



CMVM

Instrução da CMVM nº 5/2002

Informação Estatística sobre a Actividade de Gestão de Carteiras por Conta de Outrem

Os intermediários financeiros legalmente autorizados ao exercício da actividade de gestão de carteiras por conta de outrem têm vindo a prestar informação à CMVM utilizando como veículo o correio electrónico.

O aproveitamento das oportunidades concedidas pelas novas tecnologias aponta para que a próxima etapa seja a de permitir a entrega dos mencionados elementos no domínio de *extranet* da CMVM, pelo que se consagra na presente instrução o envio de elementos através deste canal de comunicação.

Aproveitou-se ainda o ensejo para introduzir um conjunto de novas informações a reportar à CMVM.

Nestes termos, a CMVM, ao abrigo do disposto no n.º 4 do artigo 369º do Código dos Valores Mobiliários, determina, através da presente Instrução, o seguinte:

Norma número 1: Os intermediários financeiros, com excepção daqueles que actuam em regime de livre prestação de serviços, autorizados a prestar em Portugal o serviço de investimento de gestão de carteiras por conta de outrem, referido na alínea c) do número 1 do artigo 290º do Código dos Valores Mobiliários, comunicam à CMVM, até ao terceiro dia útil do mês seguinte a que respeita, a seguinte informação:

1.1 – as transacções mensais efectuadas no mercado a contado e em mercado de bolsa a prazo com contratos de futuros e opções, por conta de outrem, de acordo com o Anexo 1 da presente instrução;

1.2 – os valores propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registados no último dia de cada mês, de acordo com o Anexo 2 da presente instrução;

1.3 – as posições abertas em contratos de futuros e opções transaccionados em bolsa, propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registadas no último dia de cada mês, de acordo com o Anexo 3 da presente instrução;

1.4 – a caracterização do tipo de carteiras geridas por conta de outrem, no último dia de cada mês, de acordo com o Anexo 4, da presente instrução.

Norma número 2: Nos casos em que não exista, com referência ao período em causa, alguma das informações previstas na norma anterior, o dever de comunicação mantém-se, através de "reporte nulo".

Norma número 3: Os anexos 1 a 4 referidos na Norma número 1, bem como os

anexos 5, 6 e 7, são parte integrante da presente instrução e contêm, nomeadamente, a forma e o conteúdo da informação a prestar à CMVM.

Norma número 4: A informação solicitada na presente instrução é prestada através do acesso ao domínio de *extranet* da CMVM disponibilizado para o efeito.

Norma número 5: O envio da informação para o domínio de *extranet* fica sujeito à permissão de acesso à base de dados da CMVM, a conceder por esta a cada entidade através da atribuição de um certificado digital e de uma palavra chave para a sua utilização.

Norma número 6: Em caso de impossibilidade de envio de informação por *extranet* e sem prejuízo da rápida regularização da situação, a informação solicitada pela CMVM pode ser transmitida por correio electrónico e subsidiariamente através de disquete com entrega por correio ou em mão nas instalações da CMVM.

Norma número 7: Na transmissão referida nas normas anteriores devem ser observadas regras operacionais, destinadas a salvaguardar a segurança e a confidencialidade dos dados, definidas pela CMVM.

Norma número 8: No âmbito da presente instrução, é responsável perante a CMVM a pessoa que o intermediário financeiro registou nos termos do disposto na alínea b) do n.º 1 do artigo 13º do Regulamento da CMVM n.º 12/2000.

Norma número 9: É revogada a Instrução da CMVM n.º 03/2000.

Norma número 10: A presente instrução produz efeitos a partir de 01 de Maio de 2002.

Lisboa, 13 de Março de 2002 - O Presidente do Conselho Directivo, *Fernando Teixeira dos Santos* - O Vice-Presidente do Conselho Directivo, *Luís Lopes Laranjo*

INSTRUÇÃO Nº 05/2002
Informação estatística sobre actividade de gestão de carteiras por conta de outrem
 <Denominação da Sociedade>
 <Nº registo na CMVM>
 <Data a que respeita a informação>

Anexo 1

Transacções mensais efectuadas no mercado a contado, por conta de outrem:

Volume de transacções €	Mercados Regulamentados - Bolsa		Outros Mercados Regulamentados		Fora de Mercado Regulamentado e Mercado Primário	
	Em Portugal	Outros Países	Em Portugal	Outros Países	Em Portugal	Outros Países
Acções						
Obrigações Dívida Pública						
Outros Valores Mobiliários						
TOTAL						

Transacções mensais efectuadas em mercado de bolsa a prazo com contratos de futuros e opções, por conta de outrem:

Contratos Transaccionados €	Número de Contratos Transaccionados		Valor das Transacções	
	Em Portugal	Outros Países	Em Portugal	Outros Países
Futuros de Índices sobre Valores Mobiliários				
Futuros de Acções				
Futuros de Taxa de Juro Curto Prazo				
Futuros de Taxa de Juro Longo Prazo				
Outros Futuros				
Futuros (Total)				
Opções sobre Futuros de Índices				
Opções sobre Futuros de Acções				
Opções sobre Futuros de Taxa de Juro				
Outras Opções				
Opções (Total)				

INSTRUÇÃO Nº 05/2002
 Informação estatística sobre actividade de gestão de carteiras por conta de outrem
 <Denominação da sociedade>
 <Nº de registo na CMVM>
 <Data a que respeita a informação>

Anexo 2 - Valores propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registados no último dia de cada mês

Valores Mobiliários	Mercado	Valores Mobiliários			Quantidade ou montante nominal	Valorização	Montante €
		Código ISIN	Designação	Moeda			
Acções							
Obrigações de Dívida Pública							
Outros Fundos Públicos Equiparados e Obrigações Diversas							
Outros Valores Mobiliários (com excepção de unidades de participação)							
Warrants							
Unidades de Participação de FIM							
Unidades de Participação de FII							
Outros Activos							
Valor total da carteira							

INSTRUÇÃO Nº05/2002
Informação estatística sobre actividade de gestão de carteiras por conta de outrem
<Denominação da sociedade>
<Nº de registo na CMVM>
<Data a que respeita a informação>

Anexo 3 - Posições abertas em contratos de futuros e opções transacionados em bolsa, propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo Intermediário Financeiro, registadas no último dia de cada mês.

