

**CÁLCULO DOS LIMITES PARA EFEITOS DO MÉTODO A UTILIZAR NA
DETERMINAÇÃO DOS REQUISITOS DE FUNDOS PRÓPRIOS DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO (1)**
(N.º 3.º do Aviso nº 7/96)

Instituição:	Base:	Ano:
		Mês:

☐ NÃO EXISTEM VALORES A REPORTAR PARA ESTE MAPA

Valores em Euros

RUBRICAS	VALOR MÉDIO (2)	VALOR MÁXIMO (3)
1. ACTIVIDADE DA CARTEIRA DE NEGOCIAÇÃO		
1.1. Posições (4)		
1.1.1. Valores mobiliários (5)		
1.1.2. Instrumentos do mercado monetário (6)		
1.1.3. Futuros sobre instrumentos financeiros		
1.1.4. Transacções a prazo de títulos		
1.1.5. Contratos a prazo de taxas de juro		
1.1.6. Swaps		
1.1.7. Opções		
1.1.8. Mercadorias e instrumentos derivados sobre mercadorias		
1.1.9. Total das posições (1.1.1.+ ... +1. 1.8.)		
1.2. Riscos (7)		
1.2.1. Transacções por liquidar (8)		
1.2.2. Transacções incompletas (9)		
1.2.3. Instrumentos derivados do mercado de balcão (10)		
1.2.4. Vendas com acordo de recompra (11)		
1.2.5. Concessão de empréstimo de títulos ou de mercadorias (11)		
1.2.6. Compras com acordo de revenda (12)		
1.2.7. Obtenção de empréstimos de títulos ou de mercadorias (12)		
1.2.8. Total dos riscos (1.2.1.+...+1.2.7.)		
1.3. Créditos (13)		
1.4. Total da actividade da carteira de negociação (1.1.+1.2.+1.3.)		
2. ACTIVIDADE GLOBAL		
2.1. Activo líquido		
2.2. Passivo		
2.3. Elementos extrapatrimoniais considerados para efeitos do rácio de solvabilidade		
2.4. Instrumentos derivados negociados em mercados organizados sujeitos a exigência de margem		
2.5. Outros derivados não incluídos nos pontos 2.3. e 2.4.		
2.6. Total da actividade global (2.1.+ ... + 2.5.)		
3. CÁLCULO DOS LIMITES A QUE SE REFERE O N.º 6.º DO AVISO Nº 7/96		
3.1. 5% DA ACTIVIDADE GLOBAL [2.6 (valor médio) x 5%]		
3.2. 6% DA ACTIVIDADE GLOBAL [2.6 (valor máximo) x 6%]		

4. Existência de ultrapassagens aos limites indicados nas alíneas i) ou ii) do ponto 1 do n.º 6.º por um período superior a 15 dias	☐ SIM ☐ NÃO
---	--

5. Valor máximo registado pelas posições da carteira de negociação no período (14)	
--	--

6. POR MEMÓRIA	
6.1. Valor médio de 3.1. - valor médio de 1.4.	
6.2. Diferença entre 15 milhões de euros e o valor médio de 1.1.9.	
6.3. Valor máximo de 3.2. - valor máximo de 1.4.	
6.4. Diferença entre 20 milhões de euros e o valor máximo de 1.1.9. ou de 5.	