

# Anexo à Instrução n.º 23/2007

<b>Banco de Portugal</b> EUROSISTEMA Departamento de Supervisão Bancária		<b>RISCO DE CONTRAPARTE</b> (Secção B do Anexo VI ao Aviso nº 7/96)			<b>MODELO RC01</b> Parte I
Instituição:	Base:	Ano:	Mês:		
<input type="checkbox"/> NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO					
					Valores em Euros
<b>A) TRANSAÇÕES INCOMPLETAS</b>					
1. Coeficiente de ponderação da contraparte (1)	0%	20%	100%	TOTAL	
2. Títulos ou mercadorias pagos antecipadamente (2)					
3. Títulos ou mercadorias entregues antecipadamente (3)					
4. Transações internacionais incompletas (4)					
5. SOMA (2.+3.+4.)					
6. Valor ponderado (5.x1.)					
7. REQUISITOS F. PRÓPRIOS (8% x6.Total)					
<b>B) "REPOS", "REPOS" INVERSOS E EMPRÉSTIMOS TÍTULOS OU DE MERCADORIAS</b>					
8. Coeficiente de ponderação da contraparte (1)	0%	20%	100%	TOTAL	
9. Vendas com acordo de recompra (5)					
10. Concessão de empréstimos de títulos ou de mercadorias (6)					
11. Compras com acordo de revenda (7)					
12. Obtenção de empréstimo de títulos ou de mercadorias (8)					
13. SOMA (8.+9.+10.+11.)					
14. Valor ponderado (12. x1.)					
15. REQUISITOS F. PRÓPRIOS (6% x13.Total)					
<b>C) INST. DERIVADOS DO MERCADO DE BALCÃO</b>					
16. Coeficiente de ponderação da contraparte (9)	0%	20%	50%	TOTAL	
<b>C.1.) Contratos sobre taxas de juro (10)</b>					
17. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo					
18. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo(11)					
19. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos					
20. Coeficiente de ponderação dos contratos	0,5%	0,5%	0,5%		
21. Risco de crédito potencial futuro (18.x19.)					
22. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos					
23. Coeficiente de ponderação dos contratos	1,5%	1,5%	1,5%		
24. Risco de crédito potencial futuro (21.x22.)					
25. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)					
26. Subtotal ponderado [(16.+17.+20.+23.+24.)x15.]					
<b>C.2.) Contratos sobre taxas de câmbio e ouro (13)</b>					
27. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo					
28. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo(11)					
29. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano					
30. Coeficiente de ponderação dos contratos	1%	1%	1%		
31. Risco de crédito potencial futuro (28.x29.)					
32. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos					
33. Coeficiente de ponderação dos contratos	5%	5%	5%		
34. Risco de crédito potencial futuro (31.x32.)					
35. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos					
36. Coeficiente de ponderação dos contratos	7,5%	7,5%	7,5%		
37. Risco de crédito potencial futuro (34.x35.)					
38. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)					
39. Subtotal ponderado [(26.+27.+30.+33.+36.+37.)x15.]					
<b>C.3.) Contratos sobre títulos de capital (14)</b>					
40. Custo de substituição dos contratos sem compensação com valor positivo					
41. Custo de substituição dos contratos com compensação com valor positivo(11)					
42. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano					
43. Coeficiente de ponderação dos contratos	6%	6%	6%		
44. Risco de crédito potencial futuro (41.x42.)					
45. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano e inferior ou igual a 5 anos					
46. Coeficiente de ponderação dos contratos	8%	8%	8%		
47. Risco de crédito potencial futuro (44.x45.)					
48. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 5 anos					
49. Coeficiente de ponderação dos contratos	10%	10%	10%		
50. Risco de crédito potencial futuro (48.x47.)					
51. Risco de crédito potencial futuro reduzido (12)					
52. Subtotal ponderado [(39.+40.+43.+46.+49.+50.)x15.]					