Série do contrato	Posição		Margem	Exposição	Mercado
	N.º de Contratos	C/V			
Futuros					
Opções					

INSTRUÇÃO Nº 05/2002
Informação estatística sobre actividade de gestão de carteiras por conta de outrem
 <Denominação da sociedade>
 <Nº de registo na CMVM>
 <Data a que respeita a informação>

Anexo 4 - Caracterização do tipo de carteiras geridas por conta de outrem, no último dia de cada mês

Perfil de risco da carteira	Tipo de clientes	Residência do cliente	N.º de carteiras geridas	Taxas de rendibilidade obtidas			Montantes sob gestão		
				Máxima	Média	Mínima	Global	carteira com maior dimensão	carteira com menor dimensão
Alto	Pessoas singulares Pessoas colectivas não institucionais Fundos de pensões Fundos de investimento Outros clientes institucionais								
Médio	Pessoas singulares Pessoas colectivas não institucionais Fundos de pensões Fundos de investimento Outros clientes institucionais								
Baixo	Pessoas singulares Pessoas colectivas não institucionais Fundos de pensões Fundos de investimento Outros clientes institucionais								

Anexo 5 - Instruções de preenchimento

A – Regras gerais relativas aos Anexos 1, 2, 3, e 4 da Instrução n.º 05/2002

Cada tabela deverá corresponder a um ficheiro.

1. O ficheiro deverá ser remetido à CMVM em formato ASCII com os campos separados por ponto e vírgula.
2. O nome dos ficheiros deve ser escrito em maiúsculas, com o seguinte formato: "RNNNMMAAXXX", onde "R" é constante, "NNN" corresponde ao n.º de registo atribuído pela CMVM à entidade reportante, "MM" ao mês, "AA" ao ano e "XXX" identifica a tabela a que se refere o reporte. Todos os caracteres do nome do ficheiro são de preenchimento obrigatório.
3. Por exemplo, a tabela [GCA] (correspondente ao Anexo 1 da presente instrução) da entidade reportante n.º 999, referente a 31 de Março de 2002, geraria o seguinte ficheiro, reportado em formato ASCII: "R9990302GCA.DAT".
4. Cada linha do ficheiro corresponde a um registo e deve terminar com mudança de linha.
5. Cada linha é composta pelos campos indicados para cada uma das tabelas, a considerar obrigatoriamente, ainda que em branco nos casos não aplicáveis. No formato ASCII, um campo em branco é identificado por dois pontos e vírgula sucessivos.
6. Não deverão ser incluídos quaisquer nomes para os campos.
7. As casas decimais devem ser indicadas por uma vírgula, não sendo permitidos quaisquer caracteres de separação dos milhares, nomeadamente o ponto. Por exemplo o valor de €20.000,50 deve ser inscrito no seguinte formato: "20000,50".
8. São as seguintes as propriedades dos campos utilizados:
 - 8.1. Campo alfanumérico: admite apenas caracteres incluídos no seguinte conjunto [0-9,A-Z], não admitindo caracteres especiais;
 - 8.2. Campo numérico: admite exclusivamente caracteres incluídos no seguinte conjunto [0-9] e, se negativo, é acrescentado o sinal "-" na primeira posição;
 - 8.3. Campo data: admite apenas valores correspondentes a datas válidas, no formato AAAAMMDD;
 - 8.4. Campo código: os valores permitidos pelo campo são pré-definidos, pelo que, só estes são admissíveis, não devendo ser introduzidos quaisquer outros valores;
 - 8.5. Campo moeda (€): admite os mesmos caracteres que o tipo de campo numérico.
9. A obrigatoriedade de reporte mensal dos Anexos aqui mencionados existe, desde que o intermediário financeiro esteja registado para a actividade de gestão de carteiras por conta de outrem, ainda que não a esteja a exercer ou não sejam observadas alguma das informações previstas, no mês em causa. Quando tal se verifique deve ser efectuada comunicação de reporte nulo.

B – Regras relativas ao Anexo 1

Transacções Mensais efectuadas no Mercado a Contado e em Mercado de Bolsa a Prazo com Contratos de Futuros e Opções, por Conta de Outrem

Relativamente ao âmbito da informação

Todos os intermediários financeiros, com excepção dos que actuem em regime de livre prestação de serviços, habilitados a gerir carteiras por conta de outrem, deverão preencher estes mapas com as transacções mensais efectuadas por conta de outrem e executadas por intermediário financeiro autorizado.

Para efeitos de preenchimento do mapa relativo às transacções realizadas no mercado a contado deve considerar-se como mercado regulamentado de país não abrangido pela Directiva de Serviços de Investimento (DSI), todos os mercados em

relação aos quais o preço de transacção seja, nos termos da respectiva regulamentação, considerado como cotação ou equivalente.

Relativamente à unidade monetária

No caso de crédito em moeda diferente do euro, a conversão para euros deve ser efectuada com base na taxa de câmbio da data relativa à concessão do crédito.

C – Outras regras quanto ao Anexo 1

Tabela [GCA] – Transacções mensais efectuadas no mercado a contado e em mercado de bolsa a prazo com contratos de futuros e opções, por conta de outrem – tabela de acordo com o Anexo 1

R_CMVM	Data_Ref	Tipo_Oper	Mercado	Origem Transacção	Valor Mobiliário	N.º Contratos	Valor_T
1.º campo	2.º campo	3.º campo	4.º campo	5.º campo	6.º campo	7.º campo	8.º campo
Numérico	Data	Código	Código	Código	Código	Numérico	Moeda (€)

Cód_Tipo_Oper	Descrição
OC	Operações a Contado
OP	Operações a Prazo

Cód_Origem	Descrição
P	Portugal
E	Fora de Portugal

Cód_Mercado	Mercados
MRB	Mercados Regulamentados - Bolsa
OMR	Outros Mercados Regulamentados
FMR	Fora de Mercados Regulamentados e Mercado Primário

Cód_VM	Designação
1	Acções
2	Obrigações de Dívida Pública
4	Outros Valores Mobiliários
5	Futuros de Acções
6	Futuros de Índices de Valores Mobiliários
7	Futuros de Taxa de Juro de Curto-Prazo
8	Futuros de Taxa de Juro de Longo-Prazo
9	Outros Futuros
10	Opções sobre Futuros de Acções
11	Opções sobre Futuros de Índices
12	Opções sobre Futuros de Taxa de Juro
13	Outras Opções

1.º Campo (R_CMVM)

Deve ser preenchido com o número de registo como intermediário financeiro junto da CMVM.

Formato e Dimensão: 3 caracteres numéricos.

2.º Campo (Data Ref)

A data a considerar é o último dia do mês a que respeita a informação, sendo de preenchimento obrigatório para todos os registos.

