Anexo à Instrução nº 25/97

MODELO RS01

☐ **Individual**

☐ **Consolidado**

FUNDOS PRÓPRIOS EXIGIDOS PELO AVISO Nº 1/93

PARTE III - A

PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS

A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JURO E TAXAS DE CÂMBIO

(MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

Entidade:_____

Ano: _____

Mês: _____

Unidade: _____

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 (11), OU POR DEPÓSITOS JUNTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (12):	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA A E C. EUROPEIAS	ADMINISTRAÇÕES CENTRAIS OU BANCOS CENTRAIS DE PAÍSES DA ZONA B		AUTORIDADES REGIONAIS E LOCAIS		BEI E BANCOS MULTILATERAIS DE DESENVOLVIMENTO	INSTITUIÇOES DE CRÉDITO				OUTRAS ENTIDADES	TOTAL
				PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B		PAÍSES DA ZONA A		PAÍSES DA ZONA B			
		EM MOEDA DO (GARANTE E) MUTUÁRIO	OUTRAS MOEDAS				PRÓPRIA INSTITUIÇÃO	OUTRAS	PRAZO RESIDUAL <=1ANO	PRAZO RESIDUAL >1ANO		
	I	II	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%	20%	20%	50%	50%	
TAXAS DE JURO (27) CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO 2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO 3. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DE CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO (28)												
4. SUBTOTAL PONDERADO (2.+3.)x1.												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO 5. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO 6. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DE CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO (28) 7. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO												
8. 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%	
9. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (8.x7.)												
10. SUBTOTAL PONDERADO (5.+6.+9.)x1.												
TAXAS DE CÂMBIO (29) CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO 11. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO 12. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DE CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO (28) 13. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO SEM COMPENSAÇÃO 14. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO COM COMPENSAÇÃO (28)												
15. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%	
16. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (13.+14.)x15.												
17. SUBTOTAL PONDERADO (11.+12.+16.)x1.												
CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO 18. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS SEM COMPENSAÇÃO 19. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM COMPENSAÇÃO (28) 20. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO SEM COMPENSAÇÃO 21. MONTANTE TEORICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO COM COMPENSAÇÃO (28)												
22. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%	
23. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (20.+21.)x22.												
24. SUBTOTAL PONDERADO (18.+19.+23.)x1.												
25. TOTAL PONDERADO (30)												

26. TOTAL (31)