

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes
Enviado: segunda-feira, 28 de Janeiro de 2013 11:20
Para: 'Helena Llorente'
Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'
Assunto: Actualização de informação dos IGRF a 31 de Dezembro de 2012
Anexos: Template DGTf Dezembro12.xls

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio da informação reportada a 31/12/2012.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financeiro e de Controlo de Gestão
DFG

De: Sousa Bentes

Enviada: quarta-feira, 17 de Outubro de 2012 9:27

Para: 'Helena Llorente'

Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'

Assunto: Actualização de informação dos IGRF a 30 de Setembro de 2012

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio da informação reportada a 30/9/2012.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financeiro e de Controlo de Gestão
DFG

Carris 

De: Sousa Bentes

Enviada: sexta-feira, 13 de Julho de 2012 15:51

Para: 'Helena Llorente'

Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'

Assunto: RE: Actualização de informação dos IGRF a 30 de Junho de 2012

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

Director Financeiro e de Controlo de Gestão

De: Sousa Bentes

Enviada: segunda-feira, 7 de Maio de 2012 10:16

Para: 'Helena Llorente'

Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'

Assunto: FW: Atualização de informação dos IGRF a 31 de Março de 2012

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

Director Financeiro e de Controlo de Gestão
DFG

CARIS 

De: Silva Rodrigues

Enviada: terça-feira, 24 de Abril de 2012 16:11

Para: Sousa Bentes

Assunto: FW: Atualização de informação dos IGRF a 31 de Março de 2012

Dr. Sousa Bentes,

Para os devidos efeitos:

MSR

De: Helena Llorente [mailto:Helena.Llorente@ddtf.pt]

Enviada: terça-feira, 24 de Abril de 2012 16:02

Assunto: Atualização de informação dos IGRF a 31 de Março de 2012

Exmo. (a) Senhor (a)

Presidente do Conselho de Administração

Considerando a necessidade de dar cumprimento ao ponto 2. do Despacho nº 896/2011-SETF, de 9 de Junho, solicita-se a V. Ex.ª a actualização da informação relativa a IGRF, nos moldes habitualmente enviados, com a maior brevidade possível, com a posição reportada a 31 de Março de 2012.

Solicita-se ainda que seja mantida uma linha por instrumento contratado de molde a facilitar o tratamento e análise dos dados.

Com os melhores cumprimentos.

Fernanda Martins



MINISTÉRIO DAS FINANÇAS
DIRECÇÃO-GERAL DE SERVIÇOS ESPECIAIS

www.dgff.pt

Fernanda Martins
Directora de Serviços de
Participações do Estado

Tel: 21 8846068 Fax: 21 8846282

Empresa: _____

CARRIS

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Objetivo cobertura: Tipo de instrumento derivado: Colocar valor: Data do contrato: Maturidade do contrato: Descrição sucinta do valor a receber: Descrição sucinta do valor a pagar (se forem swaps com fórmulas próprias, apertar fazer esta 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: Mark to market de final de Março 2012: Mark to market de final de Junho 2012: Mark to market de final de Setembro 2012: Mark to market de final de Dezembro 2012:

#	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	MM 31/03/12	MM 30/06/12	MM 30/09/12	MM 31/12/12	
1	Banco Portugues de Negocios			Swap com taxa fixa crescente			17-Mar-16	EUR 3m + 0.07%	Taxa fixa crescente		-13.889.570	-9.822.211	-9.771.053	-12.208.106	-12.981.929	-13.801.400	-13.835.025	-13.555.179	-12.860.480	
2	Banco Santander Total			Swap com baretas			27-Mar-16	EUR 6m	Taxa fixa 2,95%, condicionada à evolução do spread CMS Zanon -1ano				3.599.905	-6.531.439	4.920.971	4.669.007	4.453.654	4.554.041	3.891.711	
3	Banco Santander Total			Swap com baretas			15-Mar-19	EUR 6m	Taxa fixa 1,35%, condicionada à evolução do spread CMS Zanon -1ano				-11.245.223	-32.074.959	-34.961.734	-32.989.833	4.7.868.534	57.382.842	63.235.795	
4	Banco Espirito Santo			Swap simples			11-Feb-19	EUR 3m	EUR 3m - 5,95%		-45.018.555	-42.887.536	-42.179.359	-43.385.537	-42.447.993	-42.722.114	-41.824.223	-40.973.809	-39.554.453	
5																				
6																				
7																				
8																				
9																				
10																				
11																				
12																				
13																				
14																				
15																				
n																				
Total										0	-48.908.428	-52.719.840	-46.892.547	-34.208.040	-95.322.827	-94.172.415	-107.981.437	-116.545.471	-120.142.490	

