

Anexo à Instrução n.º 32/2001

De acordo com o estabelecido no **art.º 13.º da Lei Orgânica do Banco de Portugal (Lei n.º 5/98 de 31 de Janeiro)** e em conformidade com o previsto no Dec.-Lei n.º 13/90 de 8 de Janeiro, designadamente nos artigos 10.º, 11.º e 12.º e respectivos Avisos, podem as entidades autorizadas a exercer o comércio de câmbios (E.A.) realizar operações de compra e venda de moeda estrangeira (à vista e a prazo), Swaps, Opções e Futuros, entre si e com clientes, residentes e não residentes, negociando livremente as respectivas taxas de câmbio e outros encargos. É também estabelecido nos mesmos diplomas que as E.A. devem prestar ao Banco de Portugal os elementos informativos respeitantes às operações cambiais realizadas. Nestes termos, deverão as E.A. passar a observar as seguintes instruções.

1. ACTUAÇÃO DO BANCO DE PORTUGAL

- 1.1.** O Banco de Portugal poderá realizar intervenções no mercado cambial, de acordo com as instruções, e por conta do BCE, incluindo as efectuadas no âmbito do Mecanismo de Taxa de Câmbio – MTC2.
- 1.2.** O Banco de Portugal divulgará diariamente, a título informativo, cerca das 13,30 horas, as taxas de câmbio de referência do Euro da responsabilidade do Banco Central Europeu. O Banco de Portugal poderá estabelecer e divulgar taxas de câmbio de referência do Euro, para um conjunto adicional de moedas.
- 1.3.** As confirmações das operações acordadas com o Banco de Portugal deverão processar-se no prazo máximo de 24 horas, podendo para o efeito ser utilizadas as vias Swift, Telex ou Carta.
- 1.4.** As contrapartidas em Euros da moeda estrangeira transaccionada pelas E.A. intervenientes no mercado interbancário de câmbios, poderão ser liquidadas nas contas abertas no Banco de Portugal em nome das E.A. intervenientes, de acordo com os procedimentos aplicáveis às duas categorias de depositantes do Banco – participantes no SPGT e Outros depositantes.

2. INQUÉRITO ANUAL À ACTIVIDADE NOS MERCADOS DE CÂMBIOS E DE PRODUTOS DERIVADOS

- 2.1.** As entidades autorizadas a exercer o comércio de câmbios (E.A.) devem, anualmente (em Março/Abril), responder ao inquérito do Banco de Portugal sobre:
 - as transacções efectuadas pela E.A. nos mercados cambial e de derivados sobre taxas de juro durante o mês de Abril;
 - os montantes das posições em aberto nas carteiras de produtos derivados, detidos no último dia útil do mês de Março;
 - a avaliação dos custos e proveitos potenciais associados às posições em aberto, em produtos derivados, detidas no último dia útil do mês de Março.
- 2.2.** O tipo de informação a enviar ao Banco de Portugal, bem como a forma e o formato do seu envio, constam do Manual do Utilizador distribuído às E.A.
- 2.3.** Os dados relativos ao inquérito devem ser enviados ao Departamento de Mercados e Gestão de Reservas (Núcleo de Análise e Acompanhamento de Mercados) do Banco de Portugal, nos 15 dias após o último dia do mês de Abril.
- 2.4.** O disposto na presente Instrução entra em vigor em 1 de Janeiro de 2002.