

Anexo à Instrução nº 98/96

PARTE III-A: Ponderação dos elementos extrapatrimoniais relativos a operações de taxas de juro e de câmbio (1º método: avaliação ao preço de mercado)

(Milhares de contos)

RUBRICAS	Custo de Substituição (1)	Montante Teórico Ponderado (2)	TOTAL (1)+(2)			
			0%	20%	50%	
A. Taxas de juro						
33. Com prazo residual menor ou igual a 1 ano	X	X	X	X	X	
34. Com prazo residual maior que 1 ano	X	X	X	X	X	
35. Total (33+34)	X	X	X	X	X	TOTAL
36. Total ponderado			X	X	X	X
B. Taxas de câmbio						
37. Com prazo residual menor ou igual a 1 ano	X	X	X	X	X	
38. Com prazo residual maior que 1 ano	X	X	X	X	X	
39. Total (37+38)	X	X	X	X	X	TOTAL
40. Total Ponderado			X	X	X	X

- (1) Custo de substituição dos contratos com valor positivo determinado por avaliação ao preço de mercado.
- (2) Montante teórico de cada contrato x percentagens inscritas no quadro constante do ponto 3.2.1.2 do Anexo ao Aviso nº 1/93.