

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Modelo ME02

No preenchimento deste modelo de reporte, as posições em mercadorias devem ser multiplicadas pelo preço à vista. Os valores a considerar no presente modelo são o contravalor em euros da divisa em referência.

- (1) Os valores a inscrever nas colunas 1 e 2 compreendem a totalidade das posições longas e curtas (ilíquidas) em mercadorias, incluindo, entre outras posições, as que constituem financiamento de existências.
- (2) O conceito de financiamento de existências é o que se encontra definido na alínea m), do artigo 3.º do Decreto-Lei n.º 103/2007.
- (3) Os valores a inscrever nas colunas 5 e 6 correspondem às posições relativas a uma mesma mercadoria, apuradas de acordo com o ponto 3., da Parte 3, do Anexo VI do Aviso n.º 8/2007, depois de deduzidas as posições que constituem financiamento de existências.
- (4) A coluna 7 compreende as posições longas que sejam compensadas com posições curtas, relativamente a cada intervalo de prazo de vencimento.
- (5) A posição remanescente (não compensada), em cada intervalo de vencimento, é incluída na coluna 8 ou 9, consoante for longa ou curta.
- (6) Na coluna 10 são incluídas as posições relevantes para o cálculo de requisitos de fundos próprios. Na rubrica 1. são incluídas as posições compensadas num mesmo intervalo de vencimento (total da coluna 7) e nas rubricas 2. a 7. são incluídas as posições compensadas entre intervalos de vencimentos diferentes. A posição remanescente (não compensada) é incluída na rubrica 8.