

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes
Enviado: terça-feira, 18 de Outubro de 2011 10:37
Para: 'Fernanda Martins'
Assunto: Informação SWAPs CARRIS_DGTF Setembro11.xls
Anexos: Informação SWAPs CARRIS_DGTF Setembro11.xls

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio do ficheiro do 3º trimestre.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financeiro e de Controlo de Gestão
DFG

CARRIS 

Empresa: _____

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar nome do banco Identificar empréstimo de resc. investimento ou arbitragem Objetivo, cobertura subjacente 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 próprias, 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 2/10	MM 31/03/2011	MM 30/06/2011	MM 30/09/2011	MM 31/12/2011
1	Banco Português de Negócios		Cobertura	Swap com taxa fixa crescente			17-Mar-16	Eurobor 3m + 0,07%	Taxa fixa crescente						
2	Banco Santander Totta			Swap com barreiras			27-Mar-16	Eurobor 6m	Taxa fixa 2,95%, condicionada à evolução do spread CMS 2anos - 10anos				-3.699.005	-6.631.439	
3	Banco Santander Totta			Swap com barreiras			15-Mar-19	Eurobor 6m	Taxa fixa 1,835%, condicionada à evolução do CMS 10anos					-32.074.959	
4	Banco Espírito Santo			Swap simples			11-Fev-19	Eurobor 3m	Eurobor 3m + 5,95%		-45.018.865	-42.897.530	-42.179.366	-43.385.537	
5															
6															
7															
8															
9															
10															
11															
12															
13															
14															
15															
n															
Total										0	-59.908.426	-52.719.840	-66.892.647	-94.298.040	0

Empresa: _____ 0

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Cobocar 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 *

#	Counterparty	Notional	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011
1	BPW				4.067.260	51.257	-2.435.052	
2	BST						-2.032.434	
3	BST						-20.831.735	
4	BES				2.121.326	718.164	-1.296.171	
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	6.188.586	769.421	-27.405.393	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 (Real)	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 31/12/20YY (Prev.)
1	BPN	0	0	0	-1.490.181	-1.357.309	-1.187.679	-1.082.382	-4.655.690	-3.450.849	-2.236.734	-982.289	-137.837				
2	BST	0	0	0	-1.068.344	-829.922	-753.896	154.564	-1.596.000	-1.247.820	-623.828	-159.485	-93.212				
3	BST	0	0	0	81.146	-67.925	-695.158	329.219	-414.333	-204.398	38.921	263.280	323.992	251.140	127.294	-15.292	
4	BES	0	0	0	-1.520.556	-1.470.972	-1.520.556	-1.520.556	-8.046.167	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.046.167	-6.032.639	-6.032.639	-2.991.526	
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													
11	Total	0	0	0	-3.095.936	-3.525.129	-4.047.282	-2.119.135	-12.705.190	-10.535.694	-8.854.280	-6.881.103	-5.986.223	-5.787.499	-5.905.345	-3.006.819	0

(*) - Valores acumulados

#	Compania	Nacional	2009		2010		31-03-2011		30-06-2011		30-09-2011		31-12-2011		
			Var. MTM	Cash-flow	Var. MTM	Cash-flow	Var. MTM	Cash-flow	Var. MTM	Cash-flow	Var. MTM	Cash-flow	Var. MTM	Cash-flow	
1	BPN	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
2	BST	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
3	BST	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
4	BES	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
5		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	
7		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	
9		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	
11		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	
13		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	
15		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	
17		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	
19		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	
21		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	
23		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	
25		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	
27		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	
29		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	
31		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	
33		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
Total	Total	0	0	0	0	12,377,771	5,191,870	5,185,300	1,538,843	7,082,257	5,513,414	28,811,584	3,094,564	36,706,126	2,119,135

Empresa: _____ 0

Data: dd/mm/yyyy

#	Counterparty	Notional	Variação MTM			
			Variação na curva da taxa de juro		Variação na curva de volatilidade *	
			-1%	+1%	-5%	+5%
1	BPN	0	-3.786.013	3.571.392	não aplicável	não aplicável
2	BST	0	-2.695.273	2.536.053	-6.007.920	-7.056.015
3	BST	0	-46.009.689	2.329.532	-26.355.214	-38.053.419
4	BES	0	-1.557.358	1.423.630	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		-54.048.334	9.860.607	-32.363.135	-45.109.433

(*) - Apenas para IGRF com opcionalidade.

Empréstimo	Valor	Variação MTM de empréstimos **	
		Variação na curva da taxa de juro	
		-1%	+1%
		3.471.393	-3.271.245
		2.541.557	-2.389.513
		2.270.181	-2.079.960
		5.818.756	-5.129.965
		0	14.101.867
			-12.870.703

(**) - 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%
-314.620	300.147	não aplicável	não aplicável
-153.716	146.540	-6.007.920	-7.056.015
-43.738.508	249.572	-26.355.214	-38.053.419
4.261.398	-3.706.355	não aplicável	não aplicável
-39.946.447	-3.610.098	-32.363.135	-45.109.433