

Contratos LGRE - MTM

Empresa	#	Counterparty	Origem Banco	Contraparte Uniformizada	Underlying	Objetivo	Derivativo	Notional	Contract date	Leg 1 - receivables	Leg 2 - payments	MM 2009	MM 2010	MM 31/03/2011	MM 30/09/2011
Metro Lisboa	63	BNP	Estrangeiros	BNP Paribas	OBRIGACOES 2027	Cobertura	Sweep Taxa Juro	100.000.000	25-04-2010	07-12-2027 4,79% ANUAL,ACT/FACT	De 2009-02-07 a 2012-12-07 2M EURIBOR -1,00%, ANUAL, ACT/360CAP	30.137.358	-7.070.272	9.751.625	-7.800.864
Metro Lisboa	64	CREDIT SUISSE	Estrangeiros	Credit Suisse	TREM I	Cobertura	Sweep Taxa Juro	81.421.457	25-08-2010	20-03-2020 6M EURIBOR, SEM, ACT/360De 2011-03-21 a 21-03-21	De 2007-03-20 a 2009-09-30 3M187M, SEM, ACT/360De 2009-09-30 a 2010-03-30M4	-1.723.200	-5.461.966	-2.847.615	-3.560.823
Metro Lisboa	65	CREDIT SUISSE	Estrangeiros	Credit Suisse	TREM II	Cobertura	Sweep Taxa Juro	89.229.943	25-08-2010	24-09-2021 6M EURIBOR, SEM, ACT/360De 2011-03-21 a 21-03-21	De 2007-03-24 a 2009-09-24 0,89%, SEM, ACT/360 De 2009-09-24 a 2010-02-02	-3.759.954	-9.821.180	-6.129.948	-6.583.117
Metro Lisboa	66	JPM MORGAN	Estrangeiros	JPM Morgan	TREM I e II	Cobertura	Sweep Taxa Juro	99.242.295	06-06-2005	23-09-2022 6M EURIBOR (M, 0,75%, SEM, 30/360) 66%, TRM	De 2005-09-21 a 2009-09-21 1,15%, SEM, 30/360 + SPRA(Anteriores), MM,ACT/360	11.852.700	11.852.700	11.852.700	11.852.700
Metro Lisboa	67	JPM MORGAN	Estrangeiros	JPM Morgan	TREM I e II	Cobertura	Sweep Taxa Juro	400.000.000	26-01-2009	04-03-2019 6,75%, ANUAL,FEUR 23.000.000 VALOR F	De 2010-02-24 a 2011-02-04 18%, SEM, ACT/360	-43.255.548	28.996.564	2.246.908	12.475.827
Metro Lisboa	68	BARCLAYS	Estrangeiros	Barclays	OBRIGACOES 2019	Cobertura	Sweep Taxa Juro	100.000.000	08-04-2011	04-03-2019 6M EURIBOR, SEM, ACT/360	De 2010-02-24 a 2011-02-04 18%, ANUAL, ACT/360De 2011-02-04 a 2013-02-04	-5.532	-10.415.869	-2.046.066	-6.415.060
Metro Lisboa	69	CITIBANK	Estrangeiros	Citibank	OBRIGACOES 2019	Reestruturação	Sweep Taxa Juro	300.000.000	11-03-2011	21-07-2016 Em 2016-07-21TAXA 40,7616%	De 2009-07-21 a 2010-07-21 3,00%, ANUAL, ACT/360	0	-10.881.557	-2.046.066	-6.415.060
Metro Lisboa	70	GOLDMAN SACHS	Estrangeiros	Goldman Sachs	GOLDMAN SACHS	Cobertura	Sweep Taxa Juro	71.042.000	11-03-2011	24-07-2016 Em 2016-07-21TAXA 41,096884%TAXA	De 2009-07-21 a 2010-07-21 3,00%, ANUAL, ACT/360 De 2010-07-21 a 2016-07-21	664.417	-2.819.966	-4.186.710	-2.482.708
Metro Lisboa	71	GOLDMAN SACHS	Estrangeiros	Goldman Sachs	GOLDMAN SACHS	Cobertura	Sweep Taxa Juro	50.000.000	11-03-2011	18-09-2016 De 2009-06-18 a 2010-06-18 1,60% EURIBOR	De 2009-07-24 a 2010-07-24 3,00%, ANUAL, ACT/360 De 2010-07-24 a 2016-07-24	2.956.517	-2.105.461	-4.950.000	-1.617.800
