

## Anexo à Instrução nº 37/98

### 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 nº 6º do Aviso nº 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.
- (4) Posições definidas no ponto 1.1. do Anexo II do Aviso nº 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 confirmam 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 nº 7/96.
- (8) Transacções a que se refere a Secção A do Anexo VI do Aviso nº 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 nº 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 nº 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 nº 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 nº 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 nº 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 nº 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.