIO E OURO (14)															
10. Com vencimento inicial inferior ou igual a 1 ano															
11. Coeficiente de ponderação															
12. VALOR PONDERADO (10x11)															
13. Com vencimento inicial superior a 1 ano e inferior ou igual a 2 anos															
14. Coeficiente de ponderação															
15. VALOR PONDERADO (13x14)															
16. Com vencimento inicial superior a 2 anos															
17. Coeficiente de ponderação (42)															
18. VALOR PONDERADO (16x17)															
19. TOTAL PONDERADO (43)															
20. TOTAL (44)															