

Anexo à Instrução nº 14/2001 (altera a Folha 36A do Anexo à Instrução nº 25/97)

RISCO DE CONTRAPARTE
Parte II

MODELO RC01

Individual

Consolidado

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

Entidade: _____

Ano: _____

Mês: _____

Unidade: _____

C) INST. DERIVADOS DO MERCADO DE Balcão (Continuação)				
52. Coeficiente de ponderação da contraparte (9)	0%	20%	50%	
C.4.) Contratos sobre metais preciosos com excepção do ouro (15)				
53. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo				
54. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo (11)				
55. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano				
56. Coeficiente de ponderação dos contratos	7%	7%	7%	
57. Risco de crédito potencial futuro (55.x56.)				
58. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos				
59. Coeficiente de ponderação dos contratos	7,0%	7,0%	7,0%	
60. Risco de crédito potencial futuro (58.x59.)				
61. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos				
62. Coeficiente de ponderação dos contratos	8,0%	8,0%	8,0%	
63. Risco de crédito potencial futuro (61.x62.)				
64. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)				
65. Subtotal ponderado [(53.+54.+57.+60.+63.+64.)x52.]				
C.5.) Contratos sobre mercadorias que não sejam metais preciosos (16)				
66. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo				
67. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo (11)				
68. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano				
69. Coeficiente de ponderação dos contratos	10%	10%	10%	
70. Risco de crédito potencial futuro (68.x69.)				
71. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos				
72. Coeficiente de ponderação dos contratos	12,0%	12,0%	12,0%	
73. Risco de crédito potencial futuro (71.x72.)				
74. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos				
75. Coeficiente de ponderação dos contratos	15,0%	15,0%	15,0%	
76. Risco de crédito potencial futuro (74.x75.)				
77. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)				
78. Subtotal ponderado [(66.+67.+70.+73.+76.+77.)x52.]				
79. Total ponderado de instrumentos derivados (25.+38.+51.+65.+78.)				
80. REQUISITOS DE F. PRÓPRIOS (8% x 79. Total)				
D) TRANSACÇÕES A PRAZO DE TÍTULOS				
81. Custo de substituição dos contratos (17)				
82. Valor ponderado (81.x1.)				
83. REQUISITOS DE F. PRÓPRIOS (8% x 82. Total)				
E) OUTROS				
84. Créditos (18)				
85. Valor ponderado (84.x1.)				
86. REQUISITOS DE F. PRÓPRIOS (8% x 85. Total)				
87. TOTAL DOS REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS PARA RISCO DE CONTRAPARTE (7.+14.+80.+83.+86.)				

Data da notificação ao Banco de Portugal:

a) do método a que se refere a parte final do ponto 6.3. da parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93

__/__/__.

b) da identificação das contrapartes e dos tipos de operações abrangidas pelos contratos de compensação (ponto 6.6. da parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93)

__/__/__.