

## **Anexo à Instrução n.º 25/97**

### **MODELO LM01**

(1) Na avaliação dos instrumentos financeiros, para efeitos do presente quadro, devem ser utilizados os critérios valorimétricos previstos nas alíneas a), b) e c) do ponto 3 do n.º 6º do Aviso n.º 7/96.

(2) Incluir o valor médio dos últimos seis meses, calculado com base em valores de fim de mês.

(3) Na parte 1 e 2 do quadro deverão ser inscritos os valores respeitantes à actividade da carteira de negociação e à actividade global apurados no dia em que a relação “total da actividade da carteira de negociação/total da actividade global” registou o seu valor mais elevado, nos últimos 6 meses.

Na linha 3.3. deverá ser inscrito o contravalor em escudos de 15 milhões de ECUS, utilizando o câmbio médio dos últimos seis meses, calculado com base nos valores de fim de mês.

Na linha 3.4. deverá ser inscrito o contravalor em escudos de 20 milhões de ECUS, utilizando o câmbio do dia em que o total das posições atingiram o valor mais elevado.

(4) Posições definidas no ponto 1.1. do Anexo II do Aviso n.º 7/96.

(5) Compreende:

- acções e outros valores equivalentes a acções,

- obrigações e outros títulos de dívida

negociáveis no mercado de capitais e

- quaisquer outros valores habitualmente negociados que confirmem o direito à aquisição desses valores mobiliários por subscrição ou troca ou que dêem origem a uma liquidação em dinheiro,

com exclusão dos meios de pagamento.

(6) Compreende as categorias de instrumentos habitualmente negociados no mercado monetário.

(7) Riscos definidos no ponto 1.2. do Anexo II do Aviso n.º 7/96.

(8) Transacções a que se refere a Secção A do Anexo VI do Aviso n.º 7/96. O valor a considerar será o preço da transacção.

(9) Transacções a que se refere a Subsecção I da Secção B do Anexo VI do Aviso n.º 7/96. O valor a considerar será o dos títulos ou da importância em dívida.

(10) Instrumentos a que se refere a Subsecção III da Secção B do Anexo VI do Aviso n.º 7/96. O valor a considerar será o que resultar da aplicação de um dos métodos indicados no ponto 3.2. da Parte I do Anexo ao Aviso n.º 1/93, sem a aplicação das ponderações de risco.

- (11) Operações a que se refere a alínea a) do ponto 7 do Anexo VI do Aviso n.º 7/96, quando os títulos forem abrangidos pelo ponto 1.1. do Anexo II do mesmo Aviso. O valor a considerar será a diferença entre o valor de mercado dos títulos e o montante obtido pela instituição ou o valor de mercado da caução, se aquela diferença for positiva.
- (12) Operações a que se refere a alínea b) do ponto 7 do Anexo VI do Aviso n.º 7/96, que estejam nas condições da alínea c) do ponto 1.2. do Anexo II do mesmo Aviso. O valor a considerar será a diferença entre o montante entregue pela instituição ou o valor de mercado da caução e o valor de mercado dos títulos por ela recebidos, se aquela diferença for positiva.
- (13) Créditos referidos no ponto 1.3. do Anexo II do Aviso n.º 7/96.
- (14) No caso do valor mais elevado registado pelas posições da carteira de negociação não coincidir com o valor de 1.1.8. inscrito na coluna (3). Caso coincida, não preencher.