

Anexo à Instrução nº 95/96

PARTE III-A

PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS

A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JUROS E TAXAS DE CÂMBIO

MÉTODO: AVALIAÇÃO AO PREÇO DE MERCADO)

(milhões de escudos)

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 (10), OU POR DEPÓSITOS JUNTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (11):	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	PAÍSES DA PRÓPRIA INSTITUIÇÃO
		EM MOEDA DO (GARANTE E) MUTUÁRIO	OUTRAS MOEDAS	PAÍSES DA ZONA A	PAÍSES DA ZONA B		
		I	II	III	IV		
1. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DA CONTRAPARTE	0%	0%	50%	20%	50%	20%	0%
TAXAS DE JURO (24)							
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
3. SUBTOTAL PONDERADO (2.x1.)							
4. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
5. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
6. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%
7. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (5.x6.)							
8. SUBTOTAL PONDERADO (4.+7.)x1.							
TAXAS DE CÂMBIO (25)							
9. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
10. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
11. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1%	1%	1%	1%	1%	1%	1%
12. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (10.x11.)							
13. SUBTOTAL PONDERADO (9.+12.)x1.							
14. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
15. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
16. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	5%	5%	5%	5%	5%	5%	5%
17. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (15.x16.)							
18. SUBTOTAL PONDERADO (14.+17.)x1.							
19. TOTAL PONDERADO (26)							

20. TOTAL (27)