

Banco de Portugal

Departamento de Supervisão Bancária

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO N.º 1/93

PARTICULAR A1

ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a operações sobre taxas de juro (38)

(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

Modelo 6

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

Instituição

Banco

Ano
Mês

☐ Não existem valores a reportar para este mapa

Valores em Euros															
ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS À TAXA DE JURO E À TAXA DE CAMBIO TENDO POR CONTRAPARTE, QUE COM GARANTIA EXPRESSA SE, OU CASO CONTRÁRIO, POR TÍTULOS NEGOCIÁVEIS REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES FINANCEIRAS DO ESTADO, QUE SEJAM DEGRADAÇÃO, ANTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A E/OU	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B		ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B		AUTORIDADES REGIONAIS E LOCAIS		BIBLIOTECAS E BIBLIOTECAS DE DESENVOLVIMENTO		INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL	
	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B			
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	0%	0%	20%	50%	20%	0%	0%	20%	20%	20%	50%	50%	0%
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. SUBTOTAL PONDERADO (1.1) x 1															
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS															
1.3. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO															
1.4. MONTANTE TÉCNICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS															
1.5. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	
1.6. PERIGO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (R1.6)															
1.7. SUBTOTAL PONDERADO (1.5) x 1															
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS															
1.8. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO															
1.9. MONTANTE TÉCNICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS															
1.10. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	1,5%	
1.11. PERIGO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (R1.11)															
1.12. SUBTOTAL PONDERADO (1.10) x 1															
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO															
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (2)															
2.1. PERIGO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (R2.1)															
2.2. SUBTOTAL PONDERADO (2.1) x 1															
2.3. SUBTOTAL PONDERADO (2.2) x 1															
2.4. SUBTOTAL PONDERADO (2.3) x 1															
2.5. SUBTOTAL PONDERADO (2.4) x 1															
2.6. SUBTOTAL PONDERADO (2.5) x 1															
2.7. SUBTOTAL PONDERADO (2.6) x 1															
2.8. SUBTOTAL PONDERADO (2.7) x 1															
2.9. SUBTOTAL PONDERADO (2.8) x 1															
2.10. SUBTOTAL PONDERADO (2.9) x 1															
2.11. SUBTOTAL PONDERADO (2.10) x 1															
2.12. SUBTOTAL PONDERADO (2.11) x 1															
2.13. SUBTOTAL PONDERADO (2.12) x 1															