Metro Lisboa	72	GOLDMAN SACHS	Estrangeiros	Goldman Sachs	DEUTSCHE BANK	Cobertura	Sweep Taxa Juro	25.500.000	27-07-2009	18-09-2016 De 2009-06-18 a 2010-06-18 1,60% EURIBOR	De 2009-06-18 a 2010-06-18 1,60%, SEM, ACT/360De 2010-06-18 a 2011-06-18	18.836	18.836	749.826	-128.926
Metro Lisboa	73	DEUTSCHE BANK	Estrangeiros	Deutsche Bank	DEUTSCHE BANK III	Cobertura	Sweep Taxa Juro	24.500.000	27-07-2009	30-12-2030 6M EURIBOR, SEM, ACT/360	De 2009-06-18 a 2010-06-18 1,60%, SEM, ACT/360De 2010-06-18 a 2011-06-18	656.740	413.797	979.832	993.323
Metro Lisboa	74	DEUTSCHE BANK	Estrangeiros	Deutsche Bank	DEUTSCHE BANK III	Cobertura	Sweep Taxa Juro	300.000.000	30-12-2010	22-10-2022 Euribor 6 meses	Taxa fixa de 2,55%, SEM, ACT/360	-617.296	-17.695.815	-6.846.663	-10.843.567
Metro Lisboa	75	DEUTSCHE BANK	Estrangeiros	Deutsche Bank	DEUTSCHE BANK III	Cobertura	Sweep Taxa Juro	75.000.000	12-11-2007	22-10-2022 Euribor 6 meses	Taxa fixa de 2,55%, SEM, ACT/360	-6.031.461	-3.033.617	-3.033.617	-3.776.037
Metro Lisboa	76	BARCLAYS	Estrangeiros	BNP Paribas	Emprestimo Obrigaco	Diversificação	Sweep Taxa Juro	50.000.000	12-11-2007	22-10-2022 Euribor 6 meses	Taxa fixa de 2,55%, SEM, ACT/360	-7.487.000	-4.950.000	-4.950.000	-5.600.000
Adp	2	Citigroup	Estrangeiros	Citibank	Emprestimo Obrigaco	Cobertura	Sweep Taxa Juro	20.000.000	08-02-2010	23-01-2023 Euribor 6 meses	Taxa fixa de 3,85%, a partir de jan/2012 (com opção de banco por outro collar)	3.777.035	-205.160	-205.160	-205.160
Adp	4	BBVA	Estrangeiros	BBVA	Emprestimo Obrigaco	Cobertura	Sweep Taxa Juro	20.000.000	08-02-2010	23-01-2023 Euribor 6 meses	Taxa fixa de 3,85%, a partir de jan/2012 (com opção de banco por outro collar)	3.777.035	-205.160	-205.160	-205.160
Adp	5	BBVA	Estrangeiros	BBVA	Emprestimo Obrigaco	Cobertura	Sweep Taxa Juro	20.000.000	08-02-2010	23-01-2023 Euribor 6 meses	Taxa fixa de 3,85%, a partir de jan/2012 (com opção de banco por outro collar)	3.777.035	-205.160	-205.160	-205.160
Adp	6	BIM	Estrangeiros	Bank of Tokyo Mitsubishi	Colocação privada	Cobertura	Sweep Taxa Juro	77.770.000	13-09-2005	29-09-2015 Taxa fixa leve + spread +- , cambio fixo	Taxa fixa 1,93% + spread 57 bp	1.301.578	7.125.938	5.347.792	5.100.832
Adp	7	BIM	Estrangeiros	Bank of Tokyo Mitsubishi	Colocação privada	Cobertura	Sweep Taxa Juro	22.227.000	13-09-2005	29-09-2015 Taxa fixa leve + spread +- , cambio fixo	Taxa fixa 1,93% + spread 57 bp	1.301.578	7.125.938	5.347.792	5.100.832
TAP	1	Banco Espírito Santo	Nacionais	BES	Aircraft Lease Agreem	Cobertura	Sweep Taxa Juro	41.761.305,90	24-11-2009	25-11-2019 Juro sobre o capital em divida	Juro sobre o capital em divida	-1.413.207,24	-1.413.207,24	408.395	-315.900,15