Empresa: CARRIS

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar nome do banco	Colocar valor contratado	Variação Mark to market 2009	Variação Mark to market 2010	Variação Mark to market Março 2011 *	Variação Mark to market Junho 2011 *	Variação Mark to market Setembro 2011 *	Variação Mark to market 2011 *	Variação Mark to market Março 2012 *	Variação Mark to market Junho 2012 *	Variação Mark to market Setembro 2012 *	Variação Mark to market Dezembro 2012 *	
#	Counterparty	Notional	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011	31-03-2012	30-06-2012	30-09-2012	31-12-2012
1	BPN				4.067.260	51.257	-2.435.052	-765.823	-809.471	-33.625	179.846	794.688
2	BST						-2.932.434	1.710.468	255.964	211.353	-100.387	662.330
3	BST						-20.831.735	-2.886.775	1.977.901	-14.884.701	-9.494.108	-6.073.153
4	BES				2.121.326	718.164	-1.206.171	937.544	-274.181	857.951	890.654	1.019.116
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												
n												
Total			0	0	6.188.585	768.421	-27.405.393	-1.024.587	1.180.212	-13.808.022	-8.664.034	-3.667.019

(*)- Variação face a final de 2010.

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

	Colocar nome do contrato	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 Setembro 2011 *	Saldo entre recebimentos e pagamentos Dezembro 2011	Saldo entre recebimentos e pagamentos Março 2012 *	Saldo entre recebimentos e pagamentos Junho Setembro 2012 *	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 (Real)	Cash-flow 31/12/2011 (Real)	Cash-flow 31/03/2012 (Real)	Cash-flow 30/06/2012 (Real)	Cash-flow 30/09/2012 (Real)	Cash-flow 31/12/2012 (Real)	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 31/12/20YY (Prev.)
1	BPN	0	0	0	-1.450.181	-1.357.309	-1.187.679	-1.052.952	-1.114.933	-1.250.223	-1.480.731	-1.527.741	-3.504.046	-4.104.007	-2.491.110	-809.335	-6.589.114	-6.032.639	-2.577.429	-4.512.053	0
2	BST	0	0	0	-198.344	-629.922	-753.899	154.664	131.444	-195.446	-753.899	-274.978	-2.349.063	-1.626.870	-919.035	-186.424	-6.589.114	-6.032.639	-2.577.429	-397.763	0
3	BST	0	0	0	81.148	-67.925	-588.158	329.219	-40.031	88.928	-1.597.685	-1.846.595	-12.207.426	-15.192.288	-14.500.512	-11.419.810	-6.589.114	-6.032.639	-2.577.429	-4.512.053	0
4	BES	0	0	0	-1.520.556	-1.470.972	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.487.690	-1.520.556	-1.520.556	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	0
5		0	0	0																	
6		0	0	0																	
7		0	0	0																	
8		0	0	0																	
9		0	0	0																	
10		0	0	0																	
11		0	0	0																	
12		0	0	0																	
13		0	0	0																	
14		0	0	0																	
15		0	0	0																	
16		0	0	0																	
17		0	0	0																	
18		0	0	0																	
19		0	0	0																	
20		0	0	0																	
21		0	0	0																	
22		0	0	0																	
23		0	0	0																	
24		0	0	0																	
25		0	0	0																	
26		0	0	0																	
27		0	0	0																	
28		0	0	0																	
29		0	0	0																	
30		0	0	0																	
31		0	0	0																	
32		0	0	0																	
33		0	0	0																	
TOTAL			0	0	-3.098.935	-3.526.129	-4.047.282	-2.119.135	-2.544.974	-2.384.240	-5.252.830	-5.169.720	-26.123.735	-26.955.804	-22.842.355	-18.460.755	-13.021.723	-8.710.068	-4.509.846	0	0

(*) - Valores acumulados

