

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO RS01-III.1

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93
PARTE III - A1
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO (30)
(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

Instituição: _____ Base: _____ Ano: _____ Mês: _____

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros

ELEM. EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS A TX. DE JURO E TX. DE CÂMBIO TENDO POR CONTRAPARTE, OU COM GARANTIA EXPRESSA DE, OU CAUCIONADOS POR TÍTULOS NEGOCIÁVEIS REPRESENTATIVOS DE RESPONSABILIDADES EMITIDOS POR (13), OU POR DEPÓSITOS JUNTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (14):	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B		AUTORIDADES REGIONAIS E LOCAIS		BEI E BANCOS MULTILATERAIS DE DESENVOLVIMENTO	INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL	
	EM MOEDA DO (GARANTE E) MUTUÁRIO	OUTRAS MOEDAS	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B				
						PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	PRAZO RESIDUAL <= 1ANO	PRAZO RESIDUAL >1ANO			
	1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%	20%	20%	50%	50%	
CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO												
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
3. SUBTOTAL PONDERADO (2.x1)												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
4. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
5. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS												
6. 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%	
7. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (6.x5)												
8. SUBTOTAL PONDERADO (4.+7.)x1												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS												
9. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
10. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS												
11. 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%	
12. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (11.x10)												
13. SUBTOTAL PONDERADO (9.+12.)x1												
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO												
14. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS C/ COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (31)												
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (32)												
16. SUBTOTAL PONDERADO (14.+15.)x1												
17. TOTAL PONDERADO (3.+8.+13.+16)												
											18. TOTAL (33)	

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 n.º 1/93

b) da identificação das contrapartes e dos tipos de operações abrangidas pelos contratos de compensação (ponto 6.8. da parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93)

____/____/____

____/____/____