

DIRECTIVA N.º 01/ DSI/DRO/DMA/2018

ORIGEM: Departamento de Supervisão Prudencial das Instituições Financeiras (DSI) Departamento de Regulação e Organização do Sistema Financeiro (DRO) Departamento de Mercado de Activos (DMA)	DATA 29/01/2018
ASSUNTO: Limite de Posição Cambial - Informação Diária - Bancos Comercias	

Havendo necessidade de se conferir maior transparência às operações cambiais efectuadas pelos Bancos Comerciais, sob a supervisão do Banco Nacional de Angola (BNA);

Considerando o disposto no Aviso n.º 01/2018, de 22 de Janeiro, sobre o Limite de Posição Cambial;

Serve a presente Directiva para estabelecer o seguinte:

1. Os Bancos Comerciais devem remeter, com periodicidade diária, o mapa de "POSIÇÃO CAMBIAL DIÁRIA", que deve conter as informações relativas ao último dia útil anterior.
 - 1.1. O mapa referido no ponto anterior deve incluir os montantes dos elementos determinados no Anexo da presente Directiva, da qual é parte integrante.
 - 1.2. O mapa deve ser remetido via electrónica, até as 8h30, utilizando o Sistema de Supervisão das Instituições Financeiras (SSIF), observadas as disposições, requisitos e especificações da mensagem XML constante do Portal SSIF, sobre o mapa de posição cambial.

- 1.3. Para efeitos do disposto no ponto anterior, enquanto não se verificar a disponibilidade do SSIF para o envio e a recepção da informação, nos termos da presente Directiva, os Bancos Comerciais devem remeter a mesma, ao BNA, em formato Excel, através do endereço electrónico: dma@bna.ao.
2. A posição cambial deve ser apurada em Euros (EUR).
 - 2.1. Para efeitos do número anterior, na conversão para Euros (EUR) das posições cambiais nas diferentes moedas, deve ser aplicada a Taxa Média de Câmbio de referência em vigor no dia a que as mesmas se referem.
 - 2.2. As obrigações de tesouro indexados em moeda estrangeira não devem ser consideradas para efeitos de apuramento do limite de posição cambial.
3. A presente Directiva entra imediatamente em vigor na data da sua publicação.

Luanda, 29 de Janeiro de 2018.

DEPARTAMENTO DE SUPERVISÃO PRUDENCIAL
DAS INSTITUIÇÕES FINANCEIRAS

Tuneka Lukau

DEPARTAMENTO DE REGULAÇÃO E ORGANIZAÇÃO
DO SISTEMA FINANCEIRO

Carla Gomes

DEPARTAMENTO DE MERCADO DE ACTIVOS

Maria Cândida Sambingo

ANEXO

MAPA DE POSIÇÃO CAMBIAL

INSTITUIÇÃO:
DATA DE INÍCIO:

LIMITES DE POSIÇÃO CAMBIAL

(em milhares de Euros/EUR)				
	Posição do dia anterior	Operações Realizadas		Posição nesta data
		Compras	Vendas	
	(1)	(2)	(3)	(4) = (1+2-3)
POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA				
1. POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA - À VISTA	0,00	0,00	0,00	0,00
1.1 POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA - DIVISAS	0,00	0,00	0,00	0,00
1.1.1 COMPRA - À VISTA	0,00	0,00	0,00	0,00
1.1.2 VENDA - À VISTA	0,00	0,00	0,00	0,00
1.2 POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA - NOTAS E MOEDAS ESTRANGEIRAS	0,00	0,00	0,00	0,00
1.2.1 COMPRA - À VISTA	0,00	0,00	0,00	0,00
1.2.2 VENDA - À VISTA	0,00	0,00	0,00	0,00
1.3 OUTRAS OPERAÇÕES CAMBIAIS A LIQUIDAR	0,00	0,00	0,00	0,00
2. POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA A PRAZO	0,00	0,00	0,00	0,00
2.1 POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA - DIVISAS	0,00	0,00	0,00	0,00
2.1.1 COMPRA - A PRAZO	0,00	0,00	0,00	0,00
2.1.2 VENDA - A PRAZO	0,00	0,00	0,00	0,00
2.2 POSIÇÃO CAMBIAL LÍQUIDA - NOTAS E MOEDAS ESTRANGEIRAS	0,00	0,00	0,00	0,00
2.2.1 COMPRA - A PRAZO	0,00	0,00	0,00	0,00
2.2.2 VENDA - A PRAZO	0,00	0,00	0,00	0,00
2.3 OUTRAS OPERAÇÕES CAMBIAIS A LIQUIDAR	0,00	0,00	0,00	0,00
3. POSIÇÃO CAMBIAL GLOBAL (1+2)	0,00	0,00	0,00	0,00
4. TAXA DE CÂMBIO MÉDIA DO PERÍODO:	0,00	0,00	0,00	0,00
5. FUNDOS PRÓPRIOS REGULAMENTARES (Total, em ME):				0,00
6. LIMITE DE POSIÇÃO CAMBIAL (10% dos Fundos Próprios Regulamentares)				0,00
7. EXCESSO/INSUFICIÊNCIA (3-6)	0,00	0,00	0,00	0,00

Para efeitos de preenchimento do mapa acima referido deve ser observado a descrição referente a cada uma das rubricas e sub-rubricas relacionadas, conforme descrição abaixo:

1. Na posição cambial a vista devem ser consideradas as operações/transacções à vista a aguardar liquidação e as operações a prazo que se vençam nos 2 (dois) dias úteis subsequentes;
 - 1.1. Em outras operações cambiais a liquidar devem ser consideradas todas as operações/transacções que não se enquadram nos pontos anteriores;
2. Na posição cambial a prazo devem ser consideradas as operações/transacções a prazo aguardar liquidação, excluindo as operações que se vençam nos 2 (dois) dias subsequentes;
 - 2.1. Em outras operações cambiais a liquidar devem ser consideradas todas as operações/transacções que não se enquadram nos pontos anteriores.

3. Os números 1 e 2 apresentados no mapa com a designação de posição cambial à vista e posição cambial a prazo representam os elementos totalizadores para o apuramento da posição global, ou seja o número 3 do referido mapa.
 4. O limite de posição cambial em termos absolutos representa o cálculo dos 10% (dez por cento) dos fundos próprios apurados no número 5 do referido mapa.
 5. O excesso ou a insuficiência da posição cambial é calculado entre a diferença da posição cambial global apurada no número 3 e o limite de posição cambial apurado no número 6 do referido mapa.
 6. Considera-se que há incumprimento do limite da posição cambial longa, quando esta for superior ao limite estabelecido no Aviso n.º 01/2018, de 22 de Janeiro, sobre Limite de Posição Cambial.
 7. Considera-se que há incumprimento do limite da posição cambial curta, quando esta for inferior ao limite estabelecido no Aviso n.º 01/2018, de 22 de Janeiro, sobre Limite de Posição Cambial.
-