

Anexo à Instrução nº 25/97

MODELO ID03

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

- (1) Para cada zona o valor a inscrever será o somatório, para todos os instrumentos, do produto da alteração presumível da taxa de juro, pela duração modificada e pelo valor de mercado [n.º 16.3.4, 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) Na coluna III deve inscrever-se, para cada zona, o montante da posição longa ponderada que for compensada pela posição curta ponderada. O remanescente, caso exista, deverá ser inscrito na coluna IV ou V, consoante diga respeito, respectivamente, a uma posição longa ou curta [n.ºs 16.3.5 e 16.3.6, do Anexo V].
- (3) Caso haja posições não compensadas «de sinal contrário» nas zonas um e dois, deve inscrever-se na coluna VI o montante da posição longa (+) de uma zona que é compensado pela posição curta (-) de outra zona, na 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 coluna VII ou VIII, respectivamente, se essa posição não compensada for longa ou curta [n.º 16.3.7, do Anexo V].
- (4) Caso haja posições não compensadas «de sinal contrário» entre o remanescente da zona dois e a zona três, deve inscrever-se na coluna IX o montante da posição longa (+) de uma zona que é compensado pela posição curta (-) de outra zona, na 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 coluna X ou XI, respectivamente, se essa posição não compensada for longa ou curta [n.º 16.3.7, do Anexo V].
- (5) Caso haja posições não compensadas «de sinal contrário» entre os remanescentes das zonas um e três, deve inscrever-se na coluna XII o montante da posição longa (+) de uma zona que é compensado pela posição curta (-) de outra zona, na 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 coluna XIII ou XIV, respectivamente, se essa posição não compensada for longa ou curta [n.º 16.3.7, do Anexo V].
- (6) As posições residuais, a inscrever na coluna XV, são as inscritas nas colunas X ou XI, no caso da zona dois, ou nas colunas XIII ou XIV, nos casos das zonas um e três. Por último procede-se à sua soma, na linha do total da coluna XV [n.º 16.3.7, do Anexo V].

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

- (7) o correspondente à linha da zona um inscrito na coluna III da parte I deste modelo;
- (8) o correspondente à linha da zona dois inscrito na coluna III da parte I deste modelo;
- (9) o correspondente à linha da zona três inscrito na coluna III da parte I deste modelo;
- (10) o inscrito na coluna VI da parte I deste modelo;
- (11) o inscrito na coluna IX da parte I deste modelo;
- (12) o inscrito na coluna XII da parte I deste modelo;

- (13) o total da coluna XV da parte I deste modelo.
- (14) Os valores da coluna III resultam da multiplicação dos valores inscritos na coluna I pelas ponderações inscritas na coluna II.