

## Anexo à Instrução n.º 23/2007

### Modelo ME04

Este modelo agrega as posições e os requisitos de fundos próprios relativos a risco de mercadorias.

No seu preenchimento, 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 de referência.

- (1) Agrega as posições em mercadorias e os requisitos de fundos próprios que lhe estão associados, quando esses requisitos são apurados através do método da Escala de Prazos de Vencimento.
- (2) Agrega as posições em mercadorias e os requisitos de fundos próprios que lhe estão associados, quando esses requisitos são apurados através do método Simplificado.
- (3) Compreende as posições em futuros e opções vendidas sobre mercadorias, negociados em bolsa, cujos requisitos de fundos próprios sejam determinados em conformidade com o método descrito nos pontos 6. e 8., respectivamente, da Parte 2, do Anexo VI do Aviso n.º 8/2007.
- (4) Compreende as posições em contratos a prazo e opções vendidas sobre mercadorias, 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 pontos 7. e 9., respectivamente, da Parte 2, do Anexo VI do Aviso n.º 8/2007.
- (5) Compreende as posições em opções adquiridas sobre mercadorias, cujos requisitos de fundos próprios sejam determinados em conformidade com o método descrito no ponto 10., da Parte 2, do Anexo VI do Aviso n.º 8/2007.
- (6) Os valores a inscrever nas colunas 1 e 2 compreendem a totalidade das posições longas e curtas em mercadorias, incluindo, entre outras posições, as que constituem financiamento de existências.
- (7) 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.
- (8) Os valores compreendidos nas colunas 5 e 6 correspondem ao acumulado das posições líquidas em mercadorias, depois de deduzidas as posições que constituem financiamento de existências. No caso da rubrica 1, os valores compreendidos nestas colunas correspondem a posições apuradas de acordo com o ponto 3., da Parte 3, do Anexo VI do Aviso n.º 8/2007.
- (9) Os valores a inscrever nesta coluna compreendem as posições que, ao nível de cada rubrica deste modelo de reporte, são as relevantes para a determinação de requisitos de fundos próprios para risco de mercadorias. No caso das rubricas 3 a 5, esses valores correspondem à soma entre as posições longas e curtas compreendidas nas colunas 5 e 6.
- (10) Esta coluna compreende a totalidade dos requisitos de fundos próprios apurados para risco de mercadorias.