

Anexo à Instrução nº 37/98

MODELO RX01

O presente modelo deverá ser preenchido utilizando o contravalor em euros de cada uma das moedas. As instituições cuja posição líquida global seja inferior a 2% dos seus fundos próprios só preencherão a Parte I e as linhas 1 e 2 da Parte II deste modelo.

As unidades monetárias compósitas podem ser tratadas como divisas autónomas ou serem decompostas nas quantidades de moedas integrantes, nos termos do ponto 5 do anexo VII do Aviso. Em nota ao respectivo quadro a entidade declarante deverá indicar o procedimento adoptado.

- (1) Alínea a) do ponto 1 do Anexo VII.
- (2) Alínea b) do ponto 1 do Anexo VII. No caso de utilização do valor actual líquido no cálculo da posição aberta líquida das operações a prazo, este procedimento deve ser utilizado de forma consistente e deverá ser expressamente mencionado em nota de pé de página ao quadro de cálculo das posições abertas.
- (3) Alínea c) do ponto 1 do Anexo VII.
- (4) Alínea d) do ponto 1 do Anexo VII.
- (5) Alínea e) do ponto 1 do Anexo VII.
- (6) Alínea f) do ponto 1 do Anexo VII.
- (7) Ponto 3 do Anexo VII. As autorizações concedidas pelo Banco de Portugal, ao abrigo deste ponto, devem ser expressamente indicadas em folha suplementar à Parte I deste Modelo. A inscrição da posição estrutural nesta coluna pressupõe que a mesma tenha sido considerada na coluna adequada relativa a esta posição.
- (8) Em base individual o valor a inscrever será o da posição líquida em cada divisa, resultante da diferença entre as posições longas e as posições curtas, após a eventual dedução das posições estruturais inscritas na coluna (XIII).
Em base consolidada, para as instituições que procedem à compensação a que se referem os pontos 5.1., alínea b), 5.2. e 5.3. do nº 8 do Aviso 7/96, o procedimento é idêntico ao descrito para a base individual, considerando-se o conjunto das instituições como se se tratasse de uma só entidade. Para as instituições que não podem proceder à referida compensação o cálculo é efectuado entidade a entidade, devendo cada posição líquida apurada ser adicionada à posição de idêntica natureza do conjunto das entidades cujas posições foram compensadas.
- (9) Alínea b) do ponto 4 do Anexo VII. Totais dos valores inscritos nas colunas XIV e XV, respectivamente.
- (10) Alínea c) do ponto 4 do Anexo VII. Considerar o mais elevado dos dois totais referidos em (9).
- (11) Primeira parte do ponto 6 do Anexo VII. Inscrever 2% do valor dos fundos próprios apurados na linha 1.5 do Modelo RF01 ou na linha 1.5 do Modelo RF02, consoante o caso. Poderão ser incluídas, em primeira linha, posições sujeitas a um nível de requisitos próprios mais exigentes.
- (12) Diferença entre a posição líquida global inscrita na linha 1 e a posição a deduzir inscrita na linha 2.
- (13) Ponto 6.1 do Anexo VII. Os valores a considerar devem respeitar exclusivamente a posições incluídas na “Posição líquida global elegível”, constante da linha 3 da parte II deste modelo.

- (14) 1.º parágrafo do ponto 6.2 do Anexo VII. Os valores a considerar devem respeitar exclusivamente as posições incluídas na “Posição líquida global elegível”, constante da linha 3 da parte II deste modelo.
- (15) Soma dos requisitos inscritos nas linhas 6.1, 6.2 e 6.3.
- (16) Primeira parte do 2.º parágrafo do ponto 6.2 do Anexo VII. 4% do valor inscrito na linha 4.
- (17) Segunda parte do 2.º parágrafo do nº 6.2. O valor a inscrever corresponde ao produto do montante das posições compensadas em divisas sujeitas a um acordo entre Estados pela metade da variação permitida por esse acordo.
- (18) Ponto 6 do Anexo VII. Corresponde a 8% do montante inscrito na linha 3 deduzido dos inscritos nas linhas 4 e 5.
- (19) Ponto 8 do Anexo VII. Este método só pode ser utilizado mediante prévia autorização do Banco de Portugal e os requisitos de fundos próprios não poderão ser inferiores a 2% da posição líquida global apurada na linha 1 da Parte II deste modelo.