

## À Comissão Parlamentar de Inquérito à Celebração de Contratos de Gestão de Risco Financeiro por Empresas do Sector Público

**Resposta ao pedido dos Srs Deputados para disponibilização de documentos na sequência da audição de 23 de julho de 2013**

- 1) A Senhora SETF recebeu a primeira informação sobre *Swaps* e necessidades de financiamento das empresas das empresas do SEE em 29/06/2011. Vide "*Doc 1.pdf*".
- 2) Recebeu nova informação, mais atualizada, detalhada e completa, em 19/07/2011. De salientar que esta informação já continha um documento detalhado com toda a informação relevante sobre os IGRF, de todas as empresas e todos os contratos, bem como um relatório descritivo sobre os IGRF, no qual já era visível um valor total de perdas potenciais a 30 de junho de 2011 na ordem dos 1,5 mil milhões de euros. De referir ainda que, a atualização da informação vem na sequência de instruções da própria Senhora SETF, datadas do dia 18/07/2011, para o não envolvimento da DGTF nas conversações com Bancos ou empresas do SEE, dado que seria a própria a conduzir as reuniões com a Banca para efeitos de negociação. Para isso precisava, e passo a citar, "de informação das dívidas das empresas organizada por bancos, bem como dos swaps". Vide "*Doc 2.pdf*", "*Doc 2A.pdf*" e "*Doc. 2B.pdf*".

Para melhor visualização do documento "*Doc 2A.pdf*", será também enviada a respetiva versão em formato Excel.

- 3) Recebeu em 26/07/2011, a proposta da DGTF para o Relatório do SEE referente ao ano de 2011 (contas de 2010), com o capítulo relativo aos IGRF / *Swaps* devidamente evidenciado: "... o Relatório é composto por novos capítulos e/ou capítulos mais desenvolvidos, a saber: Limites ao Endividamento, Esforço Financeiro do Estado, Responsabilidades Contingentes e Instrumentos de Gestão do Risco Financeiro." Neste relatório encontrava-se devidamente evidenciado, mais uma vez, um valor negativo de MtM, a 30 de junho de 2011, dos IGRF, na ordem dos 1,5 mil milhões de euros. Vide "*Doc 3.pdf*".
- 4) Em 01/08/2011, a Senhora SETF demonstrou já dispor de elevado e aprofundado conhecimento sobre a matéria dos Swaps / IGRF, dado que detectou a falta de um contrato de uma empresa, entre os mais de 140 contratos relativos a IGRF que se encontravam já elencados. A DGTF atualizou a informação e respondeu, a 3/08/2011, que o Relatório do SEE seria publicado devidamente atualizado e evidenciou, uma vez mais, o valor total atualizado das perdas potenciais: (MtM a 30 de junho de 2011 dos IGRF: 1,646 mil milhões de euros). Anexa-se cópia das partes relevantes do Boletim do SEE relativo ao 2.º Trimestre de 2011, entretanto publicado pela DGTF no respetivo sítio da internet. Vide "*Doc 4.pdf*".

Pedro Rodrigues Felício, 24 de julho de 2013