

Sousa Bentes

De: Sousa Bentes
Enviado: sexta-feira, 13 de Julho de 2012 15:51
Para: 'Helena Llorente'
Cc: 'Fernanda Martins'; 'Luisa Roque'
Assunto: RE: Atualização de Informação dos IGRF a 30 de Junho de 2012
Anexos: Template DGTf Junho12.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: Sousa Bentes
Enviada: 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

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@dgtf.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)

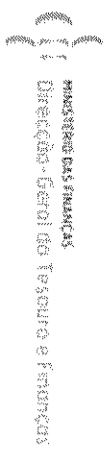
Presidente do Conselho de Administração

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.dgtf.pt

Fernanda Martins
Directora de Serviços de
Participações do Estado

Tel: 218946068 Fax: 218946252

Empresa: _____

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

Colocar nome do banco Identificar empréstimo da peça Investimento subjacente 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 (as fórmulas 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 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	MM 30/06/12
1	Banco Portuguesa de Negócios		Cobertura	Swap com taxa fixa crescente			17-Mar-16 Euribor 3m + 0,07%	Taxa fixa crescente		-13.899.570	-8.822.311	-9.771.053	-12.206.105	-12.991.929	-13.801.400	-13.835.025	
2	Banco Santander Total			Swap com barreiras			27-Mar-16 Euribor 6m	Taxa fixa 2,95%, condicionada a evolução do spread CMS Zanos -10anos				-3.699.006	-6.631.439	-4.920.971	-4.665.007	-4.455.654	
3	Banco Santander Total			Swap com barreiras			15-Mar-19 Euribor 6m	Taxa fixa 1,535%, condicionada a evolução do CMS 10anos				-11.246.223	-32.074.959	-34.961.734	-32.993.833	-47.669.534	
4	Banco Espírito Santo			Swap simples			11-Fev-19 Euribor 3m	Euribor 3m + 5,56%		-45.018.855	-42.897.530	-42.179.366	-43.385.537	-42.447.593	-42.723.174	-41.824.223	
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																	
34																	
35																	
36																	
37																	
38																	
39																	
40																	
41																	
42																	
43																	
44																	
45																	
46																	
47																	
48																	
49																	
50																	
51																	
52																	
53																	
54																	
55																	
56																	
57																	
58																	
59																	
60																	
61																	
62																	
63																	
64																	
65																	
66																	
67																	
68																	
69																	
70																	
71																	
72																	
73																	
74																	
75																	
76																	
77																	
78																	
79																	
80																	
81																	
82																	
83																	
84																	
85																	
86																	
87																	
88																	
89																	
90																	
91																	
92																	
93																	
94																	
95																	
96																	
97																	
98																	
99																	
100																	
Total										0	-58.998.426	-52.719.840	-46.692.647	-34.298.040	-95.922.627	-94.172.415	-107.981.437

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 *

#	Counterparty	Notional	2009	2010	31/03/2011	30-06-2011	30/09/2011	31/12/2011	31-03-2012	30-06-2012
1	BPN				4.067.200	51.207	-2.435.052	-785.820	809.471	-33.625
2	BST						-2.932.434	1.710.468	255.964	211.359
3	BST						-20.831.735	-2.886.775	1.977.901	-14.884.701
4	BES				2.121.326	718.164	-1.206.171	937.544	-274.161	897.951
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	-27.405.363	-1.024.587	1.150.212	-13.809.022

(*) - Variação face a final de 2010.

Instruções de preenchimento para cada um dos contratos

#	Counterparty	Nacional	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 30/06/2012 (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 31/12/2019 (prev.)
1	BPN	0	0	0	-1.490.181	-1.357.309	-1.187.679	-1.082.962	-1.114.933	-1.265.223	-2.941.594	-5.050.435	-3.378.303	-2.029.812	-608.459	-2.987.936	-1.122.027	-188.426	0
2	BST	0	0	0	-166.344	-629.922	-753.889	154.964	131.444	-195.446	-1.029.887	-1.865.118	-1.290.288	-719.366	-198.424	-2.987.936	-1.122.027	-188.426	0
3	BST	0	0	0	81.146	-67.925	-568.158	329.219	-40.031	89.928	-2.930.625	-8.159.810	-8.722.393	-7.356.987	-5.150.459	-2.987.936	-1.122.027	-188.426	0
4	BES	0	0	0	-1.520.556	-1.470.972	-1.520.556	-1.520.556	-1.520.556	-1.487.500	-3.041.111	-6.032.639	-6.032.639	-6.032.639	-6.049.187	-6.032.639	-6.032.639	-4.512.083	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
01	TOTAL	0	0	0	-3.095.935	-3.526.129	-4.047.292	-2.119.135	-2.544.074	-2.954.240	-9.942.197	-21.218.003	-19.223.623	-16.315.813	-11.994.508	-9.020.575	-7.154.666	-4.697.509	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	BPN	0	-2.708.875	3.333.676	não aplicável	não aplicável
2	BST	0	-1.572.016	1.699.861	81.729	-117.180
3	BST	0	-58.255.398	26.582.018	1.314.071	-2.028.400
4	BES	0	-1.432.851	1.351.205	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		-63.966.140	32.966.760	1.395.800	-2.145.580

(*) - Apenas para IGRF com opcionalidade.

Empréstimo	Valor	Variação MTM de empréstimos **	
		Variação na curva da taxa de juro	
		-1%	+1%
		2.590.940	-3.407.944
		1.536.847	-1.781.718
		2.314.999	-2.034.398
		6.557.394	-7.378.821
	0	13.000.188	-14.602.879

(**) - 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%
-117.926	-74.268	não aplicável	não aplicável
-35.170	-81.854	81.729	-117.180
-55.940.399	24.547.619	1.314.071	-2.028.400
5.124.643	-6.027.616	não aplicável	não aplicável
-50.966.952	18.363.881	1.395.800	-2.145.580