

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Banco de Portugal
EUROSISTEMA
Departamento de Supervisão Bancária

MODELO LM01

CÁLCULO DOS LIMITES PARA EFEITOS DO MÉTODO A UTILIZAR NA DETERMINAÇÃO DOS REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO (1)

(Artigo 8.º do Decreto-Lei n.º 103/2007)

Instituição: _____ Base: Saldo registado Ano: 2008 Mês: Dezembro

NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MODELO

Valores em Euros

RUBRICAS	VALOR MÉDIO (2)	VALOR MÁXIMO (3)
1. ACTIVIDADE DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO		
1.1. Posições (4)		
1.1.1. Instrumentos de dívida		
1.1.2. Títulos de capital		
1.1.3. Mercadorias		
1.1.4. Total das posições (1.1.1.+1.1.2.+1.1.3.)		
1.2. Riscos (5)		
1.2.1. Risco de liquidação/entrega		
1.2.2. Transacções incompletas		
1.2.3. Risco de crédito de contraparte		
1.2.4. Total dos riscos (1.2.1.+1.2.2.+1.2.3.)		
1.3. Total da actividade da carteira de negociação (1.1.+1.2.)		
2. ACTIVIDADE GLOBAL (6)		
2.1. Activo líquido		
2.2. Passivo		
2.3. Elementos extrapatrimoniais considerados para efeitos do rácio de solvabilidade		
2.4. Total da actividade global (2.1.+2.2.+2.3.)		
3. CÁLCULO DOS LIMITES A QUE SE REFERE O NÚMERO 2 DO ARTIGO 8.º DO DECRETO-LEI N.º 103/2007		
3.1. 5% DA ACTIVIDADE GLOBAL [2.4 (valor médio) x 5%]		
3.2. 6% DA ACTIVIDADE GLOBAL [2.4 (valor máximo) x 6%]		

4. Existência de ultrapassagens aos limites indicados nas alíneas a) e b) do número 2 do artigo 8.º do DL n.º 103/2007 por um período superior a 15 dias _____

5. Valor máximo registado pelas posições da carteira de negociação no período (7) _____

6. POR MEMÓRIA

6.1. Valor médio de 3.1. - valor médio de 1.3.	
6.2. Diferença entre 15 milhões de euros e o valor médio de 1.1.4.	
6.3. Valor máximo de 3.2. - valor máximo de 1.3.	
6.4. Diferença entre 20 milhões de euros e o valor máximo de 1.1.4. ou de 5.	