Formato e Dimensão: "AAAAMMDD" onde "AAAA" representa o ano, "MM" o mês e "DD" o último dia do mês.

3.º Campo (Cód_Tipo_Oper)

Para as transacções realizadas em mercado a prazo (contratos de futuros ou de opções) deve ser usado o código "OP", no caso das transacções no mercado a contado o código correspondente é "OC".

4.º Campo (Mercado)

Para as operações a contado (opção "OC" no 3.º Campo) deve ser preenchido com um dos seguintes códigos, em função das situações referidas:

- "MRB", para as transacções realizadas em bolsa;
- "OMR", para as transacções realizadas em outros mercados regulamentados;
- "FMR", para as transacções realizadas fora de mercados regulamentados e em Mercado Primário.

Para as operações realizadas no mercado a prazo (opção "OP" no 3.º Campo), este campo deve ser deixado em branco.

5.º Campo (Origem Transacção)

Tratando-se de transacções realizadas em Portugal, deve preencher-se o campo com o valor "P", caso contrário (negociação fora de Portugal) deve preencher-se com o valor "E".

6.º Campo (Valor Mobiliário)

O valor deste campo está dependente da opção seleccionada no 3.º campo:

- Se o valor do 3.º campo for "OC", os códigos admissíveis para os valores mobiliários são "1", "2" e "4" da sub-tabela [Cód_VM];
- Se o valor do 3.º campo for "OP", os códigos admissíveis para os valores mobiliários são "5" a "13" da sub-tabela [Cód_VM].

7.º Campo (N.º Contratos)

Este campo, deve ser preenchido com o número de contratos transaccionados de futuros ou opções. Para as transacções efectuadas no mercado a contado (quando o valor do 3.º campo for "OC"), este campo não é preenchido, devendo ser deixado em branco.

8.º Campo (Valor_T)

O campo valor da transacção deve ser preenchido em euro. Relativamente a transacções efectuadas sobre valores mobiliários em moeda diferente do euro, a conversão para euros deve ser efectuada com base na taxa de câmbio da data relativa a cada transacção.

Se o valor inserido no 6.º campo (valor mobiliário) corresponder a um contrato de opções (valores "10" a "13" inclusive da sub-tabela [Cód_VM]), este campo não deve ser preenchido.

D - Exemplo: Tabela [GCA] – Tabela de acordo com o Anexo 1

A entidade registada na CMVM com o n.º 999, pretende reportar os seguintes elementos relativos ao mês de Março de 2002:

Gestão de Carteiras por Conta de Outrem – Operações a Contado e a Prazo

Denominação da Sociedade: Xpto, S.A.

N.º Registo na CMVM: 999

Data a que respeita a Informação: 2002/03/31

Anexo 1

Transacções mensais efectuadas no mercado a contado, por conta de outrem:

Volume de transacções €	Mercados Regulamentados - Bolsa		Outros Mercados Regulamentados		Fora de Mercados Regulamentados (inclui mercado primário)	
	Em Portugal	Outros Países	Em Portugal	Outros Países	Em Portugal	Outros Países
Acções	15.849.542	5.145.454	0	155.121	900.235	450.542
Obrigações de Dívida Pública	4.285.469	8.112.141	19.475.843	0	0	0
Outros Valores Mobiliários	854.325	121.325	0	0	152.356	0
TOTAL	20.989.337	13.378.921	19.475.843	155.121	1.052.591	450.542

Transacções mensais efectuadas em mercado de bolsa a prazo com contratos de futuros e opções, por conta de outrem:

Contratos Transaccionados €	Número de Contratos Transaccionados		Valor das Transacções	
	Em Portugal	Outros Países	Em Portugal	Outros Países
Futuros de Acções	12	54	1.945.428	9.400.000
Futuros de Índices de Valores Mobiliários	3	5	95.513	108.420
Futuros de Taxas de Juro de Curto-Prazo	5	14	100.255	1.205.215
Futuros de Taxas de Juro de Longo-Prazo	0	2	0	890.000
Outros Futuros	0	5	0	452.225
Futuros (Total)	20	80	2.141.195	12.055.860
Opções sobre Futuros de Acções	8	18		
Opções sobre Futuros de Índices	4	7		
Opções sobre Futuros de Taxa de Juro	7	41		
Outras Opções	0	2		
Opções (Total)	19	68		

Formato para envio da informação em ASCII:

```

999;20020331;OC;MRB;P;1;;15849542
999;20020331;OC;MRB;E;1;;5145454
999;20020331;OC;MRB;P;2;;4285469
999;20020331;OC;MRB;E;2;;8112141
999;20020331;OC;MRB;P;4;;854325
999;20020331;OC;MRB;E;4;;121325
999;20020331;OC;OMR;E;1;;155121
999;20020331;OC;OMR;P;2;;19475843
999;20020331;OC;FMR;P;1;;900235
999;20020331;OC;FMR;E;1;;450545
999;20020331;OC;FMR;P;4;;152356
999;20020331;OP;MRB;P;5;20;2141195
999;20020331;OP;MRB;E;5;80;12055860
999;20020331;OP;MRB;P;6;12;1945428
999;20020331;OP;MRB;E;6;54;9400000
999;20020331;OP;MRB;P;7;5;100255
999;20020331;OP;MRB;E;7;14;1205215
999;20020331;OP;MRB;E;8;2;890000
999;20020331;OP;MRB;E;9;5;452225
999;20020331;OP;;P;10;8;;
999;20020331;OP;;E;10;18;;
999;20020331;OP;;P;11;4;;
999;20020331;OP;;E;11;7;;
999;20020331;OP;;P;12;7;;
999;20020331;OP;;E;12;41;;
999;20020331;OP;;E;13;2;;

```

E – Regras relativas ao Anexo 2

Valores propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registados no último dia de cada mês

Relativamente ao âmbito da informação

Todos os intermediários financeiros, com excepção dos que actuem em regime de livre prestação de serviços, habilitados a gerir carteiras por conta de outrem, deverão preencher este mapa com os valores que compõem as carteiras, identificados individualmente segundo a ordem constante do mapa.

Para efeitos de preenchimento do presente mapa deve considerar-se como mercado regulamentado de país não abrangido pela Directiva de Serviços de Investimento

(DSI), todos os mercados em relação aos quais o preço de transacção seja, nos termos da respectiva regulamentação, considerado como cotação ou equivalente.

