

34. Títulos de dívida não subordinada emitidos

Esta rubrica é analisada como segue:

	(Milhares de euros)	
	2019	2018
Obrigações	309.804	310.164
Obrigações hipotecárias	995.976	994.347
Medium term notes (MTNs)	99.119	77.488
Securitizações	184.631	298.395
	1.589.530	1.680.394
Periodificações	5.194	5.693
	1.594.724	1.686.087

Em 31 de dezembro de 2019 os Empréstimos obrigacionistas emitidos pelo Grupo, são analisados como segue:

	(Milhares de euros)				
Denominação	Data de emissão	Data de reembolso	Taxa de juro	Valor nominal	Valor balanço
Banco Comercial Português:					
BCP 4.75 % set 20 Vm Sr 279	setembro, 2012	setembro, 2020	Taxa fixa de 4,750%	27.100	27.641
BCP Cln Brisa Fev 2023 Esvm Sr 23	fevereiro, 2015	fevereiro, 2023	Taxa fixa de 2,65% - ativo subjacente - Brisa 022023	2.000	1.994
BCP 4.03 Maio 2021 Esvm Sr 33	agosto, 2015	maio, 2021	Até 27 set 2015: taxa fixa 6,961%; após 27 set 2015: taxa fixa 4,03%	2.500	2.554
Covered Bonds Sr 9	maio, 2017	maio, 2022	Taxa fixa de 0,75%	1.000.000	995.976
Bcp Div Cabaz 3 Ações Smtm 3	dezembro, 2017	dezembro, 2020	Indexada a um cabaz de 3 ações	6.362	6.318
Bcp Mill Cabaz 3 Ações Fev 2021 Smtm Sr 6	fevereiro, 2018	fevereiro, 2021	Indexada a um cabaz de 3 ações	10.958	10.958
Tit Div Mill Cabaz 3 Ações Mar 2021 Smtm Sr 7	março, 2018	março, 2021	Indexada a um cabaz de 3 ações	24.336	24.336
Bcp Part Euro Ações Valor Iii/18 Smtm Sr. 8	março, 2018	março, 2021	Indexada ao EuroStoxx Select Dividend 30	1.370	1.370
Bcp Tit Div Mill Cabaz 3 Ações Mai 2021 Smtm Sr 10	maio, 2018	maio, 2021	Indexada a um cabaz de 3 ações	32.361	32.361
Bcp Perfor Cabaz Ponder 18/17.05.21 Smtm Sr.14	maio, 2018	maio, 2021	Indexada a um cabaz de 3 ações	790	790
Bcp Rend Min Cb Multi Set Iii19 Eur Smtm Sr 36	março, 2019	março, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	3.000	3.000
Bcp Euro Sectores Retorno Garantido Iv Smtm 37	maio, 2019	maio, 2022	Indexada a um cabaz de 3 índices	3.960	3.960
Bcp Ações Euro Zona Ret Min V19 Smtm 39	maio, 2019	maio, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	2.480	2.480
Bcp Rend Min Euro Setores Vi Smtm Sr 41	junho, 2019	junho, 2022	Indexada a um cabaz de 3 índices	3.150	3.150
Bcp Eur Cabaz Ações Ret MinVii 19 Eur Smtm Sr 43	julho, 2019	agosto, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	2.270	2.270
Bcp Cabaz Ações America Ret Min Out22 Smtm 45	outubro, 2019	outubro, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	1.610	1.610
Bcp Cabaz Ações Euro Retorno Min.Xii19 Smtm 46	dezembro, 2019	dezembro, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	6.210	6.210
BCP Finance Bank:					
BCP Fin.Bank - EUR 10 M	março, 2004	março, 2024	Taxa fixa de 5,01%	300	305
Magellan Mortgages n.º 3:					
Mbs Magellan Mortgages S 3 Cl.A	junho, 2005	maio, 2058	Euribor 3M + 0,26%	196.588	182.230
Mbs Magellan Mortgages S.3 Cl.B	junho, 2005	maio, 2058	Euribor 3M + 0,38%	1.015	940
Mbs Magellan Mortgages S. 3 Cl.C	junho, 2005	maio, 2058	Euribor 3M + 0,58%	1.575	1.460
Bank Millennium:					
Bank Millennium - BPW_2020/02	fevereiro, 2017	fevereiro, 2020	Indexada a Platinum Price index	1.689	1.689
Bank Millennium - BPW_2020/03	março, 2017	março, 2020	Indexada a Facebook	1.121	1.121
Bank Millennium - BPW_2020/04	abril, 2017	abril, 2020	Indexada a Gold Fix Price	165	165
Bank Millennium - BKMO_210420T	abril, 2017	abril, 2020	Wibor 6m + 100 pb	70.430	70.430

