

Banco de Portugal
Departamento de Supervisão Bancária

MERCADORIAS - MÉTODO DA ESCALA DE PRAZOS DE VENCIMENTO
(Anexo VIII do Aviso nº 7/96)

MODELO MER2

Instituição:

Base:

Ano:
Mês:

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros

INTERVALOS DE PRAZOS DE VENCIMENTO	POSIÇÃO	
	LONGA	CURTA
≤ 1 mês		
> 1 ≤ 3 meses		
> 3 ≤ 6 meses		
> 6 ≤ 12 meses		
> 1 ≤ 2 anos		
> 2 ≤ 3 anos		
> 3 anos		

INTERVALOS DE PRAZOS DE VENCIMENTO	POSIÇÕES COMPENSADAS NUM INTERVALO		POSIÇÕES NÃO COMPENSADAS NUM INTERVALO	
	B	LONGA	CURTA	V
≤ 1 mês				
> 1 ≤ 3 meses				
> 3 ≤ 6 meses				
> 6 ≤ 12 meses				
> 1 ≤ 2 anos				
> 2 ≤ 3 anos				
> 3 anos				
TOTAL				

POSIÇÃO COMPENSADA EM INTERVALOS CONSECUTIVOS	POSIÇÕES NÃO COMPENSADAS EM INTERVALOS CONSECUTIVOS	
	LONGA	CURTA
VI		
VII		
VIII		
IX		
X		
XI		
XII		
XIII		
XIV		
XV		
XVI		
XVII		
XVIII		
XIX		
XX		
XXI		
XXII		
XXIII		
XXIV		
TOTAL		

POSIÇÃO COMPENSADA EM INTERVALOS CONSECUTIVOS	POSIÇÕES NÃO COMPENSADAS EM INTERVALOS CONSECUTIVOS	
	LONGA	CURTA
XII		
XIII		
XIV		
XV		
XVI		
XVII		
XVIII		
XIX		
XX		
XXI		
XXII		
XXIII		
XXIV		
TOTAL		

CÁLCULO DE REQUISITOS

1. TOTAL DAS POSIÇÕES COMPENSADAS NUM INTERVALO (Total da coluna B)		4. [1. X 1,2%]	
2. TOTAL DAS POSIÇÕES COMPENSADAS EM INTERVALOS CONSECUTIVOS (Soma dos colunas VI, IX, XII, XV, XVIII, XXI)		5. [2. X 0,8%]	
3. TOTAL DAS POSIÇÕES NÃO COMPENSADAS EM INTERVALOS CONSECUTIVOS (Total da coluna XXIV)		6. [3. X 1,5%]	
		7. PREÇO A VISTA DA MERCADORIA	1
		8. REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS [(4. + 5. + 6.) X 7.]	