

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO RS01-III B

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93
PARTE III - B
PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS
A CONTRATOS SOBRE TAXAS DE JURO E TAXAS DE CÂMBIO E OURO
(MÉTODO: AVALIAÇÃO EM FUNÇÃO DO RISCO INICIAL)

Instituição:

Base:

Ano:

Mês:

NÃO EXITEM 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	
	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
TAXAS DE JURO (30)												
1. Com vencimento inicial inferior ou igual a 1 ano												
2. Coeficiente de ponderação	0%	0%	0,25%	0,1%	0,25%	0,1%	0%	0,1%	0,1%	0,25%	0,25%	
3. VALOR PONDERADO (1x2)												
4. Com vencimento inicial superior a 1 ano e inferior ou igual a 2 anos												
5. Coeficiente de ponderação	0%	0%	0,5%	0,2%	0,5%	0,2%	0%	0,2%	0,2%	0,5%	0,5%	
6. VALOR PONDERADO (4x5)												
7. Com vencimento inicial superior a 2 anos												
8. Coeficiente de ponderação (40)	0%	0%					0%					
9. VALOR PONDERADO (7x8)												
TAXAS DE CÂMBIO E OURO (34)												
10. Com vencimento inicial inferior ou igual a 1 ano												
11. Coeficiente de ponderação	0%	0%	1%	0,4%	1%	0,4%	0%	0,4%	0,4%	1%	1%	
12. VALOR PONDERADO (10x11)												
13. Com vencimento inicial superior a 1 ano e inferior ou igual a 2 anos												
14. Coeficiente de ponderação	0%	0%	2,5%	1%	2,5%	1%	0%	1%	1%	2,5%	2,5%	
15. VALOR PONDERADO (13x14)												
16. Com vencimento inicial superior a 2 anos												
17. Coeficiente de ponderação (42)	0%	0%					0%					
18. VALOR PONDERADO (16x17)												
19. TOTAL PONDERADO (43)												

20. TOTAL (44)