

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93
PARTE III - A2
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
A CONTRATOS SOBRE TAXAS DE CÂMBIO E OURO (34)
(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

MODELO RS01-III.A2

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 CAUÇIONADOS 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	
	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA A E C. EUROPEIAS	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 <= 1 ANO			PRAZO RESIDUAL >1 ANO
	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. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO												
4. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	
5. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (4.x3.)												
6. SUBTOTAL PONDERADO (5.+2.)x1.												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS												
7. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
8. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 5 ANOS												
9. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	
10. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (9.x8.)												
11. SUBTOTAL PONDERADO (10.+7.)x1.												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS												
12. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM VALOR POSITIVO												
13. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 5 ANOS												
14. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	7,5%	
15. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO (14.x13.)												
16. SUBTOTAL PONDERADO (15.+12.)x1.												
CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO												
17. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS C/ COMPENSAÇÃO C/ VALOR POSITIVO (31)												
18. RISCO DE CRÉDITO POTENCIAL FUTURO REDUZIDO (32)												
19. SUBTOTAL PONDERADO (18.+17.)x1.												
20. TOTAL PONDERADO (6.+11.+16.+19.)												
												21. TOTAL (35)

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 6.6. da parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93)

____/____/____

____/____/____