

PARTE III

FÓRMULA A APLICAR NO MIT NAS OPERAÇÕES DE COMPRA COM ACORDO DE REVENDA OU DE VENDA COM ACORDO DE RECOMPRA PELO BP DE TÍTULOS CUJA EMISSÃO HAJA SIDO FEITA A DESCONTO (v.g. BT OU TIM).

a) Na data de realização da operação

$$VT = \frac{VN36500}{36500 + t(n - d)} \times \frac{36500}{36500 + td}$$

em que:

VT = valor a creditar ou a debitar na conta das instituições

VN = valor nominal

t = taxa de juro da operação, expressa até à centésima de ponto percentual

n = prazo vincendo dos títulos transaccionados, expresso em dias, na data de realização da operação

d = prazo da operação realizada com acordo de recompra ou de revenda, expresso em dias (quando se trate de compra ou de venda definitivas, d = 0).

b) Na data de vencimento da operação

$$VT = \frac{VN36500}{36500 + tn'}$$

em que:

VT = valor de reembolso

VN = valor nominal

t = taxa de juro da operação, expressa até à centésima de ponto percentual

n' = prazo vincendo dos títulos transaccionados, expresso em dias, na data de vencimento da operação