

## 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
	<b>1.589.530</b>	<b>1.680.394</b>
Periodificações	5.194	5.693
	<b>1.594.724</b>	<b>1.686.087</b>

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
<b>Banco Comercial Português:</b>					
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 Epvm Sr 23	fevereiro, 2015	fevereiro, 2023	Taxa fixa de 2,65% - ativo subjacente - Brisa 022023	2.000	1.994
BCP 4.03 Maio 2021 Epvm 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 Smtn 3	dezembro, 2017	dezembro, 2020	Indexada a um cabaz de 3 ações	6.362	6.318
Bcp Mill Cabaz 3 Ações Fev 2021 Smtn 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 Smtn Sr 7	março, 2018	março, 2021	Indexada a um cabaz de 3 ações	24.336	24.336
Bcp Part Euro Ações Valor Iii/18 Smtn 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 Smtn 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 Smtn Sr.14	maio, 2018	maio, 2021	Indexada a um cabaz de 3 ações	790	790
Bcp Rend Min Cb Multi Set Iii19 Eur Smtn Sr 36	março, 2019	março, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	3.000	3.000
Bcp Euro Sectores Retorno Garantido Iv Smtn 37	maio, 2019	maio, 2022	Indexada a um cabaz de 3 índices	3.960	3.960
Bcp Ações Euro Zona Ret Min V19 Smtn 39	maio, 2019	maio, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	2.480	2.480
Bcp Rend Min Euro Setores Vi Smtn 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 Smtn Sr 43	julho, 2019	agosto, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	2.270	2.270
Bcp Cabaz Ações America Ret Min Out22 Smtn 45	outubro, 2019	outubro, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	1.610	1.610
Bcp Cabaz Ações Euro Retorno Min.Xii19 Smtn 46	dezembro, 2019	dezembro, 2022	Indexada a um cabaz de 3 ações	6.210	6.210
<b>BCP Finance Bank:</b>					
BCP Fin.Bank - EUR 10 M	março, 2004	março, 2024	Taxa fixa de 5,01%	300	305
<b>Magellan Mortgages n.º 3:</b>					
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
<b>Bank Millennium:</b>					
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
<b>Obrigações</b>		
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