Contratos IGRF- Variação MTM

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos Colocar nome do banco Colocar valor contratado

Empresa	#	Counterparty	Nominal	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011
				Variation Mark to market 2009	Variation Mark to market 2010	Variation Mark to market Março 2011 *	Variation Mark to market Junho 2011 *	Variation Mark to market Setembro 2011 *	Variation Mark to market 2011 *
APA	1	Banco Santander Totta, S.A.	12.000.000	601.621	-145.619	0	-425.065		
ANA	1	BBVA - Banco Bilbao Vizcaya Argent	21.500.000						
Barclays	1	BPN	215000000	-6362233,66	1887749,86	4087259,681	51257,22866		
Barclays	2	BST	14923153,85	-1953156,5	729056,85	729056,85	1252211,96		
Barclays	3	BST	1887252,5	690652,77	6273620,52	6273620,52	821022,36		
Barclays	4	BES	100000000	-16596311	3946744,59	2121325,645	718164,2569		
CP	1	Deutsche Bank	560930,3397	-732132,507	534628,9871	311444,3984	-1398091,422		
CP	2	Deutsche Bank	58900000	-1436714,183	1811670,926	1290570,139	-62973,4443		
CP	3	JP Morgan	250000000	-37357894,97	13184463,47	9987207,916	-930390,3414		
CP	4	BNP	200000000	-45060619,11	3269971,19	6598385,666	-1273785,252		
CP	5	Barclays	300000000	-9508277,945	-1282406,29	-1289761,247	-2576240,858		
CP	6	Citigroup	375000000	-6445777,502	-1332360,102	3155937,727	-1094379,289		
CP	7	BES	281183405,4	8486740,823	10448955,64	859670,3062	1725026,059		
CP	8	BES	62000000	-4805712,063	5117241,046	859670,3062	1725026,059		
CP	9	RBS	75000000	-3069759,341	-1674871,077	1618270,022	-414310,1368		
CP	10	Barclays	122280000	-5854438,468	-1141401,342	3189184,17	-1327106,063		
Metro porto	1	Santander	80.220.488	-69.480.026	-110.430.961	78.724.471	56.221.323		
Metro porto	2	Credit Suisse	80.220.488	30.290.406	-9.385.036	6.067.878	5.784.433		
Metro porto	3	Santander	57.000.000	-6.480.165	357.910	-3.233.938	3.985.636		
Metro porto	4	DEPPA	38.000.000	-4.368.979	287.476	-2.139.581	3.349.757		
Metro porto	5	BNP Paribas	243.930.128	-25.867.773	-1.257.696	12.340.239	10.796.543		
Metro porto	6	Deutsche	84.000.000	5.318.257	-13.059.521	7.519.725	9.272.183		
Metro porto	7	Deutsche	42.000.000						
Metro porto	8	Deutsche	105.000.000	-4.064.024	-2.802.033	4.008.278	2.988.473		
Metro porto	9	BNP Paribas	100.000.000	-2.270.152	5.814.266	3.636.122	2.081.431		
Metro porto	10	JP Morgan	17.308.551	-17.308.551	-6.788.982	6.206.443	5.335.308		
Metro porto	11	Credit Suisse	200.000.000	-56.062.829	3.053.581	1.413.380	579.900		
Metro porto	12	Normura	75.000.000	-8.588.306	2.784.442	262.720	-371.323		
Metro porto	13	Goldman Sachs	126.000.000	40.104.568	7.521.201	1.605.721	388.251		
Metro porto	14	Normura	126.000.000	-37.343.296	-31.575.118	3.867.178	-821.619		
Metro porto	15	BCP	80.220.488	-647.569	-1.811.144	1.827.597	1.240.786		
Refer	1	BES	200000000	-7066298	977750	1724710	3375282,32		
Refer	2	JP Morgan	300000000	2831920,045	12723133,89	8396830,38	5914173,988		
Refer	3	Merrill Lynch	150000000	29181540,85	-3074224,705	-1777779,235	-2584856,059		
Refer	4	Barclays	150000000	5394177	2251667	-8046843	-5725693		
Refer	5	ABN	200000000	-88429,06	407503,84	69992,05	176364,57		
Refer	6	Barclays	500000000	-1306195	-1731666	1317579	3810888		
Refer	7	Barclays	200000000	-1730481	-1280441	115697	1154860		
Refer	8	BNP Paribas	150000000	4310264	3417709	-73800884	-5100065		
Refer	9	SG	250000000	-4035571	10324980	-6148756	1930371		
Refer	10	JP Morgan	150000000		-13704721,88	8137055,416	5717359,031		
Refer	11	SG	100000000		-347487	-17522	-8145		
Refer	12	ABN	300000000	-6519449,02	5570930,76	-2586,35	3137131,26		
Refer	13	JP Morgan	100000000	-4376689,116	3488541,57	-1753125,178	-2345336,454		
Refer	14	Santander Totta	250000000	-4970960,35	5502446,89	0	0		
Refer	15	BPI	150000000	6002116	-11302116	0	0		
Refer	16	Barclays	250000000	0	0	0	0		
Refer	17	Santander Totta	250000000	0	0	0	0		
Refer	18	JP Morgan	250000000	-3126550	0	0	0		
STCP	1	Banco Santander Totta	250000000	-1270073,24	-17988657,61	13310121,26	8536835,65		
STCP	2	BNP Paribas	250000000	2148918	-2100704	1185814	695703		
Transteljo	1	BPI	27.500.000 €	-446.643	-434.283	1.827.597	-289.576		
Transteljo	2	BPI	27.500.000 €	278.630	67.074	452.112	-100.860		
Transteljo	3	Barclays Bank	27.500.000 €	-511.735	-182.876	296.940	-387.542,39		
ANA	1	Deutsche Bank	300000000	-962044,41	-579897,15	788176,73	-799280,23		
Parapublica	1	Deutsche Bank	150.000.000,00	2207155,51	396242,94	-1722712,13	699312,73		
Parapublica	2	Deutsche Bank	150.000.000,00	6865231,64	676353,48	-2027313,46	1639418		
Parapublica	3	Barclays Capital	250.000.000,00	-1434383	-1895318	270908	0		
Parapublica	5	Bondholders EDP	n/a	24792576	7816655	-7816655	0		
Parapublica	6	Bondholders GALP	n/a		86114147	-11078686	34063766		
Parapublica	1	Deutsche Bank AG	125000000 NA	-753930,2	-10581165,44	1250905,66	1071807,15		
Metro Lisboa	1	BBVA	36.122.150		-489.360	401410,04	178183,95		
Metro Lisboa	2	MERRILL LYNCH	22.576.344	0	0	0	0		
Metro Lisboa	3	SANTANTER TOTTA	-376323,12	158.736	-146796,55	-132532,42	-103738		
Metro Lisboa	4	BARCLAYS	29.616.125	119633,46	-311.591	-89167,99	92350,39		
Metro Lisboa	5	SANTANTER TOTTA	-675,59	164.097	62406,83	-90160,84	-82059,5		
Metro Lisboa	6	BARCLAYS	25.385.250	206330,7	-90.038	60160,84	-1568224,03		
Metro Lisboa	7	DEUTSCHE BANK	18.704.921	6613,24	5.864	-14158408,41	6572915,78		
Metro Lisboa	8	SANTANDER TOTTA	78.560.669	-1384385,36	-1.011.332	1146149,2	349790,07		
Metro Lisboa	9	JP MORGAN	21.947.108	430523,94	-1.020.385	349790,07	107945,03		
Metro Lisboa	10	SANTANDER TOTTA	29.927.874	-133514,86	384.922	250719,38	388754,61		
Metro Lisboa	11	RBS	21.947.107	288765,37	-381.473	-259572,28	-401885,47		
Metro Lisboa	12	BNPP	-316876,57	-207.067	204257,49	94822,09	214816,56		
Metro Lisboa	13	BBVA	33.751.991	-802001,91	-1.253.756	503070,97	-214816,56		

