

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes
Enviado: quinta-feira, 2 de Maio de 2013 16:07
Para: 'Helena Llorente'
Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'; Silva Rodrigues
Assunto: RE: Actualização de Informação dos IGRF a 31 de Março de 2013 (agora completa)
Anexos: Template DGITF Março13.xls

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao reenvio da informação reportada a 31/03/2013, agora completa com a volatilidade a 5% dos swaps do Santander.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financeiro e de Controlo de Gestão
DFG

De: Sousa Bentes
Enviada: segunda-feira, 29 de Abril de 2013 16:52
Para: 'Helena Llorente'
Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'; Silva Rodrigues
Assunto: Actualização de Informação dos IGRF a 31 de Março de 2013

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio da informação reportada a 31/03/2013.

Até esta data não foi possível obter a informação do Santander sobre a sensibilidade à volatilidade de 5%, cuja informação é produzida em Espanha. Se entretanto nos for disponibilizada a informação procederemos ao reenvio do ficheiro.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financeiro e de Controlo de Gestão
DFG

De: Sousa Bentes
Enviada: segunda-feira, 28 de Janeiro de 2013 11:20
Para: 'Helena Llorente'
Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'
Assunto: Actualização de Informação dos IGRF a 31 de Dezembro de 2012

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indicação do Senhor Presidente do Conselho de Administração procedo ao envio da informação reportada a 31/12/2012.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financieiro e de Controlo de Gest3o
DFG

De: Sousa Bentes**Enviada:** quarta-feira, 17 de Outubro de 2012 9:27**Para:** 'Helena Llorente'**Cc:** 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'**Assunto:** Actualiza3o de informa3o dos IGRF a 30 de Setembro de 2012

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indica3o do Senhor Presidente do Conselho de Administra3o procedo ao envio da informa3o reportada a 30/9/2012.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financieiro e de Controlo de Gest3o
DFG

CARRIS **De:** Sousa Bentes**Enviada:** sexta-feira, 13 de Julho de 2012 15:51**Para:** 'Helena Llorente'**Cc:** 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'**Assunto:** RE: Actualiza3o de informa3o dos IGRF a 30 de Junho de 2012

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indica3o do Senhor Presidente do Conselho de Administra3o procedo ao envio da informa3o.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financieiro e de Controlo de Gest3o
DFG

CARRIS **De:** Sousa Bentes**Enviada:** segunda-feira, 7 de Maio de 2012 10:16**Para:** 'Helena Llorente'**Cc:** 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'**Assunto:** FW: Actualiza3o de informa3o dos IGRF a 31 de Março de 2012

Exma Senhora Dra Fernanda Martins

Por indica3o do Senhor Presidente do Conselho de Administra3o procedo ao envio da informa3o.

Com os melhores cumprimentos

Sousa Bentes

Director Financieiro e de Controlo de Gest3o

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@dgf.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: 218848068 Fax: 218848292

Empresa: _____

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Objetivo: cobertura
 Identificar exposição de risco inerente ao investimento derivado
 Codicar valor
 Data do contrato
 Maturidade do contrato
 Descrição sucinta do valor a receber (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
 Mark to market de final de Março 2013

#	Contingency	Underlying	Objective	Derivative	National	Contract date	Maturity	Leg 1 - receivable	Leg 2 - payment	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	Mark to market de final de Março 2013	
1	Banco Português de Negócios		Cobertura	Swap com taxa fixa crescente			17-Mar-18 Eurobor 3m + 0.07%	Taxa fixa crescente		-13.889.570	-8.822.311	-9.771.053	-12.206.108	-12.981.825	-13.801.400	-13.893.026	-13.954.041	-12.860.490	-10.343.300	-110.585.671	
2	Banco Santander Total			Swap com barreiras			27-Mar-18 Eurobor 6m	Taxa fixa 2.95%, condicionada a evolução do spread CDS Zamos -10bps				-3.699.008	-6.631.439	-4.920.971	-4.665.007	-4.788.634	-5.732.042	-6.143.795	-3.981.711	-3.984.578	
3	Banco Santander Total			Swap com barreiras			15-Mar-18 Eurobor 6m	Taxa fixa 1.835%, condicionada a evolução do spread CDS Zamos -10bps				-11.243.223	-32.071.868	-34.981.724	-33.983.833	-4.788.634	-5.732.042	-6.143.795	-3.981.711	-3.984.578	
4	Banco Espírito Santo			Swap simples			11-Fev-18 Eurobor 3m	Eurobor 3m + 5.56%		-45.018.855	-42.897.539	-42.139.396	-43.585.537	-42.247.985	-42.722.174	-41.824.223	-40.973.609	-39.954.493	-38.549.800	-38.549.800	
5																					
6																					
7																					
8																					
9																					
10																					
11																					
12																					
13																					
14																					
15																					
n																					
Total										-50.908.426	-42.719.240	-46.891.647	-34.299.040	-93.322.827	-84.172.415	-107.281.437	-116.545.371	-120.142.490	-110.585.671		

Empresa: _____ 0

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar 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* Variação Mark to market Março 2012* Variação Mark to market Junho 2012* Variação Mark to market Setembro 2012* Variação Mark to market Dezembro 2012* Variação Mark to market Março de 2013*

#	Counterparty	Noboral	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011	31-03-2012	30-09-2012	30-09-2012	31-12-2012	31-03-2013
1	BPA				4.067.266	51.257	-2.435.052	-785.823	-809.471	-33.625	179.546	794.688	2.717.111
2	BST						-2.932.434	1.710.468	255.964	211.353	-109.387	662.330	527.133
3	BST						-20.831.735	-2.686.775	1.977.801	-14.884.701	-9.494.106	-6.073.153	4.736.942
4	BES				2.121.326	718.164	-1.206.171	937.544	-274.181	897.951	850.614	1.019.116	1.604.693
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	6.188.585	769.421	-27.405.393	-1.024.597	1.150.212	-13.809.022	5.564.034	-3.597.019	9.585.879

(*) - Variação face a final de 2010.

Empresa: _____ 0

Data: 31/03/13

#	Counterparty	Notional	Variação MTM			
			Variação na curva da taxa de juro		Variação na curva de volatilidade *	
			-1%	+1%	-5%	+5%
1	BPN	0	-1.014.360	2.344.776	não aplicável	não aplicável
2	BST	0	-736.086	1.295.429	20.000	-20.000
3	BST	0	-43.424.467	31.006.404	1.470.975	-1.470.975
4	BES	0	-850.937	1.164.550	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		-46.025.851	35.811.160	1.490.975	-1.490.975

(*) - Apenas para IGRF com opcionalidade.

Empréstimo	Valor	Variação MTM de empréstimos **	
		Variação na curva da taxa de juro	
		-1%	+1%
		968.485	-2.210.513
		705.438	-1.231.103
		1.133.061	-1.507.539
		4.409.078	-5.365.661
		7.216.062	-10.314.816

(**) - 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%
-45.875	134.293	não aplicável	não aplicável
-30.648	64.326	20.000	-20.000
-42.291.406	29.498.866	1.470.975	-1.470.975
3.558.140	-4.281.110	não aplicável	não aplicável
-36.909.789	25.406.344	1.490.975	-1.490.975