

Banco de Portugal

Carta-Circular nº 29/98/DSB, de 12-10-1998

ASSUNTO: EMPRÉSTIMOS DE TÍTULOS (FUNDOS PRÓPRIOS PARA COBERTURA DO RISCO DE CRÉDITO/CONTRAPARTE)

Relativamente à ponderação do risco de crédito/contraparte subjacente a operações de empréstimo de valores mobiliários, para efeitos do disposto nos Avisos nºs 1/93 e 7/96, o Banco de Portugal esclarece o seguinte:

1. O mutuante de operações de empréstimo de títulos deverá, para efeitos do cálculo dos requisitos de fundos próprios para cobertura do risco de crédito (rácio de solvabilidade), ponderar o montante dos valores mobiliários cedidos pelo coeficiente de risco do respectivo emitente.
2. O mutuário da operação, atendendo à garantia prestada, deverá, para o mesmo efeito, ponderar o valor dos títulos dados em colateral pelo coeficiente de risco do respectivo emitente.
3. Para efeitos do cálculo dos requisitos de fundos próprios para cobertura do risco de contraparte (inscrito na carteira de negociação), o coeficiente de risco a atribuir à Bolsa de Derivados do Porto, quando a mesma intervenha nas operações a título de contraparte, será de 20%.

Enviada a:

Bancos, Caixa Geral de Depósitos, Caixa Económica Montepio Geral, Caixas Económicas, Caixa Central de Crédito Agrícola Mútuo, Caixas de Crédito Agrícola Mútuo, Sociedades de Investimento, Sociedades de Locação Financeira, Sociedades Financeiras para Aquisições a Crédito, Sociedades Corretoras, Sociedades Financeiras de Corretagem, Sociedades Gestoras de Patrimónios, Sociedades Mediadoras dos Mercados Monetário ou de Câmbios, Sucursais de IC's com sede na C.E. e Sucursais de IC's em países terceiros.