

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 (13), OU POR DEPÓSITOS JUNTO DE INSTITUIÇÕES DE CRÉDITO DA ZONA A (14):	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	PR INST
		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%	
I. TAXAS DE JURO (38)							
2. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
A - SUBTOTAL PONDERADO = 1x2 (39)	0	0					
3. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
4. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	0,5%	
5. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS							
6. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO = (4x5)							
B - SUBTOTAL PONDERADO = (3+6)x1 (39)	0	0					
II. TAXAS DE CÂMBIO (40)							
8. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
9. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL INFERIOR OU IGUAL A 1 ANO							
10. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS	1%	1%	1%	1%	1%	1%	
11. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO	0	0					
C - SUBTOTAL PONDERADO = (8+11)x1 (39)	0	0					
13. CUSTO DE SUBSTITUIÇÃO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO							
14. MONTANTE TEÓRICO DOS CONTRATOS COM PRAZO RESIDUAL SUPERIOR A 1 ANO	5%	5%	5%	5%	5%	5%	
15. COEFICIENTE DE PONDERAÇÃO DOS CONTRATOS							
16. VALOR PONDERADO DO MONTANTE TEÓRICO (14.x15.)	0	0					
D - SUBTOTAL PONDERADO (13+16)x1 (39)	0	0					
19. TOTAL PONDERADO (41)	0	0					