Anexo à Instrução nº 32/2005

Banco de Portugal
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO **ME02**

POR MERCADORIA - MÉTODO DA ESCALA DE PRAZOS DE VENCIMENTO

(Anexo VIII do Aviso nº 7/96)

Instituição: Mercadoria: Base: Ano: Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros

Intervalos de prazos de vencimento	Posição	
	Longa	Curta
	I	II
≤ 1 mês		
> 1 ≤ 3 meses		
> 3 ≤ 6 meses		
> 6 ≤ 12 meses		
> 1 ≤ 2 anos		
> 2 ≤ 3 anos		
> 3 anos		

Valores em Euros

Intervalos de prazos de vencimento	Posição compensadas num intervalo	Posições não compensadas num intervalo		Posição compensada em intervalos consecutivos	Posições não compensadas num intervalo		Posição compensada em intervalos consecutivos	Posições não compensadas num intervalo		Posição compensada em intervalos consecutivos	Posições não compensadas num intervalo		Posição compensada em intervalos consecutivos	Posições não compensadas num intervalo		Posição compensada em intervalos consecutivos	Posições não compensadas num intervalo		Posições não compensadas em intervalos consecutivos
		Longa	Curta		Longa	Curta		Longa	Curta		Longa	Curta		Longa	Curta		Longa	Curta	
	III	IV	V	VI	VII	VIII	IX	X	XI	XII	XIII	XIV	XV	XVI	XVII	XVIII	XIX	XX	XXIV
≤ 1 mês																			
> 1 ≤ 3 meses																			
> 3 ≤ 6 meses																			
> 6 ≤ 12 meses																			
> 1 ≤ 2 anos																			
> 2 ≤ 3 anos																			
> 3 anos																			
TOTAL																			TOTAL

CÁLCULO DE REQUISITOS

1. TOTAL DAS POSIÇÕES COMPENSADAS NUM INTERVALO (Total da coluna III)

2. TOTAL DAS POSIÇÕES COMPENSADAS EM INTERVALOS CONSECUTIVOS (Somatório das colunas VI, IX, XII, XV, XVIII, XXI)

3. TOTAL DAS POSIÇÕES NÃO COMPENSADAS EM INTERVALOS CONSECUTIVOS (Total da coluna XXIV)

4. [1. X 1,5%]

5. [2. X 0,6%]

6. [3. X 15%]

7. REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS [4. + 5. + 6.]