

MODELO ID02

Os valores a considerar no presente modelo serão o contravalor em escudos da divisa de referência.

- (1) A soma das posições líquidas, para os vários instrumentos, deve ser inscrita na coluna II ou III consoante seja, respectivamente, longa ou curta, e imputada de acordo com os intervalos de prazo de vencimento adequado. No caso dos instrumentos de taxa de juro fixa é considerado o prazo residual, enquanto nos instrumentos com taxa de juro variável se considera o prazo a decorrer até à refixação da taxa de juro [n.º 16.2.1, do Anexo V]. Nas operações de tomada firme de instrumentos de dívida deve ser tomada em consideração a dedução prevista no n.º 23.1 do Anexo V e a redução estabelecida no n.º 23.2 do mesmo Anexo.
- (2) Os valores das colunas IV e V resultam da multiplicação dos valores da coluna I pelos valores das colunas II e III, respectivamente [n.º 16.2.2, do Anexo V].
- (3) Para cada intervalo e dentro de cada zona, inscreve-se na coluna VI o montante das posições longas ponderadas que for compensado pelas posições curtas ponderadas. O remanescente deverá ser inscrito na coluna VII ou VIII, caso a posição ponderada não compensada seja, respectivamente, longa ou curta. Deverá, em seguida, proceder-se ao cálculo dos subtotais em cada uma das zonas e, por último, à soma das posições ponderadas compensadas de todos os intervalos, inscrevendo este último valor na linha do total da respectiva coluna [n.ºs 16.2.4 a 16.2.6, do Anexo V].
- (4) Na coluna IX, deve inscrever-se, para cada zona - na linha do respectivo subtotal - o montante da posição longa ponderada não compensada [subtotal da coluna VII] que for compensada pela posição curta ponderada não compensada [subtotal da coluna VIII]. O remanescente, caso exista, deverá ser inscrito na coluna X ou XI, consoante diga respeito, respectivamente, a uma posição longa ou curta [n.º 16.2.6, do Anexo V].
- (5) Caso haja posições não compensadas «de sinal contrário» nas zonas um e dois, deve inscrever-se na coluna XII o montante da posição longa (+) de uma zona que é compensado pela posição curta (-) de outra zona, na linha do subtotal da zona com a posição longa. Para ambas as zonas, deve ainda proceder-se ao cálculo do remanescente, ou seja da posição não compensada, e inscrevê-lo (na linha do subtotal) na coluna XIII ou XIV, respectivamente, se essa posição não compensada for longa ou curta [n.º 16.2.7, do Anexo V].
- (6) Caso haja posições não compensadas «de sinal contrário» entre o remanescente da zona dois e a zona três, deve inscrever-se na coluna XV o montante da posição longa (+) de uma zona que é compensado pela posição curta (-) de outra zona, na linha do subtotal da zona com a posição longa. Para ambas as zonas, deve ainda proceder-se ao cálculo do remanescente, ou seja da posição não compensada, e inscrevê-lo (na linha do subtotal) na coluna XVI ou XVII, respectivamente, se essa posição não compensada for longa ou curta [n.º 16.2.8, do Anexo V].
- (7) Caso haja posições não compensadas «de sinal contrário» entre os remanescentes das zonas um e três, deve inscrever-se na coluna XVIII o montante da posição longa (+) de uma zona que é compensado pela posição curta (-) de outra zona, na linha do subtotal da zona com a posição longa. Para ambas as zonas, deve ainda proceder-se ao cálculo do remanescente, ou seja da posição não compensada, e inscrevê-lo (na linha do subtotal) na coluna XIX ou XX, respectivamente, se essa posição não compensada for longa ou curta [n.º 16.2.9, do Anexo V].
- (8) As posições residuais, a inscrever nos subtotais da coluna XXI, são as inscritas nas colunas XVI ou XVII, no caso da zona dois, ou nas colunas XIX ou XX, nos casos das zonas um e três. Por último procede-se à sua soma, na linha do total da coluna XXI [n.º 16.2.10, do Anexo V].

O valor a inscrever na coluna I da Parte II é:

- (9) o total da coluna VI da Parte I deste modelo;
- (10) o subtotal da zona um, inscrito na coluna IX da parte I deste modelo;
- (11) o subtotal da zona dois, inscrito na coluna IX da parte I deste modelo;
- (12) o subtotal da zona três, inscrito na coluna IX da parte I deste modelo;
- (13) o inscrito na coluna XII da parte I deste modelo;
- (14) o inscrito na coluna XV da parte I deste modelo;
- (15) o inscrito na coluna XVIII da parte I deste modelo;
- (16) o total da coluna XXI da parte I deste modelo.
- (17) Os valores da coluna III resultam da multiplicação dos valores inscritos na coluna I pela ponderação inscrita na coluna II.