

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes
Enviado: 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
Anexos: Template DGTf Março12.xls

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

CARRIS 

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@ddgtf.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)

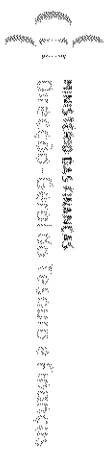
Presidente do Conselho de Administração

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



www.dgff.pt

Fernanda Martins
Directora de Serviços de
Participações do Estado

Tel: 218846068 Fax: 218442282

Empresa: _____

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Objetivo: cobertura
 Tipo de instrumento derivado
 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
 Mark to market de final de Março 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
1	Banco Português de Negócios		Cobertura	Swap com taxa fixa crescente			17-Mai-09 Euribor 3m + 0,07%	Taxa fixa crescente			-13.989.970	-9.822.311	-8.771.053	-12.206.106	-12.991.828	-13.801.400
2	Banco Santander Totta			Swap com barreiras			27-Mar-09 Euribor 6m	Taxa fixa 2,86%, condicionada a evolução do spread CMS 2anos -10anos					-3.699.005	-6.631.439	-4.920.971	-4.665.007
3	Banco Santander Totta			Swap com barreiras			15-Mar-09 Euribor 6m	Taxa fixa 1,895%, condicionada a evolução do CMS 10anos					-11.243.223	-32.074.959	-34.561.734	-32.983.833
4	Banco Espírito Santo			Swap simples			11-Fev-09 Euribor 3m	Euribor 3m + 5,95%			-45.018.895	-42.897.530	-42.179.366	-43.365.537	-42.447.993	-42.722.174
5																
6																
7																
8																
9																
10																
11																
12																
13																
14																
15																
n																
Total										0	-58.908.426	-52.719.840	-66.892.647	-94.298.040	-95.322.627	-94.172.415

Empresa: 0

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

#	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 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/yyy (Prev.)
1	BPN	0	0	0	-1.490.181	-1.357.209	-1.187.579	-1.062.352	-1.114.933	-4.118.972	-4.589.730	-3.027.462	-1.775.875	-532.759	-592.878	-192.958	-59.071	0
2	BST	0	0	0	-156.344	-629.922	-753.999	154.564	131.444	-911.981	-1.710.022	-1.014.685	-575.003	-186.424	-592.878	-192.958	-59.071	0
3	BST	0	0	0	81.146	-67.925	-585.156	329.219	-40.031	-1.038.850	-3.123.237	-2.474.723	-1.831.320	-1.158.361	-592.878	-192.958	-59.071	0
4	BES	0	0	0	-1.520.556	-1.470.972	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-4.528.911	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.049.167	-6.032.639	-6.032.639	-4.512.093	0
5		0	0	0														0
6		0	0	0														0
7		0	0	0														0
8		0	0	0														0
9		0	0	0														0
10		0	0	0														0
11		0	0	0														0
12		0	0	0														0
13		0	0	0														0
14		0	0	0														0
15		0	0	0														0
16		0	0	0														0
17		0	0	0														0
18		0	0	0														0
19		0	0	0														0
20		0	0	0														0
21		0	0	0														0
22		0	0	0														0
23		0	0	0														0
24		0	0	0														0
25		0	0	0														0
26		0	0	0														0
27		0	0	0														0
28		0	0	0														0
29		0	0	0														0
30		0	0	0														0
31		0	0	0														0
32		0	0	0														0
33		0	0	0														0
n		0	0	0														0
Total			0	0	-3.095.535	-3.526.129	-4.047.292	-2.119.135	-2.544.074	-10.598.314	-15.455.628	-12.545.510	-10.217.837	-7.928.740	-6.625.517	-5.224.737	-4.570.154	0

(*) - Valores acumulados

Empresa: _____ 0

Data: 30/03/2012

#	Counterparty	Notional	Variação MTM			
			Variação na curva da taxa de juro		Variação na curva de volatilidade *	
			-1%	+1%	-5%	+5%
1	BPI	0	-3.445.144	3.851.276	não aplicável	não aplicável
2	BST	0	-2.262.086	2.157.144	81.729	-117.180
3	BST	0	-46.617.962	8.363.550	2.265.707	-3.337.748
4	BES	0	-1.528.501	1.397.287	não aplicável	não aplicável
5	0	0				
6	0	0				
7	0	0				
8	0	0				
9	0	0				
10	0	0				
11	0	0				
12	0	0				
13	0	0				
14	0	0				
15	0	0				
16	0	0				
17	0	0				
18	0	0				
19	0	0				
20	0	0				
21	0	0				
22	0	0				
23	0	0				
24	0	0				
25	0	0				
26	0	0				
27	0	0				
28	0	0				
29	0	0				
30	0	0				
31	0	0				
32	0	0				
33	0	0				
Total	Total		-53.853.803	15.860.257	2.347.436	-3.454.928

(*) - Apenas para IGRF com opcionalidade.

Empréstimo	Valor	Variação MTM de empréstimos **	
		Variação na curva da taxa de juro	
		-1%	+1%
		3.127.965	-3.348.613
		2.129.791	-2.030.792
		2.252.033	-1.904.139
		5.591.369	-5.289.029
		0	13.101.159

(**) - Apenas para empréstimos a taxa fixa

Efeito Líquido em resultado			
Variação na curva da taxa de juro		Variação na curva de volatilidade *	
-1%	+1%	-5%	+5%
-317.178	302.463	não aplicável	não aplicável
-132.295	126.352	81.729	-117.180
-44.365.929	6.459.412	2.265.707	-3.337.748
4.062.868	-3.891.742	não aplicável	não aplicável
-40.752.534	2.996.484	2.347.436	-3.454.928