Contratos IGRF- Variação MTM

Empresa	#	Counterparty	Nacional	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011
Metro Lisboa	14	MERRILL LYNCH	23.277.235	0	0	0	0	0	0
Metro Lisboa	15	SANTANDER TOTTA	19.951.916	-99720,55	264.187	175742,11	271838,55	271838,55	271838,55
Metro Lisboa	16	BARCLAYS	19.286.862	2761188,03	-377.971	-1937566,73	-1805017,4	-1805017,4	-1805017,4
Metro Lisboa	17	DEUTSCHE BANK	88.458.302	1623557,26	-401.148	-366790,75	-915877,82	-915877,82	-915877,82
Metro Lisboa	18	SOC GENERALE	95.602.930	0	-25.916.204	4197336,02	3008930,38	3008930,38	3008930,38
Metro Lisboa	19	BNPP	33.751.991	-8666208,84	1.338.207	789920,41	2391360,31	2391360,31	2391360,31
Metro Lisboa	20	SANTANDER TOTTA	39.903.832	-249593,34	629.272	429679,43	701887,7	701887,7	701887,7
Metro Lisboa	21	BARCLAYS	1782905,25	-13610925,36	-998.349	-5442405,29	-5456642,63	-5456642,63	-5456642,63
Metro Lisboa	22	BES INV	53.038.843	-13610925,36	-2.110.300	1241303,5	3390217,36	3390217,36	3390217,36
Metro Lisboa	23	DEUTSCHE BANK	152.632.157	-2784138,61	224.881	406149,51	-3111595,66	-3111595,66	-3111595,66
Metro Lisboa	24	DEUTSCHE BANK	150.000.000	-6108755,15	-8.137.739	2774213,03	-1072358,46	-1072358,46	-1072358,46
Metro Lisboa	25	BARCLAYS	80.000.000	9460,58	15.977.359	1097101,81	-891470,15	-891470,15	-891470,15
Metro Lisboa	26	SANTANDER TOTTA	40.000.000	-553971,2	-1.143.130	1204730,95	527083,97	527083,97	527083,97
Metro Lisboa	27	BNPP	40.000.000	0	4.284.370	365842,99	-897261,77	-897261,77	-897261,77
Metro Lisboa	28	JP MORGAN	40.000.000	0	2.210.767	-672546,22	-372248,49	-372248,49	-372248,49
Metro Lisboa	29	BNPP	40.000.000	-998008,75	-1.461.466	1018678,1	283832,07	283832,07	283832,07
Metro Lisboa	30	SANTANDER TOTTA	632.447.639	-214608,87	338.198	212835,83	333903,86	333903,86	333903,86
Metro Lisboa	31	CREDIT SUISSE	1143512,74	-539471,43	-6.394.548	4262889,31	7193824,3	7193824,3	7193824,3
Metro Lisboa	32	SANTANDER TOTTA	1.541.683	-539471,43	25.720.016	18667331,47	14787359,92	14787359,92	14787359,92
Metro Lisboa	33	JP MORGAN	12.545.916	-10411234,18	5.232.916	-2974170,15	-1869774,65	-1869774,65	-1869774,65
Metro Lisboa	34	CAIXA BI	12.545.916	-10411234,18	5.232.916	-2974170,15	-1869774,65	-1869774,65	-1869774,65
Metro Lisboa	35	DEUTSCHE BANK	20.391.096	8510546,83	3.261.590	3701144,2	292207,6	292207,6	292207,6
Metro Lisboa	36	MERRILL LYNCH	77.313.674	0	6.445.746	-1193898,58	-1804388,23	-1804388,23	-1804388,23
Metro Lisboa	37	MERRILL LYNCH	1774981,45	1774981,45	57.759	670683,48	399169,86	399169,86	399169,86
Metro Lisboa	38	SANTANDER TOTTA	-81876,16	-81876,16	88.371	516758,51	527134,32	527134,32	527134,32
Metro Lisboa	39	SANTANDER TOTTA	61.189.738	-803457,5	-199.185	714139,06	519291,82	519291,82	519291,82
Metro Lisboa	40	SANTANDER TOTTA	92.497.212	-18641877,55	-11.741.910	1581072,52	-25647995,43	-25647995,43	-25647995,43
Metro Lisboa	41	JP MORGAN	34.769.094	5198593,96	-54.845	-983728,77	-788343,63	-788343,63	-788343,63
Metro Lisboa	42	CAIXA BI	34.769.094	5198593,96	-54.845	-983728,77	-788343,63	-788343,63	-788343,63
Metro Lisboa	43	MORGAN STANLEY	100.000.000	4017416,65	-6.091.648	3431190,38	186946,7	186946,7	186946,7
Metro Lisboa	44	CREDIT SUISSE	100.000.000	4551173,64	5.274.973	-1970095,5	5241562,94	5241562,94	5241562,94
Metro Lisboa	45	SOC GENERALE	100.000.000	0	27.961.703	2931860,56	531953,97	531953,97	531953,97
Metro Lisboa	46	SANTANDER TOTTA	100.000.000	4457647,35	-6.092.026	3403470,78	1851326,97	1851326,97	1851326,97
Metro Lisboa	47	CREDIT SUISSE	100.000.000	-27872,93	-7.914	10784,61	22368495,23	22368495,23	22368495,23
Metro Lisboa	48	BARCLAYS	100.000.000	2254,34	-21.446	16425518,22	16121052,67	16121052,67	16121052,67
Metro Lisboa	49	JP MORGAN	100.000.000	42550634,69	-27.159.383	-2024520,4	-125918,78	-125918,78	-125918,78
