

RISCO DE CONTRAPARTE

 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%\times6.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%\times13.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				
17. Custo de substituição dos contratos com compensação (11)				
18. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano				
19. Coeficiente de ponderação dos contratos	0,5%	0,5%	0,5%	
20. Valor ponderado do montante teórico (18.x19.)				
21. Subtotal ponderado [(16.+17.+20.)x15.]				
C.2.) Contratos sobre taxas de câmbio (12)				
22. Custo de substituição dos contratos sem compensação				
23. Custo de substituição dos contratos com compensação (11)				
24. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano sem compensação				
25. Montante teórico dos contratos com prazo residual inferior ou igual a 1 ano com compensação (11)				
26. Coeficiente de ponderação dos contratos	1%	1%	1%	
27. Valor ponderado do montante teórico [(24.+25.)x26.]				
28. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano sem compensação				
29. Montante teórico dos contratos com prazo residual superior a 1 ano com compensação (11)				
30. Coeficiente de ponderação dos contratos	5%	5%	5%	
31. Valor ponderado do montante teórico [(28.+29.)x30.]				
32. Subtotal ponderado [(22.+23.+27.+31.)x15.]				
33. Total ponderado (21.+32.)				
34. REQUISITOS DE F. PRÓPRIOS (8%\times33.Total)				
D) TRANSACÇÕES A PRAZO DE TÍTULOS				
35. Custo de substituição dos contratos (13)				
36. Valor ponderado (35.x1.)				
37. REQUISITOS DE F. PRÓPRIOS (8%\times36. Total)				
E) OUTROS				
38. Créditos (14)				
39. Valor ponderado (38.x1.)				
40. REQUISITOS DE F. PRÓPRIOS (8% x 39. Total)				
41. TOTAL DOS REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS PARA RISCO DE CONTRAPARTE (7.+14.+34.+37.+40.)				