

Modelo TC01

- (1) A rubrica 1.1. compreende futuros sobre índices de acções largamente diversificados, conforme previsto no ponto 11 da Secção III-C da Parte 2 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (2) As rubricas 1.2. e 1.4. incluem:
 - acções, qualquer que seja a sua categoria, títulos de participação, outros valores habitualmente negociados que confirmam o direito à aquisição de títulos de capital por subscrição ou troca, ou que dêem origem a uma liquidação em dinheiro e outros títulos de rendimento variável cujo comportamento, em termos de mercado, seja assimilável ao das acções;
 - compras e vendas a prazo de títulos de capital;
 - opções sobre títulos de capital, incluindo "warrants", as quais devem ser tratados como posições com um valor igual ao do montante do instrumento subjacente multiplicado pelo respectivo delta;
 - posições que resultarem da decomposição dos futuros sobre índices de acções e de opções sobre futuros de índices de acções e sobre índices de acções, ambas ponderadas em função do respectivo delta, a que se refere o ponto 9 da Secção III-C da Parte 2 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (3) A rubrica 1.3. compreende futuros sobre índices de acções que não sejam decompostos nas suas posições subjacentes e opções sobre futuros de índices de acções e sobre índices de acções ponderadas em função do delta, igualmente não decompostas, conforme previsto no ponto 10 da Secção III-C da Parte 2 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (4) 2.1. = 1.2.
2.2. = 1.3. + 1.4.
- (5) Compreende as posições em Organismos de Investimento Colectivo (OIC) que estejam na carteira de negociação, cujos requisitos sejam calculados de acordo com o primeiro período do ponto 20 da Secção VI da Parte 2 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007, os quais apenas são reportados neste modelo, ou de acordo com o ponto 27 da Secção VI-B da mesma Parte.
- (6) Compreende as posições em futuros e opções vendidas sobre títulos de capital ou sobre índice de acções, negociados em bolsa, cujos requisitos de fundos próprios sejam determinados em conformidade com o método descrito nos subpontos 5.5. e 6.4., respectivamente, da Secção II da Parte 1 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (7) Compreende as posições em contratos a prazo e opções vendidas sobre títulos de capital ou sobre índice de acções, negociados em mercado de balcão e compensados por uma câmara de compensação reconhecida, cujos requisitos de fundos próprios sejam determinados em conformidade com o método descrito nos subpontos 5.6. e 6.5., respectivamente, da Secção II da Parte 1 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (8) Compreende as posições em opções adquiridas sobre títulos de capital ou sobre índice de acções, cujos requisitos de fundos próprios sejam determinados em conformidade com o método descrito no subponto 6.6 da Secção II da Parte 1 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (9) Os valores a inscrever nas colunas 1 e 2 compreendem a totalidade das posições longas e curtas em títulos de capital e incluem, entre outras posições, as resultantes de operações de tomada firme de títulos de capital após a dedução prevista no subponto 13.1 da Secção IV da Parte 2 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007, mas antes da redução estabelecida no subponto 13.2 dessa mesma Secção.

- (10) Os valores a inscrever na coluna 3 correspondem ao efeito de redução previsto no subponto 13.2. da Secção IV da Parte 2 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007.
- (11) Os valores a inscrever nas colunas 4 e 5 compreendem as posições líquidas em títulos de capital, apuradas em conformidade com o disposto na Secção I da Parte 1 do Anexo II do Aviso n.º 8/2007. Incluem, entre outras posições, as resultantes de operações de tomada firme de títulos de capital após a dedução prevista no subponto 13.1 da Secção IV da Parte 2 do Anexo II do referido diploma e a redução estabelecida no subponto 13.2 dessa mesma Secção.
- (12) Esta coluna compreende os requisitos de fundos próprios apurados para risco de posição em instrumentos de dívida.