Metro Lisboa	50	BBVA	13896701,92	-2.346.066	3193954,26	3012312,36	3012312,36	3012312,36	3012312,36
Metro Lisboa	51	DEUTSCHE BANK	75182288,4	-7.171.969	6.147.635,48	-6169936,62	-6169936,62	-6169936,62	-6169936,62
Metro Lisboa	52	MERRILL LYNCH	10901418,94	0	7.656.247	-93027,8	30523,35	30523,35	30523,35
Metro Lisboa	53	CGD	30.000.000	0	5.571.575	-93027,8	30523,35	30523,35	30523,35
Metro Lisboa	54	CREDIT SUISSE	3649237,82	32.065.792	32.065.792	-32851760,17	-256661211,25	-256661211,25	-256661211,25
Metro Lisboa	55	DEUTSCHE BANK	70.000.000	5577,4	-2.774	-38119774,11	-39224763,11	-39224763,11	-39224763,11
Metro Lisboa	56	BARCLAYS	200.000.000	-714073,58	-90.181	-86106,33	29960,27	29960,27	29960,27
Metro Lisboa	57	JP MORGAN	170.000.000	1546328,3	1.379.301	1404551,91	7910357,92	7910357,92	7910357,92
Metro Lisboa	58	JP MORGAN	30.000.000	-17944495,04	8.922.100	-590761,41	-43554,94	-43554,94	-43554,94
Metro Lisboa	59	BARCLAYS	100.000.000	39769247,15	-39.248.224	-13889010,06	-17392770,96	-17392770,96	-17392770,96
Metro Lisboa	60	CAIXA BI	123217,49	-123217,49	5.725.150	-556281,55	3189978,21	3189978,21	3189978,21
Metro Lisboa	61	BARCLAYS	1570340,23	6407,97	76.392	23941994,28	22780691,38	22780691,38	22780691,38
Metro Lisboa	62	JP MORGAN	100.000.000	99023629,27	-4.493	-53769246,74	-54910443,78	-54910443,78	-54910443,78
Metro Lisboa	63	BNPP	100.000.000	6407,97	-37.997.630	-1881352,46	69288,47	69288,47	69288,47
Metro Lisboa	64	CREDIT SUISSE	81.421.457	10832892,91	-3.738.046	2514350,42	1901342,59	1901342,59	1901342,59
Metro Lisboa	65	CREDIT SUISSE	89.226.943	12580278,56	-6.211.226	3791232,05	3338063	3338063	3338063
Metro Lisboa	66	SANTANDER TOTTA	99.240.265	-23491541,42	-60.726.119	2184072,48	-14935060,44	-14935060,44	-14935060,44
Metro Lisboa	67	JP MORGAN	90.036.707	-44749159,21	56.043.492	-69377,02	674760,8	674760,8	674760,8
Metro Lisboa	68	BARCLAYS	400.000.000	8325548,37	18.677.015	-24747685,6	-14520736,53	-14520736,53	-14520736,53
Metro Lisboa	69	CITIBANK	100.000.000	0	-5.532	-10410337,46	-12778434,67	-12778434,67	-12778434,67
Metro Lisboa	70	GOLDMAN SACHS	300.000.000	0	0	-2046065,72	-6415000,35	-6415000,35	-6415000,35
Metro Lisboa	71	GOLDMAN SACHS	71.042.080	664416,7	-11.545.974	6694847,44	8388849,44	8388849,44	8388849,44
Metro Lisboa	72	GOLDMAN SACHS	50.000.000	-656517,06	-6.872.014	4706544,76	5910700,32	5910700,32	5910700,32
Metro Lisboa	73	DEUTSCHE BANK	150.000.000	2753546,29	-4.846.628	3884805,17	-155738,86	-155738,86	-155738,86
Metro Lisboa	74	DEUTSCHE BANK	332407,18	332407,18	-315.572	731090,81	-145740,67	-145740,67	-145740,67
Metro Lisboa	75	DEUTSCHE BANK	24.500.000	856740,21	-442.944	566035,38	579526,42	579526,42	579526,42
Metro Lisboa	76	BARCLAYS	300.000.000	0	-17.895.915	109602951,54	7052348,33	7052348,33	7052348,33
AdP	1	BNP Paribas	75.000.000	-5.414,165	2897844	-745020	-745020	-745020	-745020
AdP	2	Citigroup	50.000.000	-3.237.000	2537000	2537000	-650000	-650000	-650000
AdP	3	BNP Paribas	50000000	-11324070	511690	511690	-829843	-829843	-829843
AdP	4	BBVA	20000000	-263759,71	284984,81	284984,81	-286677,15	-286677,15	-286677,15
AdP	5	BTM	77778000	2651251,802	-3982194,481	-3982194,481	-1269006,269	-1269006,269	-1269006,269
AdP	6	BTM	5774409,736	-1783145,663	-1783145,663	-1783145,663	-242159,8127	-242159,8127	-242159,8127
AdP	7	Diferença cambial da colocação privat	100000000	-71800943,511	9083781,023	9083781,023	-19778981,576	-19778981,576	-19778981,576
TAP	1	BES	41761305,8	-103882,15	-1311320,09	-1311320,09	995419,94	995419,94	995419,94

Table with columns for Empresa, Counterparty, National, 2009, 2010, 31-03-2011, 30-06-2011, 31-12-2011. Includes sub-columns for Vlr. MTM, Resultado, Cash-Flow, Var. MTM, and Resultado. Rows include various banks and financial institutions like Banco Santander, BNP Paribas, etc.

