

Modelo RL01

- (1) Não inclui as vendas com acordo de recompra, as compras com acordo de revenda e as operações de concessão e de obtenção de empréstimo de valores mobiliários ou mercadorias (ponto 2, Secção I, Parte 1, do Anexo IV do Aviso n.º 8/2007).
- (2) Os valores a considerar são as diferenças entre o preço de liquidação acordado e o valor de mercado dos instrumentos, se essas diferenças puderem envolver perdas para a instituição (pontos 3 e 5, Secção I, Parte I, do Anexo IV do Aviso n.º 8/2007).
- (3) Período entre a data em que a transacção é efectuada e o final do 4.º dia útil após a data acordada para a liquidação. Os valores a inscrever na linha 1.1 devem ser inscritos já multiplicados pela ponderação de risco aplicável à contraparte (ponto 3, Secção I, Parte 1, do Anexo IV do Aviso n.º 8/2007).

O requisito a calcular para este prazo não se aplica às transacções efectuadas, por conta própria, em bolsas reconhecidas que disponham de um sistema de compensação e liquidação que garanta a realização das operações, nem às transacções efectuadas nessas bolsas, salvo se, neste caso, a diferença apurada puder envolver uma perda em caso de eventual incumprimento do cliente por conta do qual a operação é efectuada.