Relativamente à valorização dos activos

A valorização dos activos que compõem as carteiras deve ser efectuada com base nas regras constantes do n.º 4 do artigo 2.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2000 (relativo ao Sistema de Indemnização aos Investidores), ou noutras que a CMVM oportunamente venha a definir.

F – Outras regras quanto ao Anexo 2

Tabela [VMO] – Valores propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registados no último dia de cada mês – tabela de acordo com o Anexo 2

R_CMVM	Data_Ref	VM	Mercado	Código ISIN	Designação	Moeda	Quantid.	Valoriz.	Montante
1.º campo	2.º campo	3.º campo	4.º campo	5.º campo	6.º campo	7.º campo	8.º campo	9.º campo	10.º campo
Numérico	Data	Código	Código	Alfanumérico	Alfanumérico	Código	Numérico	Numérico	€

Cód_VM	Designação
1	Acções
2	Obrigações de Dívida Pública
3	Outros Fundos Públicos Equiparados e Obrigações Diversas
4	Outros Valores Mobiliários
5	Warrants
14	Unidades Participação de FIM
15	Unidades Participação de FII
16	Outros Activos

1.º Campo (R_CMVM)

Deve ser preenchido com o número de registo como intermediário financeiro junto da CMVM.

Formato e Dimensão: 3 caracteres numéricos.

2.º Campo (Data Ref)

A data a considerar é o último dia do mês a que respeita a informação, sendo de preenchimento obrigatório para todos os registos.

Formato e Dimensão: "AAAAMMDD" onde "AAAA" representa o ano, "MM" o mês e "DD" o último dia do mês.

3.º Campo (VM)

Classifica o valor mobiliário de acordo com as seguintes opções:

- "1", para acções;
- "2", para obrigações de dívida pública;
- "3", para Outros Fundos Públicos Equiparados e Obrigações Diversas;
- "4", para outros valores mobiliários (exceptuando unidades de participação);
- "5", para Warrants;
- "14", para unidades de participação em Fundo de Investimento Mobiliário (FIM);
- "15", para unidades de participação em Fundo de Investimento Imobiliário (FII);
- "16", para outros activos.

4.º Campo (Mercado)

Identifica os mercados onde estão predominantemente admitidos os valores mobiliários objecto de reporte, devendo ser preenchidos de acordo com a listagem de códigos de mercados constante do Anexo 6.

Para o caso dos fundos de investimento, identifica onde a entidade gestora ou sociedade de investimento está sediada, devendo o preenchimento ser efectuado com os seguintes códigos:

- "MP", para Portugal;
- "ME", para países da União Europeia;
- "MN", Outros países.

Para outros activos (opção "16" do 3.º campo) este campo não deve ser preenchido.

5.º Campo (Cód_ISIN)

A preencher utilizando o código do *International Standard Identification Number* (ISIN) ou, na sua ausência, o código da Central de Valores Mobiliários (CVM).

Para os valores mobiliários sem código atribuído (ISIN ou da CVM), este campo não deve ser preenchido. Também para as unidades de participação em FII e outros activos (opções "15" e "16" do 3.º campo) este campo não deve ser preenchido.

6.º Campo (Designação)

A preencher obrigatoriamente com a designação do valor mobiliário para todos os valores não admitidos em mercado português e ainda se não tiver sido preenchido o 5.º campo (Cód_ISIN).

Para as unidades de participação em FII e outros activos (opções "15" e "16" do 3.º campo) este campo não deve ser preenchido.

7.º Campo (Moeda)

Deve ser preenchido com o código de moeda em que os valores originariamente se encontram expressos, de acordo com a listagem de códigos de moeda constante do Anexo 7.

8.º Campo (Quantidade)

Deve ser indicada a quantidade transaccionada ou o montante nominal em euros (obrigações).

Para as unidades de participação em FII e outros activos (opções "15" e "16" do 3.º campo) este campo não deve ser preenchido.

Formato e Dimensão: caracteres numéricos, com duas casas decimais para o montante nominal.

9.º Campo (Valorização)

O campo valorização deve ser preenchido em euro, com duas casas decimais.

Para as unidades de participação em FII e outros activos (opções "15" e "16" do 3.º campo) este campo não deve ser preenchido.

10.º Campo (Montante)

O campo montante deve ser preenchido em euros.

G – Exemplo da Tabela [VMO] – Tabela de acordo com o Anexo 2

A entidade registada na CMVM com o n.º 999, pretende reportar os seguintes elementos relativos ao mês de Março de 2002:

Informação Estatística sobre Actividade de Gestão de Carteiras por Conta de Outrem

Denominação da Sociedade: Xpto, S.A.

N.º Registo na CMVM: 999

Data a que respeita a Informação: 2002/03/31

Anexo 2 – Valores propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registados no último dia de cada mês.

Valores Mobiliários	Mercado	Valores Mobiliários			Quantidade ou Montante Nominal	Valorização	Montante
		Código ISIN	Designação	Moeda			
Acções	BVLP	PTBRI0AM0000	Brisa-Nom.(Privatiz.)	Eur	7.000	7,99	55.930
Acções	BVMA	ES0130670112	AC. Endesa	Eur	500	22,30	11.150
Acções	BVRJ	BRTNLPACNOR3	Telemar	BRL	100	9,63	963
Obrigações de Dívida Pública	BVLP	PT0TEAOE0013	OT - Abril	Eur	2.500	98,70	246.750
Outros Fundos Públicos Equiparados e Obrigações Diversas	BVLP	PTPEPDOE0005	Parque Expo'98 - 1ª Emiss.	Eur	2.000	99,90	199.800
Outros Fundos Públicos Equiparados e Obrigações Diversas	BVMA	ES0230670202	OB. Endesa	Eur	2.000	102,31	204.620
Outros Valores Mobiliários (Exceptuando unidades de participação)	BVLP	PTCFNBWE0003	Cofina (Warrants Destacados)	Eur	2	4,57	9
Warrants	BVLP	FR0005099454	Warrant sobre BCP 1202 - SG (Call)	Eur	100	0,57	57
Unidades de participação de FIM	MN	PTLUVAMM0006	Luso Valor	Eur	3.000	29,35	88.050
Unidades de participação de FIM	ME	ES0147711032	Argentaria Telecomunicaciones FIM	Eur	1.500	22,87	34.305
Unidades de participação de FII	MN			JPY			6.220
Outros Activos							521
Valor Total da Carteira							848.375