Table with columns for Empresa, Counterparty, National, 2009, 2010, 31-03-2011, 30-06-2011, 31-12-2011. Includes sub-columns for Vlr. MTM, Resultado, Cash-Flow, Var. MTM, and Resultado. Rows include various banks and financial institutions like Banco Santander, BNP Paribas, etc.

Data: dd/mm/yyyy

	Refer	1 BES	2 JPMorgan	3 Merrill Lynch	4 Barclays	5 AEN	6 Barclays	7 Barclays	8 BNP-paribas	9 ISG	10 JPMorgan	11 ISG	12 AEN	13 JPMorgan	14 Santander Totta	15 BPI	16 Barclays	17 Santander Totta	18 JPMorgan	Adp	1 BNP Paribas	2 Citigroup	3 BNP Paribas	4 BBVA	5 BTM	6 BTM	7 Diferença cambial da TAP		
	200 000 000,00	1 995 933,33	7 873 143,47	12 684 296,00	5 279 893,75	11 817 257,78	5 176 243,35	28 407 832,29	5 279 893,75	2 866 991,65	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	100 000 000,00	50 000 000,00	50 000 000,00	20 000 000,00	77 778 000,00	22 222 000,00	100 000 000,00	41 761 305,80	
			1 945 377,78	5 965 799,63	14 093 917,00	5 032 105,17	19 280 508,79	4 933 949,35	5 032 105,17	1 209 691,19																			
		3098	2534164	572207	0	-2378	8712490	6677753	0	859204																			
		-8523	-2255591	-1295791	0	4648	9320323	-6572709	0	-1017697																			
		2067046,47	17044106,39	18381770,39	17044106,39	18381770,39	99039832,19	59 145464,92	18285401,9	332746295,4	10468008,11	33399435,87	340624189,1	288103191,8	394603672,7	252647429,8													
		-4417,74	611437,32	658730,29	611437,32	658730,29	7509693,3	4462841,6	17527717,67	10468008,11	33399435,87	18571667,06	23846362,11	11754934,89	17545143,64														
		-4400,47	-576532,84	-621147,19	-576532,84	-621147,19	-6706304,46	-3998177,29	-15311417,34	-28415495,45	-17302046,63	-21288725,19	-11305099,96	-18004293,54															
		72234457,04	19356538																										
		-100096285,9																											

	Empresário	Valor	Varição MTM de empréstimos **	Efeito Líquido em resultado
	BEI CPiB (5422)	2067046,47	-4417,74	-20465866
	BEI Linha Tejo C.1(2)	17044106,39	611437,32	19356538
	BEI Linha Tejo C.2(2)	18381770,39	658730,29	
	BEI Linha Minho A.1	17044106,39	611437,32	
	BEI Linha Minho A.2.1	18381770,39	658730,29	
	BEI Suburbanos B	99039832,19	7509693,3	
	BEI Suburbanos C.(2)	59 145464,92	4462841,6	
	BEI Refer V	18285401,9	17527717,67	
	BEI Refer VI	109309633,3	10468008,11	
	Eurobond 2006/2026	332746295,4	33399435,87	
	Eurobond 2009/2019	340624189,1	18571667,06	
	Eurobond 2009/2024	288103191,8	23846362,11	
	Eurobond 2005/2015	394603672,7	11754934,89	
	Eurobond 2006/2021	252647429,8	17545143,64	

