

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Modelo LM01

- (1) Na avaliação dos instrumentos financeiros, para efeitos do presente quadro, devem ser utilizados os critérios valorimétricos previstos no n.º 4, do artigo 8.º do Decreto-Lei n.º 103/2007.
- (2) Nesta coluna devem ser inscritos os valores médios dos últimos seis meses, para cada uma das rubricas, calculados com base em valores de fim de mês.
- (3) Nesta coluna devem ser inscritos, relativamente a cada rubrica, os valores respeitantes à actividade da carteira de negociação e à actividade global apurados no dia em que a relação “total da actividade da carteira de negociação/total da actividade global” registou o seu valor mais elevado, nos 6 meses anteriores à data a que se refere o reporte.
- (4) Compreende as posições da carteira de negociação a que se referem os Anexos II e VI do Aviso n.º 8/2007.
- (5) Compreende os riscos e as transacções a que se refere o Anexo IV do Aviso n.º 8/2007.
- (6) Para efeitos do disposto no n.º 3, do artigo 8.º do Decreto-Lei n.º 103/2007, a actividade global, em relação à qual se avalia o valor relativo da carteira de negociação, corresponde à soma do total do activo líquido com o total do passivo e com os elementos extrapatrimoniais considerados para efeitos do rácio de solvabilidade.
- (7) Preencher apenas no caso do valor mais elevado registado pelas posições da carteira de negociação não coincidir com o valor de 1.1.4. inscrito na coluna (3). Caso coincida, não preencher.