Formato para envio da informação em ASCII:

```

999;20020331;1;BVLP;PTBRI0AM0000;;EUR;7000;7,99;55930
999;20020331;1;BVMA;ES0130670112;AC. Endesa;EUR;500;22,30;11150
999;20020331;1;BVRJ;BRTNLPACNOR3;Telemar;BRL;100;9,63;963
999;20020331;2;BVLP;PT0TEAOE0013;;EUR;2500;98,7;246750
999;20020331;3;BVLP;PTPEPDOE0005;;EUR;2000;99,9;199800
999;20020331;3;BVMA;ES0230670202;OB. Endesa;EUR;2000;102,31;204620
999;20020331;4;BVLP;PTCFNBWE0003;;EUR;2;4,57;9
999;20020331;5;BVLP;FR0005099454;;EUR;100;0,57;57
999;20020331;14;ME;PTLUVAMM0006;;EUR;3000;29,35;88050
999;20020331;14;ME;ES0147711032;Argentaria Telecomunicaciones
FIM;EUR;1500;22,87;34305
999;20020331;15;MN;;;JPY;;;6220
999;20020331;16;;;;;521

```

H – Regras relativas ao Anexo 3

Posições abertas em contratos de futuros e opções transaccionados em bolsa, propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registadas no último dia de cada mês

Relativamente ao âmbito da informação

Todos os intermediários financeiros, com excepção dos que actuem em regime de livre prestação de serviços, habilitados a gerir carteiras por conta de outrem, deverão preencher este mapa com a identificação individual das posições abertas em contratos de futuros e opções transaccionados em bolsa que compõem as carteiras.

I – Outras regras quanto ao Anexo 3

Tabela [GDO] – Posições abertas em contratos de futuros e opções transaccionados em bolsa, propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registadas no último dia de cada mês - tabela de acordo com o Anexo 3

R_CMVM	Data_Ref	Derivado	Série	N.º Contratos	Posição	Margem	Exposição	Mercado
1.º campo	2.º campo	3.º campo	4.º campo	5.º campo	6.º campo	7.º campo	8.º campo	9.º campo
Numérico	Data	Código	Alfanumérico	Numérico	Código	Numérico	Numérico	Código

Cód_Operação	Descrição
FT	Futuros
OP	Opções

Cód_Operação	Descrição
C	Compra
V	Venda

1.º Campo (R_CMVM)

Deve ser preenchido com o número de registo como intermediário financeiro junto da CMVM.

Formato e Dimensão: 3 caracteres numéricos.

2.º Campo (Data Ref)

A data a considerar é o último dia do mês a que respeita a informação, sendo de preenchimento obrigatório para todos os registos.

Formato e Dimensão: "AAAAMMDD" onde "AAAA" representa o ano, "MM" o mês e "DD" o último dia do mês.

3.º Campo (Derivado)

Identifica o tipo de derivado, estando disponíveis duas alternativas: "FT" para contratos de futuros e "OP" para contratos de opções.

4.º Campo (Série)

A identificação da série do contrato é a que decorre das respectivas condições gerais.

Formato e Dimensão: máximo de 10 caracteres alfanuméricos.

5.º Campo (N.º Contratos)

Para cada série do contrato deve ser indicado, caso existam, o número de contratos da posição bruta compradora e da posição bruta vendedora.

Este campo, deve ser preenchido com o número de contratos com posições abertas à data de reporte.

6.º Campo (Posição)

Identifica a posição do contrato, estando disponíveis duas alternativas: "C" para posições compradoras e "V" para posições vendedoras.

7.º Campo (Margem)

Identifica as margens iniciais inerentes à posição (produto entre o n.º de contratos e a margem inicial por contrato).

8.º Campo (Exposição)

Identifica as exposição inerente à posição (produto entre o n.º de contratos e o preço de referência do contrato/activo subjacente).

9.º Campo (Mercado)

O mercado é identificado recorrendo à respectiva bolsa onde é transaccionado, devendo ser preenchidos de acordo com a listagem de códigos de mercados constante do Anexo 6.

J – Exemplo da Tabela [GDO] – Tabela de acordo com o Anexo 3

A entidade registada na CMVM com o n.º 999, pretende reportar os seguintes elementos relativos ao mês de Março de 2002:

Informação Estatística sobre Actividade de Gestão de Carteiras por Conta de Outrem

Denominação da Sociedade: Xpto, S.A.

N.º Registo na CMVM: 999

Data a que respeita a Informação: 2002/03/31

Anexo 3 – Posições abertas em contratos de futuros e opções transaccionados em bolsa, propriedade de outrem, cuja gestão é efectuada pelo intermediário financeiro, registadas no último dia de cada mês.

Série do Contrato	Posição				
	Número de Contratos	C/V			
Futuros					
P500	500	C	160.000	4.000.000	BVLP
I600	2531	V	809.920	20.248.000	BVLP
Opções					
I600300C	250	C	80.000	2.000.000	BVLP
I612900P	100	V	32.000	800.000	BVLP

Formato para envio da informação em ASCII:

```
999;20020331;FT;P500;500;C;.160000;4000000;BVLP
999;20020331;FT;I600;2531;V;809920;20248000;BVLP
999;20020331;OP;I600300C;250;C;80000;2000000;BVLP
999;20020331;OP;I612900P;100;V;32000;800000;BVLP
```

K – Regras relativas ao Anexo 4

Caracterização do tipo de carteiras geridas por conta de outrem, no último dia de cada mês

Relativamente ao âmbito da informação

Todos os intermediários financeiros, com excepção dos que actuem em regime de livre prestação de serviços, habilitados a gerir carteiras por conta de outrem, deverão preencher este mapa com a caracterização do tipo de carteiras sob gestão no âmbito desta actividade, no final de cada mês.

