

Anexo à Instrução nº 18/2004

NOTIFICAÇÃO DE OPERAÇÕES DE TITULARIZAÇÃO (1)

Instituição:		Data prevista para a realização da operação de cedência: / /				
Identificação do programa:		Duração do programa:				
		Revolving: Período e condições para a sua realização:				
1. Montante dos activos cedidos/a ceder (valores em euros)						
1.1. Activos cedidos por entidades do grupo						
Entidades	Capital	Juros	Valor de venda	Coefficiente de ponderação médio	Provisões	
...						
...						
...						
1.2. Limite máximo previsto no contrato:						
2. Natureza dos activos cedidos/a ceder						
2.1. Tipo de activos (2):						
2.2. Duração média ponderada remanescente (3):						
2.3. Taxa de juro média ponderada dos activos (3):						
2.4. <i>Rating</i> médio da carteira cedida (4):						
3. Características dos instrumentos de dívida emitidos/ a emitir (desdobrar por cada um dos instrumentos/tranches)						
Denominação do Instrumento	Montante Emitido	Montante detido (5)	Entidade detentora	Data e forma de reembolso	Taxa de Juro	
...						
...						
...						
Hierarquia em termos de subordinação/reembolso dos vários instrumentos			<i>Rating</i> atribuído aos vários instrumentos			
.....						
.....						
.....						
Montante total dos activos adquiridos/a adquirir pelo veículo que suportam a emissão dos instrumentos (6):						
4. Compromissos assumidos e/ou interesses retidos/a reter pela instituição ou por outra instituição do grupo						
Montantes a título de:						
4.1. Disponibilidades de caixa do emitente						
4.2. Linhas de liquidez						
4.3. Outros financiamentos						
4.4. Cash reserve inicial, limite máximo e mínimo						
4.5. Garantias						
4.6. Proveitos residuais						
4.7. <i>Swaps</i> de taxa de juro e outros instrumentos derivados						
4.8. Recompra dos activos remanescentes (7)						
4.9. Outros						
5. Entidades que intervêm na operação						
Nome da entidade	País da Sede	Tipo de entidade/actividade (8)	Função desempenhada (9)	Relação de participação (10)		
...						
...						
...						
7. Princípios e políticas contabilísticas seguidos (11)						
7.1. Quanto à descontinuidade do reconhecimento no Balanço dos activos cedidos/a ceder:						
7.2. Quanto ao provisionamento dos activos cedidos/ a ceder:						
7.3. Quanto ao reconhecimento de resultados obtidos na cedência:						
8. Separação jurídica do património do cedente dos activos transferidos/a transferir						
8.1. Identificação da entidade responsável pela emissão do parecer a que se refere a alínea a) do ponto 2 do n.º 3º do Aviso n.º 10/2001. (12)						
9. Gestão e controlo dos riscos envolvidos (13)						
10. Outras informações que sejam consideradas relevantes (14):						

Data de envio da informação ao Banco de Portugal: / /

O responsável pela informação

O responsável pela Gestão
