

Anexo à Instrução n.º 23/2007

<p><i>Banco de Portugal</i> EUROSISTEMA Departamento de Supervisão Bancária</p>	<p>INSTRUMENTOS DE DÍVIDA - RISCO GERAL - MÉTODO BASEADO NA «DURAÇÃO» (Anexo II do Aviso n.º 8/2007)</p>	<p>MODEL O ID62</p>
Instituição	Base	Divisa
		Ano
		Mês

Parte I
Cálculo da posição

ZONA	DURAÇÃO MODIFICADA (ANOS)	Total das posições (1)		(1) Efeito da redução das posições líquidas relativas à tomada tripe de títulos de dívida (2)		Posições líquidas depois do efeito da redução das posições relativas à tomada tripe de títulos de capital (3)		Posições líquidas ponderadas (4)		Posições ponderadas dentro da mesma zona (5)			Posições ponderadas entre as zonas um e dois (6)			Posições ponderadas entre as zonas dois e três (7)			Posições ponderadas entre as zonas um e três (8)			Posições residuais (9)
		Longa	Curta	Longas	Curtas	Longas	Curtas	Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas		Compensadas	Não compensadas				
									Longas	Curtas		Longas	Curtas		Longas	Curtas		Longas	Curtas			
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20			
UM	0 ≤ 1																					
DOIS	1 < 2,0																					
TRÊS	> 2,0																					
TOTAL																						

Parte II
Cálculo dos requisitos dos fundos próprios

	VALOR	PONDERAÇÃO	REQUISITO (17)
	1	2	3
1. Posição ponderada compensada da zona um (10)		0,02	
2. Posição ponderada compensada da zona dois (11)		0,02	
3. Posição ponderada compensada da zona três (12)		0,02	
4. Posição ponderada compensada entre as zonas um e dois (13)		0,4	
5. Posição ponderada compensada entre as zonas dois e três (14)		0,4	
6. Posição ponderada compensada entre as zonas um e três (15)		1,6	
7. Posição residual não compensada (16)		1	
8. TOTAL (1+...+7)			