V TRUE
 F FALSE
 N.A. Não aplicável

Sector	Gestão de Risco Financeiro - Despacho n.º 101/09-SETF, de 30-01	Procedimentos adoptados matéria de avaliação de risco e medidas de cobertura				Adopção de política activa de reforço de capitais permanentes				Medidas prosseguidas com vista à optimização da estrutura financeira da empresa				Inclusão nos R&C			
		Diversificação do instrumento de financiamento	Diversificação de modalidades de taxa de juro disponíveis	Diversificação de entidades credoras	Contratação de instrumentos de gestão de cobertura de riscos	Consolidação passivo remunerado: transf. passivo C/p em M/L P, condições favoráveis	Contratação operação k minimize o custo financeiro (all-in-cost)	Minimização de garantias reais	Minimização de cláusulas restritivas (covenants)	Política k minimize afectação de Cap. Alheio à cobertura financeira dos investimentos	Opção por investimentos / comprovada rentabilidade social/ empresarial, benefício de FC e de CP	Utilização de auto financiamento e receitas de desinvestimento	Evolução da média anual de financiamento o nos últimos 5 anos	Juros suportados anualmente com o passivo remunerado e outros encargos nos últimos 5 anos	Análise de eficiência da política de financiamento e do uso de instrumentos de gestão de risco financeiro	Reflexão nas DF 2009 do efeito das variações do justo valor dos contratos de swap em carteira	
	EMPRESAS																
	EMPRESAS																
	1. Empresas Públicas não Financeiras																
	1.1. Comunicação Social																
2	1 1.1.1. Lusa - Agência de Notícias de Portugal, SA	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	N.A.	
	1 1.1.1. RTP - Rádio e Televisão de Portugal, SA	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	N.A.	
3	1.2. Cultura																
	1 1.2.1. OPART - Organismo de Produção Artística, EPE	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
	1 1.2.1. Teatro Nacional D. Maria II, EPE	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
	1 1.2.1. Teatro Nacional S. João, EPE	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
	1.3. Gestão de Infraestruturas																
	1.3.1. Infraestruturas Aéreas																
1 1.3.1.1.	ANA - Aeroportos de Portugal SA	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	
1 1.3.1.1.	ANAM-Aeroportos e Navegação Aérea Madeira, SA	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.3.1.1.	EDAB-Empr. de Desenv. do Aeroporto de Beja, SA	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.3.1.1.	NAER-Novo Aeroporto, SA	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.3.1.1.	Navegação Aérea de Portugal-NAV Portugal, EPE	V	V	F	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	N.A.	
	1.3.2. Infraestruturas Ferroviárias																
1 1.3.2.1.	Rave - Rede Ferroviária de Alta Velocidade, SA	N.A.	N.A.	N.A.	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	V	
1 1.3.2.1.	REFER-Rede Ferroviária Nacional, EP	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	
	1.3.3. Infraestruturas Portuárias																
1 1.3.3.1.	APA - Admn. Porto Aveiro, SA	V	V	V	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	V	
1 1.3.3.1.	APDL-Administração dos Portos do Douro e Leixões,SA	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.3.3.1.	APL-Administração do Porto de Lisboa, SA	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	
1 1.3.3.1.	APS-Administração do Porto de Sines, SA	V	N.A.	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.3.3.1.	APSS-Administração dos Portos de Setúbal e Sesimbra SA	N.A.	N.A.	N.A.	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	V	
	1.3.4. Infraestruturas Rodoviárias																
1 1.3.4.1.	EP - Estradas de Portugal, SA	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	
	1.3.5.Outras Infraestruturas																
1 1.3.5.1.	Docapesca-Portos e Lojas, SA	V	V	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.3.5.1.	EDIA-Empresa Desenv.Infraest.Alqueva, SA	V	V	V	F	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	N.A.	
	1.4. Requalificação Urbana																
1 1.4.1.	Arco Ribeirinho Sul, SA	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.4.1.	CostaPolis-Soc.Des.Programa Polis Costa Caparica,SA	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.4.1.	Frete Têjo, SA	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	V	N.A.	
1 1.4.1.	Parque Expo 98, SA	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.4.1.	Polis Litoral Norte, SA	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.4.1.	Polis Litoral Ria Aveiro, SA	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	
1 1.4.1.	Polis Ria formosa, SA	V	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	N.A.	

Empresa	Dados				Soma de Notional	Soma de MIM 2009	Soma de MIM 2010	Soma de MIM 30/06/2011
	Contar de Counterparty							
ANA		1	30.000.000	-611.897	-1.191.795	-800.960	0	
APA		1	12.000.000	-385.747	-78.382	-2.755.083	-2.755.083	
APL		1	21.500.000	-3.325.667	-3.180.148	-66.892.647	-66.892.647	
Carris		4	505.000.000	-87.498.556	-82.926.566	-135.623.879	-135.623.879	
CP		10	1.749.363.405	-185.554.078	-10.581.166	-9.509.359	-9.509.359	
EP		1	125.000.000	0	-417.761.765	-520.304.432	-520.304.432	
Metro Lisboa		76	6.391.277.772	-246.499.476	-578.170.752	-625.484.705	-625.484.705	
Metro Porto		15	1.557.591.593	-421.402.313	-123.312.117	-98.767.487	-98.767.487	
Parública		5	550.000.000	-6.108.954	-59.332.973	-49.880.638	-49.880.638	
Refer		18	3.900.000.000	-72.556.979	-36.286.632	-27.054.093	-27.054.093	
STCP		2	50.000.000	-16.197.270	-3.456.436	-3.257.470	-3.257.470	
Transtejo		3	82.500.000	-2.776.689	-12.687.105	-9.038.833	-9.038.833	
AdP		6	395.000.000	-3.884.428	-1.415.202	-315.900	-315.900	
TAP		1	41.761.306	-103.882	-1.493.851.552	-1.549.685.487	-1.549.685.487	
Total Geral		144	15.410.994.076	-1.046.905.937	-1.493.851.552	-1.549.685.487	-1.549.685.487	

Objective	Dados		Soma de Notional
	Nº		
Cobertura	98	10.783.898.201,13	
Diversificação	16	1.857.591.593,14	
N/a	2	0,00	
Optimização de er	3	900.000.000,00	
(em branco)	1	100.000.000,00	
Reestruturação	25	1.769.504.282,00	
Total Geral	145	15.410.994.076,27	

