

MODELO RC01

RISCO DE CONTRAPARTE

Parte I

 Individual

(Secção B do Anexo VI ao Aviso nº 7/96)

 Consolidado

Entidade: _____

Ano: _____

Mês: _____

Unidade: _____

A) TRANSACÇÕES INCOMPLETAS				
1. Coeficiente de ponderação da contraparte (1)	0%	20%	100%	TOTAL
2. Títulos pagos antecipadamente (2)				
3. Títulos entregues antecipadamente (3)				
4. Transacções internacionais incompletas (4)				
5. SOMA (2.+3.+4.)				
6. Valor ponderado (5.x1.)				
7. REQUISITOS F. PRÓPRIOS (8%x6.Total)				
B) "REPOS", "REPOS" INVERSOS E EMP. TÍTULOS				
8. Vendas com acordo de recompra (5)				
9. Concessão de empréstimos de títulos (6)				
10. Compras com acordo de revenda (7)				
11. Obtenção de empréstimo de títulos (8)				
12. SOMA (8.+9.+10.+11.)				
13. Valor ponderado (12. x 1.)				
14. REQUISITOS F. PRÓPRIOS (8%x13.Total)				
C) INST. DERIVADOS DO MERCADO DE BALCÃO				
15. Coeficiente de ponderação da contraparte (9)	0%	20%	50%	
C.1.) Contratos sobre taxas de juro (10)				
16. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo				
17. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo(11)				
18. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos				
19. Coeficiente de ponderação dos contratos	0,5%	0,5%	0,5%	
20. Risco de crédito potencial futuro (18.x19.)				
21. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos				
22. Coeficiente de ponderação dos contratos	1,5%	1,5%	1,5%	
23. Risco de crédito potencial futuro (21.x22.)				
24. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)				
25. Subtotal ponderado [(16.+17.+20.+23.+24.)x15.]				
C.2.) Contratos sobre taxas de câmbio e ouro (13)				
26. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo				
27. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo (11)				
28. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano				
29. Coeficiente de ponderação dos contratos	1%	1%	1%	
30. Risco de crédito potencial futuro (28.x29.)				
31. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos				
32. Coeficiente de ponderação dos contratos	5,0%	5,0%	5,0%	
33. Risco de crédito potencial futuro (31.x32.)				
34. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos				
35. Coeficiente de ponderação dos contratos	7,5%	7,5%	7,5%	
36. Risco de crédito potencial futuro (34.x35.)				
37. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)				
38. Subtotal ponderado [(26.+27.+30.+33.+36.+37.)x15.]				
C.3.) Contratos sobre títulos de capital (14)				
39. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo				
40. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo (11)				
41. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano				
42. Coeficiente de ponderação dos contratos	6%	6%	6%	
43. Risco de crédito potencial futuro (41.x42.)				
44. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos				
45. Coeficiente de ponderação dos contratos	8,0%	8,0%	8,0%	
46. Risco de crédito potencial futuro (44.x45.)				
47. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos				
48. Coeficiente de ponderação dos contratos	10,0%	10,0%	10,0%	
49. Risco de crédito potencial futuro (48.x47.)				
50. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)				
51. Subtotal ponderado [(39.+40.+43.+46.+49.+50.)x15.]				