

Modelo RX01

O presente modelo deve ser preenchido utilizando o contravalor em euros de cada uma das moedas. As unidades monetárias compósitas podem ser tratadas como divisas autónomas ou serem decompostas nas quantidades de moedas integrantes, nos termos do ponto 5, do anexo V do Aviso n.º 8/2007. Em documento anexo ao presente modelo de reporte, a entidade declarante deve indicar o procedimento adoptado.

- (1) As colunas 1 e 2 compreendem o total de posições longas e de posições curtas (líquidas), à vista e a prazo, apuradas por divisa. As posições longas, a inscrever na coluna 1, compreendem os elementos positivos previstos no ponto 1, do Anexo V do Aviso n.º 8/2007. As posições curtas, a inscrever na coluna 2, compreendem os elementos negativos previstos nesse mesmo ponto, designadamente, passivos e valores a pagar em moeda estrangeira. Em base consolidada, os valores a inscrever nestas colunas compreendem também as posições que, nos termos do artigo 12.º do Decreto-Lei n.º 103/207, não possam ser objecto de compensação.
- (2) As colunas 3 e 4 compreendem as posições previstas no ponto 3, do Anexo V do Aviso n.º 8/2007 que, tendo a devida autorização do Banco de Portugal, são excluídas do cálculo das posições abertas.
- (3) As colunas 5 e 6 apenas se aplicam à prestação de informação em base consolidada. Compreendem as posições líquidas, apuradas entidade a entidade, que, nos termos do artigo 12.º do Decreto-Lei n.º 103/207, não possam ser objecto de compensação com as posições das demais instituições sujeitas à mesma supervisão em base consolidada.
- (4) Em base individual, as colunas 7 e 8 compreendem o valor da posição líquida em cada divisa, resultante da diferença entre as posições longas e as posições curtas, após a eventual dedução das posições estruturais inscritas nas colunas 3 e 4. Em base consolidada, para as instituições que estejam autorizadas a proceder à compensação de posições a que se refere o artigo 12.º do Decreto-Lei n.º 103/207, o procedimento é idêntico ao descrito para a base individual, considerando-se o conjunto dessas instituições como se tratasse de uma só entidade. Para as instituições que não possam proceder à referida compensação, as respectivas posições, inscritas nas colunas 5 e 6, são adicionadas às posições de idêntica natureza do conjunto das entidades cujas posições foram compensadas.