Empresa	Dados				Soma de MIM 2009	Soma de MIM 2010	Soma de MIM 30/06/2011	Variação MIM 11
	Soma de Notional							
APA	12.000.000,00	-385.747,45	-78.381,56	0,00	307.365,89			
APL	21.500.000,00	-3.325.667,00	-3.180.148,00	-2.755.083,00	145.519,00			
Carris	505.000.000,00	-87.498.556,44	-82.926.565,72	-66.892.647,22	4.571.990,72			
CP	1.749.363.405,36	-185.554.077,79	-163.470.513,50	-135.623.879,31	22.083.564,29			
Metro Porto	1.557.591.593,14	-421.402.312,86	-578.170.751,72	-625.484.704,79	156.768.438,86			
Refer	3.900.000.000,00	-72.556.979,21	-59.332.972,74	-49.880.638,09	13.224.006,47			
STCP	50.000.000,00	-16.197.270,33	-36.286.631,94	-27.054.093,29	20.089.361,61			
Transtejo	82.500.000,00	-2.776.689,00	-3.456.436,35	-3.257.470,00	679.747,35			
ANA	30.000.000,00	-611.897,41	-1.191.794,56	-800.960,22	579.897,15			
Parública	550.000.000,00	-6.108.953,87	-123.312.117,45	-98.767.486,95	117.203.163,58			
EP	125.000.000,00	0,00	-10.581.166,44	-9.509.359,29	10.581.166,44			
Metro Lisboa	6.391.277.771,97	-246.499.475,91	-417.761.764,88	-520.304.431,68	171.262.289,97			
AdP	395.000.000,00	-3.884.427,87	-12.687.104,55	-9.038.832,69	8.802.676,68			
TAP	41.761.305,80	-103.882,15	-1.415.202,24	-315.900,15	1.311.320,09			
Total Geral	15.410.994.076,27	-1.046.905.937,29	-1.493.851.551,65	-1.549.685.486,67				

Empresa	Dados	Soma de Cash-flow 09	Soma de Cash-flow 10	Soma de Cash-flow 11	Soma de Cash-flow 27/2011
APA		-237.936,00	-363.088,00	-506.841,07	0,00
APL		0,00	0,00	0,00	0,00
Carris		-5.983.272,69	-15.572.616,66	-3.095.935,11	-3.526.128,63
CP		-19.412.243,09	-59.353.614,61	-17.806.011,42	-10.105.354,88
Metro Porto		-9.067.183,32	-42.645.393,70	-14.929.362,85	-26.708.551,89
Refer		17.184.166,62	1.196.106,25	4.029.966,67	-3.066.631,94
STCP		114.161,81	-702.722,22	-510.484,72	-510.484,72
Transtjejo		-315.416,79	-1.502.334,15	-730.830,84	-730.830,84
ANA		51.708,33	-393.810,83	-189.300,00	-371.536,67
Parpública		4.643.798,61	4.823.913,89	-387.750,00	-854.266,67
EP		0,00	0,00	0,00	0,00
AdP		981.260,42	-1.991.142,36	-30.833,34	-882.687,51
TAP		0,00	849.985,78		
Total Geral		-12.040.956,11	-115.654.716,61	-33.646.897,97	-46.756.473,75

Empresa	Dados	Soma de -1%	Soma de +1%
APA			
APL			
Carris		9.663.604,27	9.871.043,65
CP		27.413.613,26	28.522.749,55
Metro Porto			
Refer		46.548.995,49	59.654.635,52
STCP		23.619.903,43	3.045.564,29
Transtjejo		1.892.597,29	1.705.106,95
ANA		1.281.345,03	2.672.039,51
Parpública		18.926.000,00	24.967.000,00
EP			
Metro Lisboa		185.921.624,24	93.048.511,51
AdP			
TAP		1.005.108,14	1.636.908,44
Total Geral		185.322.800,18	55.880.288,38

Maturity	Dados	Soma de Notional	Soma de MTM 30/06/2011
2009		1	250.000.000,00
2010		2	277.500.000,00
2011		2	312.000.000,00
2012		12	1.551.582.373,50
2013		2	102.464.799,88
2014		7	852.280.000,00
2015		13	1.870.089.738,45
2016		9	715.669.428,10
2017		4	86.198.494,48
2018		2	252.632.156,50
2019		17	1.942.415.898,51
2020		8	694.195.847,77
2021		5	1.046.013.278,78
2022		22	1.349.952.060,30
2023		3	190.000.000,00
2024		7	950.000.000,00
2026		18	1.820.000.000,00
2027		5	345.000.000,00
2028		4	378.000.000,00
2030		2	425.000.000,00
Total Geral		145	15.410.994.076,27

Origem Banco	Dados	Soma de Notional	Soma de MTM 30/06/2011
Estrangeiros		101	11.511.031.355,68
Nacionais		42	3.899.962.720,59
(em branco)		2	0,00
Total Geral		145	15.410.994.076,27

Contract date	Dados	Soma de Notional	Soma de MTM 30/06/2011
1996		1	77.313.674,05
2002		4	115.168.872,00
2003		8	840.275.026,71
2005		15	1.880.382.323,13
2006		11	2.280.882.449,55
2007		22	2.070.945.576,79
2008		18	1.829.620.978,67
2009		28	2.899.296.863,40
2010		30	2.718.170.616,86
2011		8	698.937.695,11
Total Geral		145	15.410.994.076,27

Contract date	Dados	Soma de Notional	Soma de MTM 30/06/2011
1996		1	77.313.674,05
2002		4	115.168.872,00
2003		8	840.275.026,71
2005		15	1.880.382.323,13
2006		11	2.280.882.449,55
2007		22	2.070.945.576,79
2008		18	1.829.620.978,67
2009		28	2.899.296.863,40
2010		30	2.718.170.616,86
2011		8	698.937.695,11
Total Geral		145	15.410.994.076,27