

Empresa: _____

CARRIS

Instruções de preenchimento para cada um das colunas

Identificar empresa/subsidiária ou arrendatário
 Objetivo: cobertura de risco, investimento ou arbitragem
 Tipo de instrumento derivado
 Colocar valor contábil
 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
 Mark to market de final de Junho 2012
 Mark to market de final de Setembro 2012
 Mark to market de final de Dezembro 2012

#	Contratante	Underlying	Objetivo	Descrição	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 Português de Negócios		Cobertura Swap com taxa fixa crescente				17-Mar-10 Euro 3m + 0,07%	Taxa fixa crescente		0	-58.808.428	-32.710.840	-88.802.641	-34.298.040	-95.322.027	-34.172.415	-107.801.437	-116.545.671	-120.142.480	
2	Banco Santander Total		Swap com barreiras				27-Mar-10 Euro 6m	Taxa fixa 2,95% condicionada à evolução do spread CMS Zambos - (danos												
3	Banco Santander Total		Swap com barreiras				15-Mar-10 Euro 6m	Taxa fixa 1,55% condicionada à evolução do spread CMS (danos												
4	Banco Espírito Santo		Swap simples				11-Feb-10 Euro 3m	Euro 3m + 5,95%			-48.018.855	-42.897.530	-42.179.366	-43.386.537	-42.447.893	-42.722.774	-41.624.223	-40.875.609	-39.954.493	
5																				
6																				
7																				
8																				
9																				
10																				
11																				
12																				
13																				
14																				
15																				
n																				
Total										0	-58.808.428	-32.710.840	-88.802.641	-34.298.040	-95.322.027	-34.172.415	-107.801.437	-116.545.671	-120.142.480	

Empresa: CARREIS

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar nome do contrato
 Colocar valor contratado
 Variação Mark to market 2006
 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

#	Contratante	Nacional	2006	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	BPV				4.087.290	51.237	-4.535.052	-1.765.823	-809.477	-33.625	178.846	794.695
2	BST						-4.632.434	1.719.498	255.964	211.353	-100.387	662.330
3	BST						-28.834	2.898.715	1.977.801	-14.884.701	-9.484.108	-6.073.153
4	BES				2.121.326	718.194	-1.208.177	937.544	-274.181	897.051	890.614	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												
1	Total		0	0	8.188.385	789.421	-27.408.393	-1.024.587	1.150.212	-13.869.022	-8.594.034	-3.597.119

(*) - Variação base a final de 2010

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

#	Comentário	Nacional	Cash-flow 2008	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 31/12/2013 (Real)	Cash-flow 31/12/2014 (Real)	Cash-flow 31/12/2015 (Real)	Cash-flow 31/12/2016 (Real)	Cash-flow 31/12/2017 (Real)	Cash-flow 31/12/2018 (Real)	Cash-flow 31/12/2019 (Real)	Cash-flow 31/12/20XX (Real)
1	BPV	0	0	0	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187	-1.480.187
2	BST	0	0	0	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544	-186.544
3	BST	0	0	0	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148	81.148
4	BES	0	0	0	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556
5		0	0	0	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	0	0	0
7		0	0	0	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	0	0	0
9		0	0	0	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	0	0	0
11		0	0	0	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	0	0	0
13		0	0	0	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	0	0	0
15		0	0	0	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	0	0	0
17		0	0	0	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	0	0	0
19		0	0	0	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	0	0	0
21		0	0	0	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	0	0	0
23		0	0	0	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	0	0	0
25		0	0	0	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	0	0	0
27		0	0	0	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	0	0	0
29		0	0	0	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	0	0	0
31		0	0	0	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	0	0	0
33		0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
34	REAL	0	0	0	-3.095.935	-3.095.935	-3.526.728	-4.047.282	-4.568.135	-5.088.928	-5.609.721	-6.130.514	-6.651.307	-7.172.100	-7.692.893	-8.213.686	-8.734.479	-9.255.272	-9.776.065	-10.296.858

(*) - Valores acumulados

Empresa: CARRIS

Data: 31/12/2012

#	Counterparty	Notional	Variação MTM			
			Variação na curva de taxa de juro -1%	Variação na curva de taxa de juro +1%	Variação na curva de volatilidade -5%	Variação na curva de volatilidade +5%
1 BPN		0	-867.983	2.703.244	não aplicável	não aplicável
2 BST		0	-894.304	1.303.290	300.004	-51.236
3 BST		0	-48.190.194	37.210.049	1.351.381	-866.544
4 BES		0	-769.951	1.259.893	não aplicável	não aplicável
5		0				
6		0				
7		0				
8		0				
9		0				
10		0				
11		0				
12		0				
13		0				
14		0				
15		0				
16		0				
17		0				
18		0				
19		0				
20		0				
21		0				
22		0				
23		0				
24		0				
25		0				
26		0				
27		0				
28		0				
29		0				
30		0				
31		0				
32		0				
33		0				
Total	Total		-51.522.322	42.474.318	1.891.381	-918.289

(*) - Apenas para IGRF com opcionalidade.

Emprestimo	Valor	Variação MTM de empréstimos (**)			
		Variação na curva de taxa de juro -1%	Variação na curva de taxa de juro +1%	Variação na curva de volatilidade -5%	Variação na curva de volatilidade +5%
	0	817.818	-2.508.517	300.004	-51.236
		864.428	-1.228.346	1.351.381	-866.544
		1.000.358	-1.502.506		
		4.197.997	-5.984.878		
Total	0	6.680.451	-10.832.289		

(**) - Apenas para empréstimos a taxa fixa

Estado Líquido em resultado	Variação na curva de taxa de juro			
	-1%	+1%	-5%	+5%
	-50.047	193.726	300.004	-51.236
	-38.894	77.914	1.351.381	-866.544
	-48.189.746	35.708.392		
	3.385.008	-4.338.015		
Total	-44.881.871	31.642.818	1.891.381	-918.289