

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes
Enviado: segunda-feira, 11 de Julho de 2011 12:59
Para: 'Rosario.Castano@ddgf.pt'
Assunto: FW: Instrumentos de Gestão de Risco Financeiro - Template
Anexos: Template DGTf Swap.xls

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio da informação.

Este ficheiro substitui o enviado às 11,13

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes

Enviada: segunda-feira, 11 de Julho de 2011 11:13

Para: 'Rosario.Castano@ddgf.pt'

Assunto: Instrumentos de Gestão de Risco Financeiro - Template

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio da informação.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

De: Rosário Castaño [mailto:Rosario.Castano@ddgf.pt]

Enviada: terça-feira, 5 de Julho de 2011 10:38

Assunto: Instrumentos de Gestão de Risco Financeiro - Template

Exmo. (a) Senhor (a)

Presidente do Conselho de Administração

Considerando a necessidade de dar cumprimento ao ponto 2. do Despacho n.º 896/2011-SETF, de 9 de Junho, solicita-se a V. Ex.ª o preenchimento e envio, até ao dia 11 de Julho p.f., do Template que se anexa, com a posição reportada a 30 de Junho.

Solicita-se ainda que este Template seja actualizado trimestralmente, devendo ser enviado a esta Direcção-Geral até ao final do mês subsequente ao final de cada trimestre.

Com os melhores cumprimentos.

Fernanda Martins

Fernanda Martins
Directora de Serviços de
Participações do Estado

Tel: 218846066 Fax: 218846252

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar nome do banco Identificar empréstimo de risco, investimento ou arbitragem Colocar nome do banco Colocar valor contratado Data do contrato Maturidade do contrato Descrição sucinta do valor a receber Descrição sucinta do valor a pagar (se forem swaps com fórmulas proprietárias, apenas fazer essa referência) Mark to market de final de 2009 Mark to market de final de 2010 Mark to market de final de Março 2011 Mark to market de final de Junho 2011 Mark to market de final de Setembro 2011 Mark to market de final de 2011

#	Counterparty	Underlying	Objective	Derivative	Notional	Contract date	Maturity	Leg 1 - receivable	Leg 2 - payment	MM 2009	MM 2010	MM 31/03/2011	MM 30/06/2011	MM 30/09/2011	MM 31/12/2011
1	Banco Português de Negócios	215 Milhões	Cobertura	Swap com taxa fixa crescente	215.000.000	17-Nov-05	17-Mar-16	Euro 3m + 0,07%	Taxa fixa crescente	-15.177.320	-13.899.570	-9.822.311	-9.771.053		
2	Banco Santander Totta	100 Milhões	Cobertura	Swap com barreiras	100.000.000	27-Mar-07	27-Mar-16	Euro 6m	Taxa fixa 2,95%, condicionada a evolução do spread CKIS Zanos -10anos	-6.970.927	-5.680.274	-4.951.217	-3.698.005		
3	Banco Santander Totta	90 Milhões	Cobertura	Swap com barreiras	90.000.000	15-Sep-06	15-Mar-19	Euro 6m	Taxa fixa 1,835%, condicionada a evolução do CMS 10anos	-16.984.710	-18.337.866	-12.064.245	-11.243.233		
4	Banco Espírito Santo	100 Milhões	Cobertura	Swap simples	100.000.000	10-Fev-09	10-Fev-19	Euro 3m	Euro 3m + 5,95%	-48.955.600	-45.015.855	-42.897.530	-42.179.366		
5															
6															
7															
8															
9															
10															
11															
12															
13															
14															
15															
n															
Total										-57.498.556	-82.926.566	-69.735.303	-66.892.547	0	0

Empresa: Companhia Carris de Ferro de Lisboa, SA

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos
 Código do contrato
 Códigos de identificação
 Variação Mark to market 2009
 Variação Mark to market 2010
 Variação Mark to market 2011
 Variação Mark to market Junho 2011
 Variação Mark to market Setembro 2011
 Variação Mark to market 2011

#	Counterparty	Notional	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011
1	BPN	275.000.000	-4.362.234	1.887.750	4.087.260	51.257		
2	BST	100.000.000	14.923.154	-1.953.157	729.057	1.262.212		
3	BST	90.000.000	1.887.259	690.653	6.273.621	821.022		
4	BES	100.000.000	-16.596.311	3.846.746	2.121.326	718.164		
5								
6								
7								
8								
9								
10								
11								
12								
13								
14								
15								
16								
17								
18								
19								
20								
21								
22								
23								
24								
25								
26								
27								
28								
29								
30								
31								
32								
33								
0	Total		0.148.138	4.571.991	13.191.263	2.842.896	0	0

(*) - Variação face a final de 2010

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar nome do Banco	Colocar valor contratado	Saldo entre recebimentos e pagamentos 2009	Saldo entre recebimentos e pagamentos 2010	Saldo entre recebimentos e pagamentos Março 2011 *	Saldo entre recebimentos e pagamentos Junho 2011 *	Saldo entre recebimentos e pagamentos Setembro 2011 *	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2011 *	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2012	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2013	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2014	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2015	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2016	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2017	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2018	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2019	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro Ano N
-----------------------	--------------------------	--	--	--	--	---	---	---	---	---	---	---	---	---	---	--

#	Counterparty	Notional	Cash-flow 2009	Cash-flow 2010	Cash-flow 31/03/2011 (Real)	Cash-flow 30/06/2011 (Real)	Cash-flow 30/09/2011 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2011 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2012 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2013 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2014 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2015 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2016 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2017 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2018 (Prev.)	Cash-flow 31/12/2019 (Prev.)	Cash-flow 31/12/yyyy (Prev.)
1	BPN	215 000 000	-2 573 538	-6 843 023	-1 490 181	-1 357 309	-1 167 679	-1 135 812	-3 521 701	-2 273 777	-1 348 225	-546 506	-79 667	-79 667	-79 667	-79 667	-79 667
2	BST	100 000 000	-477 803	-1 988 350	-166 344	-629 922	-753 889	154 564	-823 500	-306 480	57 225	178 210	-93 212	-93 212	-93 212	-93 212	-93 212
3	BST	90 000 000	1 532 618	-708 605	81 145	-67 925	-378 542	304 446	202 282	448 813	604 086	662 841	570 550	410 553	201 888	201 888	201 888
4	BES	100 000 000	-4 464 550	-6 032 639	-1 520 556	-1 470 972	-1 520 556	-1 520 556	-6 048 167	-6 032 639	-6 032 639	-6 032 639	-6 048 167	-6 032 639	-6 032 639	-6 032 639	-6 032 639
5		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
6		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
7		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
8		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
9		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
10		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
11		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
12		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
13		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
14		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
15		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
16		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
17		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
18		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
19		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
20		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
21		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
22		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
23		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
24		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
25		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
26		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
27		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
28		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
29		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
30		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
31		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
32		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
33		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
n	Total		-5.983.273	-16.572.617	-3.095.935	-3.626.129	-3.840.865	-2.197.357	-10.192.086	-8.164.063	-6.719.550	-5.738.093	-5.651.095	-5.794.954	-6.003.630	-1.708.726	0

(*) - Valores acumulados

