

Anexo à Instrução n.º 23/2007

INSTRUMENTOS DE DÍVIDA - RISCO GERAL - MÉTODO DE BASEADO NO PRAZO DE VENCIMENTO
(Anexo 8 do Anexo n.º 8/2007)

MODELO 004

Banco de Portugal
SUSCISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

Instituição: _____ Data: _____ Divisa: _____ Ano: _____ Mês: _____

Parte I
Cálculo da posição

Valores em Euros

ZONA	INTERVALO DE PRAZOS DE VENCIMENTO		PONDERAÇÃO	Total das posições (1)		4. Efeito da redução das posições líquidas relativas à tomada em conta de títulos de dívida (2)	Posições líquidas depois do efeito da redução das posições relativas à tomada em conta de títulos de dívida (2)		Posições ponderadas (4)		Posições ponderadas no intervalo (5)			Posições ponderadas dentro da mesma zona (6)			Posições ponderadas entre as zonas um e dois (7)			Posições ponderadas entre as zonas dois e três (8)			Posições ponderadas entre as zonas um e três (9)			Posições resultantes (10)
	1.6 ≤ t < 1.8 a	1.8 ≤ t < 2.0 a		Longa	Curta		Longas	Curtas	Longas	Curtas	Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas		
	1	2		3	4		5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20	21	22	23	
LM	0 ≤ t < 1 a	0 ≤ t < 1 a	0,00%																							
	1 ≤ t < 3 m	1 ≤ t < 3 m	0,25%																							
	3 ≤ t < 6 m	3 ≤ t < 6 m	0,40%																							
	6 ≤ t < 12 m	6 ≤ t < 12 m	0,70%																							
SUBTOTAL																										
DOE	1 ≤ t < 2 a	1 ≤ t < 2 a	1,25%																							
	2 ≤ t < 3 a	2 ≤ t < 3 a	1,75%																							
	3 ≤ t < 6 a	3 ≤ t < 6 a	2,25%																							
SUBTOTAL																										
TRES	4 ≤ t < 6 a	3 ≤ t < 4 a	2,70%																							
	6 ≤ t < 7 a	4 ≤ t < 5 a	3,25%																							
	7 ≤ t < 10 a	5 ≤ t < 7 a	3,75%																							
	10 ≤ t < 15 a	7 ≤ t < 10 a	4,50%																							
	15 ≤ t < 20 a	10 ≤ t < 15 a	5,25%																							
20 a	15 ≤ t < 20 a	6,00%																								
20 a	12 ≤ t < 20 a	6,00%																								
SUBTOTAL																										
TOTAL																										

Parte II
Cálculo dos requisitos dos fundos próprios

	VALOR	PONDERAÇÃO	REQUISITO (19)
1. Somatório das posições ponderadas compensadas de todos os intervalos (11)	1	2	2
2. Posição ponderada compensada da zona um (12)		0,4	
3. Posição ponderada compensada da zona dois (13)		0,3	
4. Posição ponderada compensada da zona três (14)		0,3	
5. Posição ponderada compensada entre as zonas um e dois (15)		0,4	
6. Posição ponderada compensada entre as zonas dois e três (16)		0,4	
7. Posição ponderada compensada entre as zonas um e três (17)		1,5	
8. Posição residual não compensada (18)		1	
9. TOTAL (1+...+8)			