

Anexo à Instrução nº 95/96

PARTE III-B

PONDERAÇÃO DOS ELEMENTOS EXTRAPATRIMONIAIS RELATIVOS

A OPERAÇÕES SOBRE TAXAS DE JUROS E TAXAS DE CÂMBIO

(MÉTODO: AVALIAÇÃO EM FUNÇÃO DO RISCO INICIAL)

(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		
TAXAS DE JURO (24)							
1. COM VENCIMENTO INICIAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
2. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	0,25%	0,1%	0,25%	0,1%	0%
3. SUBTOTAL PONDERADO (1.x2.)							
4. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 2 ANOS							
5. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	0,5%	0,2%	0,5%	0,2%	0%
6. SUBTOTAL PONDERADO (4.x5.)							
7. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 2 ANOS							
8. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO (28)	0%	0%	(1%+A%)x50%	(1%+A%)x20%	(1%+A%)x50%	(1%+A%)x20%	0%
9. SUBTOTAL PONDERADO (7.x8.)							
TAXAS DE CÂMBIO (25)							
10. COM VENCIMENTO INICIAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
11. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	1%	1%	0,4%	1%	0,4%
12. SUBTOTAL PONDERADO (10.x11.)							
13. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 1 ANO E INFERIOR OU IGUAL A 2 ANOS							
14. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO	0%	0%	2,5%	1%	2,5%	1%	0%
15. SUBTOTAL PONDERADO (13.x14.)							
16. COM VENCIMENTO INICIAL SUPERIOR A 2 ANOS							
17. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO (28)	0%	0%	(5%+3A%)x50%	(5%+3A%)x20%	(5%+3A%)x50%	(5%+3A%)x20%	0%
18. SUBTOTAL PONDERADO (16.x17.)							
19. TOTAL PONDERADO (29)							

20. TOTAL (27)