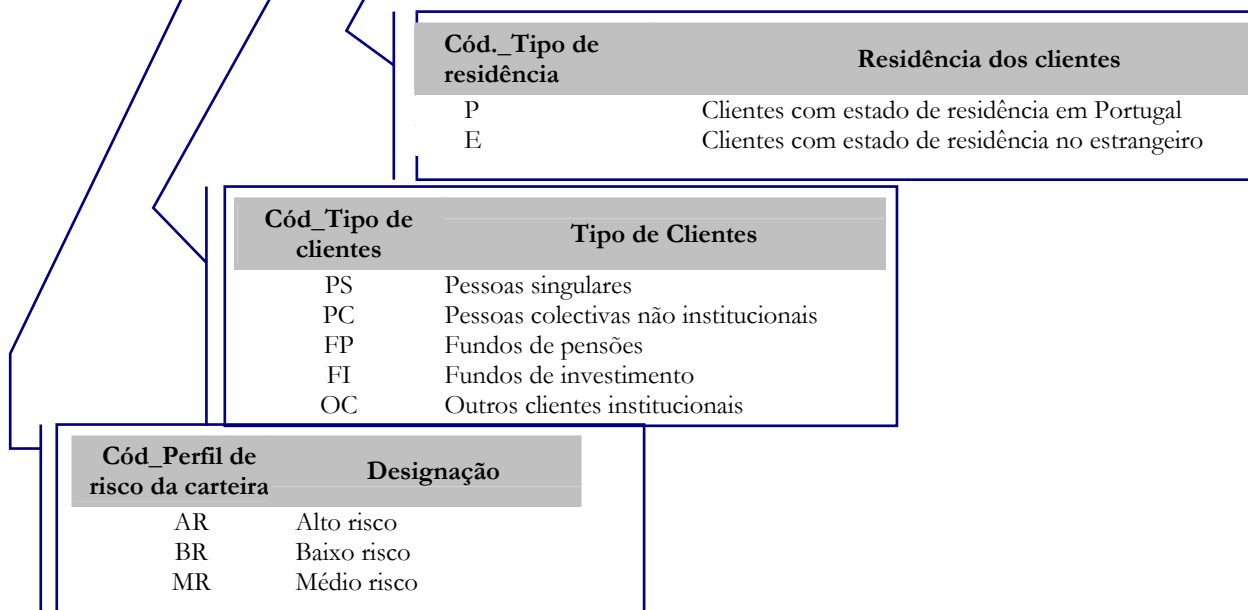
Relativamente à valorização dos activos

A valorização dos activos que compõem as carteiras deve ser efectuada com base nas regras constantes do n.º 4 do artigo 2.º do Regulamento da CMVM n.º 2/2000 (relativo ao Sistema de Indemnização aos Investidores), ou noutras que a CMVM oportunamente venha a definir.

L – Outras regras quanto ao Anexo 4

Tabela [CCG] – Caracterização do tipo de carteiras geridas por conta de outrem, no último dia de cada mês - tabela de acordo com o Anexo 4

R_CMVM	Data_Ref	Perfil de Risco da Carteira	Tipo de Clientes	Residência do Cliente	N.º. De Carteiras geridas	Taxas de Rendibilidade			Montantes sob Gestão		
						Máxima	Média	Mínima	Global	carteira com maior dimensão	carteira com menor dimensão
1.º campo	2.º campo	3.º campo	4.º campo	5.º campo	6.º campo	7.º campo	8.º campo	9.º campo	10.º campo	11.º campo	12.º campo
Numérico	Data	Código	Código	Código	Numérico	Numérico	Numérico	Numérico	€	€	€



1.º Campo (R_CMVM)

Deve ser preenchido com o número de registo como intermediário financeiro junto da CMVM.

Formato e Dimensão: 3 caracteres numéricos.

2.º Campo (Data Ref)

A data a considerar é o último dia do mês a que respeita a informação, sendo de preenchimento obrigatório para todos os registos.

Formato e Dimensão: "AAAAMMDD" onde "AAAA" representa o ano, "MM" o mês e "DD" o último dia do mês.

3.º Campo (Perfil de Risco da Carteira)

Classifica o Perfil de Risco de acordo com as seguintes opções:

- "AR", para alto risco – i.e., carteiras constituídas, no mínimo, por 60% de acções ou fundos de acções ou outros activos considerados de alto risco;
- "BR", para baixo risco – i.e., carteiras constituídas, no máximo, por 10% de acções ou fundos de acções ou outros activos considerados de alto risco;
- "MR", para médio risco – i.e., carteiras que não se enquadrem em nenhuma das categorias acima referidas.

4.º Campo (Tipo de clientes)

Identifica os clientes de acordo com os seguintes códigos:

- "PS", para pessoas singulares;
- "PC", para pessoas colectivas não institucionais;
- "FP", para fundos de pensões;
- "FI", para fundos de investimento;
- "OC", para outros clientes institucionais.

5.º Campo (Residência dos clientes)

Deve ser preenchido de acordo com os seguintes códigos:

- "P", para clientes com estado de residência em Portugal;
- "E", para clientes com estado de residência no estrangeiro.

6.º Campo (Número de carteiras geridas)

A preencher com o número de carteiras sob gestão por conta de outrem, para cada tipo de perfil de risco e de cliente (atendendo à sua categoria e tipo de residência).

7.º Campo (Taxa de rendibilidade máxima)

A preencher com a taxa de rendibilidade verificada na carteira com melhor *performance*, para cada um dos conjuntos de carteiras identificados no 6.º campo.

Para este efeito a taxa de rendibilidade deve ser calculada da seguinte forma:

$$\left[\left(1 + \frac{VN_t - VN_{t-1}}{VN_{t-1}} \right)^{12} - 1 \right] \times 100$$

Sendo,

VN_t , o valor da carteira sob gestão no final do mês t, devidamente ajustado de eventuais depósitos e/ou levantamentos de activos que tenham ocorrido durante o mês t (i.e., deduzido dos depósitos e acrescido dos levantamentos, avaliados a preços de mercado da data em que ocorreram, verificados durante o mês em causa);

VN_{t-1} , o valor da carteira sob gestão no final do mês anterior (t-1).

As carteiras cuja gestão se inicie durante o mês t não deverão ser consideradas para o cálculo desta taxa de rendibilidade.

O campo deve ser preenchido em percentagem, com duas casas decimais, separadas por vírgulas. Se o valor da taxa for negativo o mesmo deve ser precedido de sinal (-).

Assim, por exemplo, se a taxa de rendibilidade for negativa em 1,73%, o campo deve ser preenchido com -1,73.

8.º Campo (Taxa de rendibilidade média)

A preencher com a taxa de rendibilidade média verificada para cada um dos conjuntos de carteiras identificados no 6.º campo, exceptuando as carteiras cuja gestão se inicie durante o mês t, as quais não deverão ser consideradas para o cálculo desta taxa de rendibilidade.

A taxa de rendibilidade deve ser calculada de acordo com a fórmula referida para o campo anterior.

O campo deve ser preenchido em percentagem, com duas casas decimais, separadas por vírgulas. Se o valor da taxa for negativo o mesmo deve ser precedido de sinal (-).

9.º Campo (Taxa de rendibilidade mínima)

A preencher com a taxa de rendibilidade verificada na carteira com pior *performance*, para cada um dos conjuntos de carteiras identificados no 6.º campo, exceptuando as carteiras cuja gestão se inicie durante o mês t, as quais não deverão ser consideradas para o cálculo desta taxa de rendibilidade.

