

**INSTRUMENTOS DE DÍVIDA - RISCO GERAL - MÉTODO DE BASE**  
(Subseções I-B e IV da Seção B do Anexo V do Anexo nº 7/99)

MODELO DM2

Entidade: \_\_\_\_\_  
 Ano: \_\_\_\_\_  
 Mês: \_\_\_\_\_  
 Unidade: \_\_\_\_\_

Individual  
 Consolidado

Cálculo da posição

Divisa: \_\_\_\_\_

ZONA	INTERVALO DE PRAZOS DE VENCIMENTO		PONDERAÇÃO	POSICÃO (I)		POSICÃO Ponderada (2)		POSICÃO Ponderada no Intervalo (3)		POSICÃO Ponderada na Zona (4)		POSICÃO Ponderada entre as zonas I e II (5)		POSICÃO Ponderada entre as zonas I, II e III (6)		POSICÃO Ponderada entre as zonas I, II, III e IV (7)		(8)	
	CUBAO ≥ 3%	CUBAO < 3%		LONGA (+)	CURTA (-)	COMPENSADA	NÃO COMPENSADA	LONGA (+)	CURTA (-)	COMPENSADA	NÃO COMPENSADA	LONGA (+)	CURTA (-)	COMPENSADA	NÃO COMPENSADA	LONGA (+)	CURTA (-)		COMPENSADA
UM	0 # 1m	0 # 1m	0,00%																
	>1 # 3m	>1 # 3m	0,20%																
	>3 # 6m	>3 # 6m	0,40%																
	>6 # 12m	>6 # 12m	0,70%																
<b>SUBTOTAL</b>																			
DOIS	>1 # 2a	>1 # 1,9a	1,25%																
	>2 # 3a	>1,9 # 2,8a	1,75%																
	>3 # 4a	>2,8 # 3,6a	2,25%																
	<b>SUBTOTAL</b>																		
TRÊS	>4 # 5a	>3,6 # 4,3a	2,75%																
	>5 # 7a	>4,3 # 5,7a	3,25%																
	>7 # 10a	>5,7 # 7,3a	3,75%																
	>10 # 15a	>7,3 # 9,3a	4,50%																
	>15 # 20a	>9,3 # 10,6	5,25%																
	>20a	>10,6 # 12,1a	6,00%																
	>12 # 20a	>12 # 20a	8,00%																
	> 20a	> 20a	12,50%																
<b>SUBTOTAL</b>																			
<b>TOTAL</b>																			

LEGENDA:  
 m = mês  
 a = ano