

Banco de Portugal

Carta-Circular nº 15/98/DSB, de 23-04-1998

ASSUNTO: Esclarecimentos sobre o preenchimento da Parte II do Modelo RX01, anexo à Instrução nº 25/97

No sentido de esclarecer dúvidas que têm sido colocadas sobre o preenchimento do modelo em epígrafe, informa-se o seguinte:

- a) na linha “2. Posição a deduzir” as instituições poderão incluir em primeira linha posições sujeitas a um nível de requisitos de fundos próprios mais exigente;
- b) os valores a considerar nas linhas “4. Posição compensada de moedas correlacionadas” e “5. Posição compensada de moedas incluídas em mecanismos de câmbios”, que servem de base ao cálculo dos requisitos de fundos próprios a que se referem as linhas 6.1. e 6.2., devem respeitar exclusivamente a posições incluídas na “Posição líquida global elegível” constante da linha 3 do referido modelo.

Enviada a:

Caixas Económicas, Caixa Central de Crédito Agrícola Mútuo, Sociedades de Investimento, Sociedades de Locação Financeira, Sociedades de Factoring, Sociedades Financeiras para Aquisições a Crédito, Sociedades Financeiras de Corretagem, Sociedades Corretoras, Sociedades Mediadoras dos Mercados Monetário ou de Câmbios, Sociedades Gestoras de Patrimónios, Caixas de Crédito Agrícola Mútuo (fora do SICAM) e Sociedades Gestoras de Participações Sociais.