A taxa de rendibilidade deve ser calculada de acordo com a fórmula referida para o 7.º campo.

O campo deve ser preenchido em percentagem, com duas casas decimais, separadas por vírgulas. Se o valor da taxa for negativo o mesmo deve ser precedido de sinal (-).

10.º Campo (Montante global sob gestão)

Este campo corresponde ao montante global sob gestão para cada um dos conjuntos de carteiras identificados no 6.º campo.

O campo montante deve ser preenchido em euros.

11.º Campo (Montante sob gestão da carteira com maior dimensão)

Este campo corresponde ao montante sob gestão da carteira com maior dimensão, para cada um dos conjuntos de carteiras identificados no 6.º campo. O campo montante deve ser preenchido em euros.

12.º Campo (Montante sob gestão da carteira com menor dimensão)

Este campo corresponde ao montante sob gestão da carteira com menor dimensão, para cada um dos conjuntos de carteiras identificados no 6.º campo. O campo montante deve ser preenchido em euros.

M – Exemplo da Tabela [CCG] – Tabela de acordo com o Anexo 4

A entidade registada na CMVM com o n.º 999, pretende reportar os seguintes elementos relativos ao mês de Março de 2002:

Informação Estatística sobre Actividade de Gestão de Carteiras por Conta de Outrem

Denominação da Sociedade: Xpto, S.A.

N.º Registo na CMVM: 999

Data a que respeita a Informação: 2002/03/31

Anexo 4 – Caracterização do tipo de carteiras geridas por conta de outrem, no último dia do mês.

Perfil de risco da carteira	Tipo de clientes	Residência do cliente	N.º de carteiras geridas	Taxas de rentabilidade obtidas			Montantes sob gestão		
				Máxima	Média	Mínima	Global	carteira com maior dimensão	carteira com menor dimensão
Alto	Pessoas singulares	Estrangeiro	5	10,62	5,54	-3,58	558945,63	186315,21	91239,21
	Pessoas singulares	Portugal	10	12,25	5,01	-2,31	4105966,72	684327,79	60238,87
	Pessoas colectivas não institucionais	Portugal	1	10,11	10,11	10,11	513245,84	513245,84	513245,84
	Fundos de pensões								
	Fundos de investimento	Portugal	2	7,53	7,06	6,58	2052983,36	1579217,97	473765,39
Outros clientes institucionais									
Médio	Pessoas singulares	Portugal	3	8,45	4,35	1,56	94236,88	62587,42	15824,73
	Pessoas colectivas não institucionais	Estrangeiro	1	6,58	6,58	6,58	58632,15	58632,15	58632,15
	Fundos de pensões								
	Fundos de investimento	Portugal	1	5,98	5,98	5,98	320486,55	320486,55	320486,55
Outros clientes institucionais									
Baixo	Pessoas singulares	Portugal	5	4,26	3,57	3,01	167538,63	55900,86	20456,10
	Pessoas colectivas não institucionais	Portugal	3	4,12	3,48	3,25	182477,22	91238,61	71576,23
	Pessoas colectivas não institucionais	Estrangeiro	2	3,55	3,06	2,56	111692,42	60825,74	50866,68
	Fundos de pensões								
	Fundos de investimento								
Outros clientes institucionais	Portugal	1	3,99	3,99	3,99	65487,23	65487,23	65487,23	
TOTAL			34				8231692,63	3678265,37	1741818,98

Formato para envio da informação em ASCII:

999; 20020331; AR; PS; E; 5; 10,62; 5,54; -3,58; 558945,63; 186315,21; 91239,21
999; 20020331; AR; PS; P; 10; 12,25; 5,01; -2,31; 4105966,72; 684327,79; 60238,87
999; 20020331; AR; PC; P; 1; 10,11; 10,11; 10,11; 513245,84; 513245,84;
513245,84
999; 20020331; AR; FI; P; 2; 7,53; 7,06; 6,58; 2052983,36; 1579217,97; 473765,39
999; 20020331; MR; PS; P; 3; 8,45; 4,35; 1,56; 94236,88; 62587,42; 15824,73
999; 20020331; MR; PC; E; 1; 6,58; 6,58; 6,58; 58632,15; 58632,15; 58632,15
999; 20020331; MR; FI; P; 1; 5,98; 5,98; 5,98; 320486,55; 320486,55; 320486,55
999; 20020331; BR; PS; P; 5; 4,26; 3,57; 3,01; 167538,63; 55900,86; 20456,10
999; 20020331; BR; PC; P; 3; 4,12; 3,48; 3,25; 182477,22; 91238,61; 71576,23
999; 20020331; BR; PC; E; 2; 3,55; 3,06; 2,56; 111692,42; 60825,74; 50866,68

Anexo 6
Listagem de Códigos de Mercados

PAÍS	DESIGNAÇÃO DA BOLSA	CÓDIGO
ÁFRICA DO SUL	Johannesburg Stock Exchange	JSE
ALEMANHA	Deutsche Börse	DB
	Deutsche Terminborse	DTB
ARGENTINA	Bolsa de Comércio de Buenos Aires	BCBA
AUSTRÁLIA	Sydney Futures Exchange	SFE
	Sydney Stock Exchange	SYSE
ÁUSTRIA	Vienna Stock Exchange	VNSE
BÉLGICA	EURONEXT Brussels	EB
BRASIL	Bolsa Brasileira de Futuros	BOBF
	Bolsa de Valores de São Paulo	BOVP
	Bolsa de Valores do Rio de Janeiro	BVRJ
CANADÁ	Montreal Stock Exchange	MTSE
	Toronto Futures Exchange	TRFE
	Toronto Stock Exchange	TRSE
	Vancouver Stock Exchange	VCSE
CHILE	Bolsa de Comércio de Santiago	BCSA
COREIA	Seoul Stock Exchange	SESE
DINAMARCA	Copenhagen Stock Exchange	CSE
ESLOVÉNIA	Ljubljana Stock Exchange	LJSE
ESPANHA	Bolsa de Valores de Barcelona	BVBA
	Bolsa de Valores de Bilbao	BVBI
	Bolsa de Valores de Madrid	BVMA
	Bolsa de Valores de Valência	BVVA
	MEFF Renda Fixa	MEFF
	MEFF Renda Variável	MEFV
EUA	American Stock Exchange	AMEX
	Boston Stock Exchange	BOSE
	Chicago Board Options Exchange	CBOE
	Chicago Board of Trade	CBOT
	Chicago Stock Exchange	CHSE
	Chicago Mercantile Exchange	CME
	Midwest Stock Exchange	MWSE
	National Assoc. of Securities Dealers Automatic Quotations	NSDQ
	New York Stock Exchange	NYSE
	Philadelphia Stock Exchange	PHSE
	Pacific Stock Exchange	PSE
EUROPA	EuroMTS	EMTS
	EASDAQ	ESDQ
FILIPINAS	Philippines Stock Exchange	PLSE
FINLÂNDIA	Finish Options Market	FOX
	Helsinki Stock Exchange	HSE
FRANÇA	MONEP – Marchés d'Options Négociables de Paris	MNEP
	MATIF	MTIF
	EURONEXT Paris	EP
GRÉCIA	Athens Stock Exchange	ASE
HOLANDA	EURONEXT Amsterdam	EA
	Financiele Termijnmarkts Amsterdam	FTA
PAÍS	DESIGNAÇÃO DA BOLSA	CÓDIGO
HONG-KONG	Hong Kong Futures Exchange	HKFE
	Stock Exchange of Hong-Kong	SEHK
HUNGRIA	Budapest Stock Exchange	BSE
IRLANDA	Irish Stock Exchange	ISE
ITÁLIA	Borsa Valori di Milano	BVMI
	Italian Stock Exchange	ITSE
JAPÃO	Hyroshima Stock Exchange	HYSE
	Kyono Stock Exchange	KYSE
	Niigata Stock Exchange	NGSE

