

Anexo à Instrução n.º 25/97

MODELO RL01

- (1) Não inclui as vendas com acordo de recompra, as compras com acordo de revenda e as operações de empréstimo de valores mobiliários [n.º 2 do Anexo VI].
- (2) Os valores a considerar são as diferenças entre o preço de liquidação acordado e o valor de mercado dos instrumentos, se essas diferenças puderem envolver perdas para a instituição [n.º3 do anexo VI].
- (3) Nesta célula deve ser inscrita a soma dos valores relativos às colunas I a IV constantes da linha 5.
- (4) Este método só poderá ser utilizado mediante prévio acordo do Banco de Portugal. Neste caso nas linhas 6. e 7. deverão ser considerados os preços de cada transacção para os períodos indicados nas colunas I a III. A partir do 46º dia (coluna IV) devem ser consideradas as diferenças entre o preço de liquidação acordado e o valor de mercado dos instrumentos, se essas diferenças puderem envolver perdas para a instituição [n.º 4 do Anexo VI].
- (5) Nesta célula deve ser inscrito o somatório dos valores relativos às colunas I a IV constantes da linha 10.