

Manual de Instruções do Banco de Portugal

Instrução nº 5/2007

ASSUNTO: Inquérito à Actividade nos Mercados de Câmbios e de Produtos Derivados

No uso das competências que lhe são atribuídas pela sua Lei Orgânica (aprovada pela Lei nº 5/98, de 31 de Janeiro, com as alterações introduzidas pelos Decretos-Leis nºs 118/2001, de 17 de Abril, 50/2004, de 10 de Março e 39/2007, de 20 de Fevereiro), designadamente o Artigo 13.º, o Banco de Portugal, através da presente Instrução, determina o seguinte:

1. Objecto

- 1.1.** Esta Instrução destina-se a regulamentar o reporte de informação estatística ao Banco de Portugal tendo em vista a compilação de estatísticas sobre a actividade nos mercados de câmbios e de produtos derivados.
- 1.2.** Entre outros objectivos, associados ao desempenho pelo Banco de Portugal da sua função no domínio da estatística, o reporte de informação mencionado no ponto anterior visa a satisfação de compromissos de reporte estatístico assumidos junto do Banco de Pagamentos Internacionais.

2. Entidades abrangidas

- 2.1.** A população reportante abrangida pela presente Instrução é composta pelas instituições cuja principal actividade consiste na aceitação de depósitos, ou equiparados, e na concessão de empréstimos e/ou na negociação de títulos por conta própria, adiante designadas apenas por Instituições Financeiras Monetárias (IFM). Nomeadamente, é constituída pelos bancos, pelas caixas de crédito agrícola mútuo (incluindo a Caixa Central de Crédito Agrícola Mútuo), pelas caixas económicas e pelas sucursais de IFM não residentes.
- 2.2.** No âmbito da presente Instrução, as instituições referidas no ponto anterior são classificadas em duas categorias, de acordo com a natureza e país de localização da respectiva casa-mãe, com requisitos de reporte diferenciados:

Grupo Bancário Nacional – Instituições inseridas num grupo bancário em que a casa-mãe é uma IFM residente. Estão ainda incluídas nesta categoria as IFM residentes cuja casa-mãe não seja uma IFM, residente ou não residente, bem como as IFM residentes não inseridas num grupo económico. Estas Instituições deverão reportar a informação referida nos pontos 3.1.1 e 3.1.2 da presente Instrução.

Grupo Bancário não Residente – Instituições inseridas num grupo bancário em que a casa-mãe é uma IFM não residente. Estas Instituições deverão reportar a informação referida no ponto 3.1.1 da presente Instrução.

3. Informação a reportar

- 3.1.** A informação a reportar ao Banco de Portugal no âmbito desta Instrução encontra-se estruturada da seguinte forma:
 - 3.1.1.** Montantes nominais ou nocionais associados aos volumes transaccionados – informação em base individual, com referência às transacções efectuadas no decurso do mês de Abril em derivados cambiais, incluindo operações cambiais spot, e derivados sobre taxas de juro de uma só moeda.
 - 3.1.2.** Montantes nominais ou nocionais e valores brutos de mercado das posições em aberto – informação em base consolidada, com referência à posição em aberto no final do mês de Junho relativa a derivados cambiais, derivados sobre taxas de juro de uma só moeda, derivados de acções e índices de acções, derivados de mercadorias, derivados de crédito e outros derivados.

- 3.2. O Banco de Portugal disponibiliza a todas as instituições abrangidas pela presente Instrução um Manual de Procedimentos destinado a facilitar o cumprimento dos requisitos impostos pela mesma, bem como a concretizar os aspectos técnicos e operacionais associados com o reporte da informação.

4. Frequência e prazos para recepção da informação

- 4.1. De acordo com os requisitos de reporte do Banco de Pagamentos Internacionais, a informação a reportar ao Banco de Portugal no âmbito desta Instrução é requerida numa base trienal, com início no ano de 2007.
- 4.2. A informação referida no ponto 3.1.1 deverá ser enviada ao Banco de Portugal até ao dia 15 de Junho.
- 4.3. A informação referida no ponto 3.1.2 deverá ser enviada ao Banco de Portugal até ao dia 15 de Agosto.

5. Forma de envio da informação estatística

- 5.1. O reporte da informação referida no ponto 3.1 deverá ser efectuado em formato electrónico. Para o efeito, as instituições reportantes poderão utilizar a aplicação informática disponibilizada pelo Banco de Portugal. Esta aplicação, para instalação e utilização local nas instituições reportantes, permite a inserção, edição e validação da informação a reportar, bem como a criação do ficheiro a enviar ao Banco de Portugal.

6. Nomeação de interlocutores qualificados

- 6.1. Todas as instituições reportantes devem nomear um interlocutor habilitado a responder a eventuais questões sobre a informação reportada que o Banco de Portugal entenda colocar, o qual será designado por “*Correspondente para o inquérito à actividade nos mercados de câmbios e de produtos derivados*”.
- 6.2. De forma a garantir uma resposta pronta às questões colocadas pelo Banco de Portugal, a instituição reportante deve assegurar a disponibilidade permanente do interlocutor designado, procedendo obrigatoriamente à nomeação de um substituto (definitivo ou temporário) quando não seja possível verificar essa condição.
- 6.3. Reciprocamente, o Banco de Portugal indicará os seus interlocutores para o esclarecimento de quaisquer dúvidas que possam surgir decorrentes da aplicação da presente Instrução.

7. Disposições finais

- 7.1. A presente Instrução entra em vigor à data da sua publicação.
- 7.2. No âmbito da presente Instrução, quaisquer contactos com o Banco de Portugal deverão ser efectuados para:

Banco de Portugal
Departamento de Estatística
Área de Estatísticas da Balança de Pagamentos e Posição de Investimento Internacional
Avenida Almirante Reis, 71
1150-012 LISBOA

Fax: 213128478

E-mail: ddebp@bportugal.pt