(continua)

(continuação)

				(Milhares de euros)	
Denominação	Data de emissão	Data de reembolso	Taxa de juro	Valor nominal	Valor balanço
Bank Millennium - BPW_2020/05	maio, 2017	maio, 2020	Indexada a cabaz de 4 ações	425	425
Bank Millennium - BPW_2020/06	junho, 2017	junho, 2020	Indexada a cabaz de 4 ações	560	560
Bank Millennium - BPW_2020/07	julho, 2017	julho, 2020	Indexada ao índice WIG20	738	738
Bank Millennium - BPW_2020/08	agosto, 2017	agosto, 2020	Indexada a Alibaba	245	245
Bank Millennium - BPW_2020/09	setembro, 2017	setembro, 2020	Indexada a Louis Vuitton	748	748
Bank Millennium - BPW_2020/10	outubro, 2017	outubro, 2020	Indexada a Gold Fix Price	1.009	1.009
Bank Millennium - BPW_2020/11	novembro, 2017	novembro, 2020	Indexada ao índice S&P 500	1.640	1.640
Bank Millennium - BPW_2020/12	dezembro, 2017	dezembro, 2020	Indexada a cabaz de 5 ações	866	866
Bank Millennium - BPW_2020/02A	fevereiro, 2018	fevereiro, 2020	Indexada ao índice S&P 500	717	717
Bank Millennium - BPW_2020/03A	março, 2018	março, 2020	Indexada ao índice DAX	2.380	2.380
Millennium Leasing - G9	março, 2018	março, 2020	Wibor 3m + 90 pb	12.113	12.113
Bank Millennium - BPW_2020/04A	abril, 2018	abril, 2020	Indexada ao índice Nasdaq 100	3.645	3.645
Bank Millennium - BPW_2021/05	maio, 2018	maio, 2021	Indexada a Gold Fix Price	1.523	1.523
Bank Millennium - BPW_2021/06A	junho, 2018	junho, 2021	Indexada ao índice Nasdaq 100	2.777	2.777
Bank Millennium - BPW_2020/07A	julho, 2018	junho, 2021	Indexada ao índice FTSE MIB	3.925	3.925
Millennium Leasing - G10	julho, 2018	julho, 2020	Wibor 3m + 90 pb	8.702	8.702
Bank Millennium - BPW_2020/09A	setembro, 2018	setembro, 2020	Indexada às ações do Facebook	4.425	4.425
Bank Millennium - BPW_2020/09B	setembro, 2018	setembro, 2020	Indexada às ações do Facebook	2.964	2.964
Bank Millennium - BPW_2020/09C	setembro, 2018	setembro, 2020	Indexada às ações do Facebook	1.867	1.867
Bank Millennium - BPW_2020/10A	outubro, 2018	outubro, 2020	Indexada ao índice DAX	4.142	4.142
Bank Millennium - BPW_2020/10B	outubro, 2018	outubro, 2020	Indexada ao índice DAX	2.802	2.802
Millennium Leasing - G11	outubro, 2018	outubro, 2020	Wibor 3m + 90 pb	3.810	3.810
Bank Millennium - BPW_2020/11A	novembro, 2018	novembro, 2020	Indexada ao índice FTSE MIB	3.515	3.515
Bank Millennium - BPW_2020/11B	novembro, 2018	novembro, 2020	Indexada ao índice FTSE MIB	1.561	1.561
Bank Millennium - BPW_2020/12A	dezembro, 2018	dezembro, 2020	Indexada ao índice Nasdaq 100	5.775	5.775
Bank Millennium - BPW_2021/01	janeiro, 2019	janeiro, 2021	Indexada às ações do Facebook	8.365	8.365
Bank Millennium - BPW_2021/03	fevereiro, 2019	março, 2021	Indexada a Gold Fix Price	5.412	5.412
Bank Millennium - BPW_2021/03A	fevereiro, 2019	março, 2021	Indexada às ações do Apple	3.654	3.654
Millennium Leasing - G12	fevereiro, 2019	fevereiro, 2021	Wibor 3m + 80 pb	8.173	8.173
Bank Millennium - BPW_2021/03B	março, 2019	março, 2021	Indexada ao índice DAX	2.029	2.029
Bank Millennium - BPW_2021/03C	março, 2019	março, 2021	Indexada a Gold Fix Price	6.667	6.667
Bank Millennium - BPW_2021/04	abril, 2019	abril, 2021	Indexada às ações da Volkswagen	1.768	1.768
Bank Millennium - BPW_2021/04A	abril, 2019	abril, 2021	Indexada a Gold Fix Price	6.993	6.993
Bank Millennium - BPW_2021/05A	maio, 2019	maio, 2021	Indexada ao índice DAX	2.224	2.224
Bank Millennium - BPW_2021/05B	maio, 2019	maio, 2021	Indexada a Gold Fix Price	6.260	6.260
Millennium Leasing - G13	maio, 2019	maio, 2022	Wibor 3m + 80 pb	9.408	9.408
Bank Millennium - BPW_2021/06	junho, 2019	junho, 2021	Indexada ao índice NDX	2.882	2.882
Bank Millennium - BPW_2021/06B	junho, 2019	junho, 2021	Indexada ao índice NDX	3.541	3.541
Bank Millennium - BPW_2021/07	julho, 2019	julho, 2021	Indexada à commodities	2.280	2.280
Bank Millennium - BPW_2021/07A	julho, 2019	julho, 2021	Indexada ao índice SXAP	2.883	2.883
EBK_011221C	dezembro, 2017	dezembro, 2021	Wibor 6m + 82 pb	58.799	58.799
					1.589.530
Periodificações					5.194
					1.594.724