	Nagoya Stock Exchange	NSE
	Osaka Securities Exchange	OSE
	Sapporo Stock Exchange	SPSE
	Tokyo International Futures Exchange	TIFE
	Tokyo Stock Exchange	TKSE
LUXEMBURGO	Luxemburg Stock Exchange	LXSE
MALÁSIA	Kuala Lumpur options & Financial Futures Exchange	KLOF
	Kuala Lumpur Stock Exchange	KLSE
MALTA	Malta Stock Exchange	MSE
MÉXICO	Bolsa de Valores Mexicana	BVM
NORUEGA	Oslo Bors	OSLB
NOVA ZELÂNDIA	New Zealand options & Financial Futures Exchange	NZOF
	New Zealand Stock Exchange	NZSE
PERÚ	Bolsa de Valores de Lima	BVLI
POLÓNIA	Warsaw Stock Exchange	WSE
PORTUGAL	EURONEXT Lisboa - Mercado de Cotações Oficiais	EL
	EURONEXT Lisboa - Mercado de Derivados	ELD
	EURONEXT Lisboa - Segundo Mercado	EL2
	EURONEXT Lisboa - Mercado Sem Cotações	ELS
	Mercado Especial de Dívida Pública	MDIP
REINO UNIDO	International Stock Exchange	INSE
	LIFFE – London International Financial Futures Exchange	LIFE
	London Stock Exchange	LSE
	London & South Stock Exchange	LSSE
	Midlands & West Stock Exchange	MLSE
	North East Stock Exchange	NESE
	Northern Ireland Stock Exchange	NISE
	North West Stock Exchange	NWSE
	Scotland Stock Exchange	SSE
SINGAPURA	Stock Exchange of Singapore	SES
	Singapore International Monetary Exchange	SMEX
SUÉCIA	Stockholm Stock Exchange	SSEX
SUÍÇA	Bourse de Bâle	BBL
	Bourse de Berne	BBRN
	Bourse de Genève	BGEN
	Bourse de Zurich	BZUR
	Eurex Zurich	EREX
TAILÂNDIA	Thailand Stock Exchange	THSE
TAIWAN	Taiwan Stock Exchange	TWSE
TURQUIA	Istambul Stock Exchange	ISSE
OUTROS – UNIÃO EUROPEIA	OUTROS – UNIÃO EUROPEIA	OUE
OUTROS –EUROPA	OUTROS –EUROPA	OEUR
PAÍS	DESIGNAÇÃO DA BOLSA	CÓDIGO
OUTROS – AMÉRICA DO NORTE	OUTROS – AMÉRICA DO NORTE	OAMN
OUTROS – AMÉRICA DO SUL	OUTROS – AMÉRICA DO SUL	OAMS
OUTROS - ÁSIA	OUTROS - ÁSIA	OASI
OUTROS	OUTROS	OUT

Anexo 7
Listagem de Códigos de Moedas

PAÍS	MOEDA	CÓDIGO
África do Sul	Rand Sul Africano	ZAR
Albânia	Lek Albanês	ALL
Argentina	Peso Argentino	ARS
Austrália	Dólar Australiano	AUD
Brasil	Real Brasileiro	BRL
Bulgária	Lev Búlgaro	BGN
Canadá	Dólar Canadano	CAD
China	China Renminbi	CNY
Chipre	Libra de Chipre	CYP
Coreia do Sul	Won Coreano	KRW
Dinamarca	Coroa Dinamarquesa	DKK
Eslováquia	Coroa Eslovaca	SKK
Eslovénia	Tolar da Eslovénia	SIT
Estados Unidos da América	Dólar dos EUA	USD
Estónia	Coroa da Estónia	EEK
Euro	Euro	EUR
Filipinas	Peso Filipino	PHP
Hong-Kong	Dólar de Hong-Kong	HKD
Hungria	Forint Húngaro	HUF
Índia	Rupia Indiana	INR
Islândia	Coroa Islandesa	ISK
Japão	Yen Japonês	JPY
Macau	Pataca	MOP
Malásia	Ringgit Malaio	MYR
Malta	Lira Maltesa	MTL
México	Peso Mexicano	MXN
Noruega	Coroa Norueguesa	NOK
Nova Zelândia	Dólar Neo Zelandês	NZD
Polónia	Zloty Polaco	PLZ
Reino Unido	Libra Esterlina	GBP
República Checa	Coroa Checa	CZK
Roménia	Leu Romeno	ROL
Singapura	Dólar de Singapura	SGD
Sri Lanka	Rupia do Sri Lanka	LKR
Suécia	Coroa Sueca	SEK
Suíça	Franco Suíço	CHF
Tailândia	Baht Tailandês	THB
Taiwan	Novo Dólar de Taiwan	TWD
Turquia	Lira Turca	TRL
Outras - América	Outras - América	OAM
Outras - Ásia	Outras - Ásia	OAS
Outras - Europa	Outras - Europa	OEU
Outras	Outras	OUT