

Anexo à Instrução n.º 23/2007

Modelo RX02

O presente modelo deve ser preenchido utilizando o contravalor em euros de cada uma das moedas.

- (1) $1. = 1.1. + 1.2. + 1.3. + 1.4.$
- (2) Nos termos do subponto 8.2., do Anexo V do Aviso n.º 8/2007.
- (3) Nos termos do subponto 8.1., do Anexo V do Aviso n.º 8/2007.
- (4) Inclui, entre outras, as posições em OIC tratadas como divisas autónomas, nos casos abrangidos pelo segundo período do subponto 4.3, do Anexo V do Aviso n.º 8/2007.
- (5) Compreende as posições em OIC tratadas como divisas autónomas, enquadradas no primeiro período do subponto 4.3., do Anexo V do Aviso n.º 8/2007, isto é, quando não sejam conhecidas as posições, longa e curta, totais.
- (6) As colunas 1 e 2 compreendem o total de posições longas e de posições curtas (ilíquidas), 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 103/2007, não possam ser objecto de compensação.
- (7) 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. As autorizações concedidas pelo Banco de Portugal, ao abrigo desta disposição, devem ser expressamente indicadas em documento anexo ao presente Modelo.
- (8) Em base individual, as colunas 5 e 6 compreendem as posições líquidas resultantes da diferença entre as posições longas e as posições curtas, após a eventual dedução das posições estruturais inscritas nas colunas 3 e 4. As posições líquidas são apuradas por divisa e, portanto, podem haver posições inscritas nas colunas 5 e 6, em simultâneo. 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 103/2007, 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, são adicionadas às posições de idêntica natureza do conjunto das entidades cujas posições foram compensadas.

Deve-se verificar a seguinte igualdade:

 $1.1 + 1.2. + 1.3. - 4. \text{ da coluna 5 do modelo RX02} = \text{Total da coluna 7 do modelo RX01}$
 $1.1 + 1.2. + 1.3. - 4. \text{ da coluna 6 do modelo RX02} = \text{Total da coluna 8 do modelo RX01}$
- (9) A posição líquida global em divisas corresponde ao máximo entre o somatório das posições líquidas longas das rubricas 1.1. a 1.3. (inscritas na coluna 5) e o somatório das posições líquidas curtas das rubricas 1.1. a 1.3. (inscritas na coluna 6), adicionado da posição líquida em ouro.
- (10) As posições não compensadas em divisas que estejam nas condições previstas nas rubricas 1.1. e 1.2. são incluídas na rubrica 1.3., para efeitos de determinação de requisitos de fundos próprios.

(11) Esta coluna compreende a totalidade dos requisitos de fundos próprios apurados para riscos cambiais.