A análise desta rubrica, excluindo as periodificações, pelo período remanescente das emissões, em 31 de dezembro de 2019, é a seguinte:

(Milhares de euros)

	2019					Total
	Inferior a três meses	Entre três e seis meses	Entre seis meses e um ano	Entre um e cinco anos	Superior a cinco anos	
Obrigações	18.019	75.225	72.451	144.109	-	309.804
Obrigações hipotecárias	-	-	-	995.976	-	995.976
Medium term notes (MTNs)	-	-	6.319	92.800	-	99.119
Securitizações	-	-	-	-	184.631	184.631
	18.019	75.225	78.770	1.232.885	184.631	1.589.530

A análise desta rubrica, excluindo as periodificações, pelo período remanescente das emissões, em 31 de dezembro de 2018, é a seguinte:

(Milhares de euros)

	2018					Total
	Inferior a três meses	Entre três e seis meses	Entre seis meses e um ano	Entre um e cinco anos	Superior a cinco anos	
Obrigações	74.027	15.466	39.561	181.110	-	310.164
Obrigações hipotecárias	-	-	-	994.347	-	994.347
Medium term notes (MTNs)	-	-	-	77.182	306	77.488
Securitizações	-	-	-	-	298.395	298.395
	74.027	15.466	39.561	1.252.639	298.701	1.680.394

35. Passivos subordinados

Esta rubrica é analisada como segue:

(Milhares de euros)

	2019	2018
Obrigações		
Não perpétuas	1.540.201	1.036.785
Perpétuas	22.035	27.021
	1.562.236	1.063.806
Periodificações	15.470	8.299
	1.577.706	1.072.105