



Exma. Senhora
Chefe do Gabinete de Sua Excelência a
Presidente da Assembleia da República
Dra. Noémia Pizarro

SUA REFERÊNCIA	SUA COMUNICAÇÃO DE	NOSSA REFERÊNCIA	DATA
		Nº: 4512 ENT.: 4442 PROC. Nº:	05/08/2013

ASSUNTO: RESPOSTA AO REQUERIMENTO N.º 237/XII/2.ª

Encarrega-me a Secretária de Estado dos Assuntos Parlamentares e da Igualdade de enviar cópia do ofício n.º 907, datado de 05 de agosto, do Gabinete da Senhora Ministra de Estado e das Finanças, sobre o assunto supra mencionado.

Com os melhores cumprimentos,

A Chefe do Gabinete

Marina Resende

05.AGO 13 00907

Exma. Senhora
Chefe do Gabinete de S.E. a
Secretaria de Estado dos Assuntos
Parlamentares e da Igualdade

SUA REFERÊNCIA	SUA COMUNICAÇÃO DE	NOSSA REFERÊNCIA	DATA
Of. 3786	04-07-2013	ENT. 4176/2013 PROC. 08.06.08	

Assunto: Requerimento n.º 237/XII/2.ª (CDS-PP), de 4 de julho de 2013 - Contratos de Gestão de Risco Financeiro por Empresas do Setor Público.

Exma. Senhora,


Em resposta ao solicitado nos termos do requerimento em epígrafe, envia-se a informação obtida junto da Agência de Gestão de Tesouraria e da Dívida Pública - IGCP ("IGCP") referente ao universo de transações de derivados da Região Autónoma da Madeira e do seu Setor Empresarial analisadas pelo IGCP.

Assim, enviam-se em anexo as seguintes tabelas:

- Tabela 1 - Lista dos derivados contratados pela Região Autónoma da Madeira ou pelo seu Setor Empresarial, que se encontravam vivos a 31 de dezembro de 2012;
- Tabela 2 - Lista dos derivados contratados pela Região Autónoma da Madeira ou pelo seu Setor Empresarial que se venceram a 31 de dezembro de 2012.

Com os melhores cumprimentos,

A Chefe do Gabinete,



Cristina Sofia Dias

C/C: Gab. SET, Gab. SEF.

Tabela 1 – transações vivas a 31.12.2012

Ref IGCP	Empresa	Contraparte	Tipo de Instrumento	Trade Date	Maturity Date	Notional (Original)	MMM 30.04.2013	Taxa Juro do Passivo Subiacente	Cupão a Receber	Cupão a Pagar
109	APRAM	SG	KO Collar	30-Mai-06	27-Mai-25	30,000,000	-4,315,162	E6M + 0.20%	E6M capped @ 4.1725% w/ KO @ 5.25%	E6M floored @ 2.8%
111	APRAM	SG	KO Collar	30-Mai-06	25-Nov-25	63,000,000	-9,237,273	E6M + 0.1295%	E6M capped @ 4.165% w/ KO @ 5.25%	E6M floored @ 2.8%
112	APRAM	RBS	KO Collar	30-Mai-06	10-Dec-24	28,000,000	-3,842,449	E6M + 0.20%	E6M	Max(E6M, E6M) capped @ 4.06% w/ KO @ 5.25% and floored at 2.80%
113	SRS	SG	KO Collar	23-Mai-06	29-Nov-19	48,750,000	-6,763,649	E6M	E6M capped @ 4.205% with KO at 5.25%	E6M floored @ 2.8%
114	SRS	SG	KO Collar	23-Jun-06	30-Dec-17	48,750,000	-5,363,316	E6M + 0.1225%	E6M capped @ 4.245% with KO at 5.25%	E6M floored @ 2.8%
115	SRS	Citi	KO Collar	23-Mai-06	23-Dec-13	32,500,000	-796,584	E6M	E6M capped @ 4.265% with KO at 5.25%	E6M floored @ 2.8%
116	IHM	CALYON	KO Collar	19-Mai-06	27-Jun-13	35,000,000	-456,758	E6M + 0.1275%	E6M capped @ 4.273% with KO at 5.25%	E6M floored @ 2.9%
117	SMD	BSN	KIKO Collar + Range Accrual	04-Mai-11	08-Nov-32	51,000,000	-38,749,841	E6M + 0.07%	E6M	Before May 2013 -> 2.88% After May 2013 -> 3.88% or E6M + Spread dependent on step-up barriers Spread = 6% * n/N, where n is number of days when EIM fixes below 1.65% or above 5.00%
118	SDPS	BSN	KIKO Collar + Range Accrual	04-Mai-11	08-Nov-32	7,000,000	-5,318,606	E6M + 0.07%	E6M	Before May 2013 -> 2.88% After May 2013 -> 3.88% or E6M + Spread dependent on step-up barriers Spread = 6% * n/N, where n is number of days when EIM fixes below 1.65% or above 5.00%
119	SDPO	BSN	KIKO Collar + Range Accrual	04-Mai-11	08-Nov-32	36,000,000	-27,352,829	E6M + 0.07%	E6M	Before May 2013 -> 2.88% After May 2013 -> 3.88% or E6M + Spread dependent on step-up barriers Spread = 6% * n/N, where n is number of days when EIM fixes below 1.65% or above 5.00%
120	SDNM	BSN	KIKO Collar + Range Accrual	04-Mai-11	08-Nov-32	21,000,000	-15,955,817	E6M + 0.07%	E6M	Before May 2013 -> 2.88% After May 2013 -> 3.88% or E6M + Spread dependent on step-up barriers Spread = 6% * n/N, where n is number of days when EIM fixes below 1.65% or above 5.00%
121	MPE	BSN	KIKO Collar + Range Accrual	04-Mai-11	08-Nov-32	10,000,000	-7,598,008	E6M + 0.07%	E6M	Before May 2013 -> 2.88% After May 2013 -> 3.88% or E6M + Spread dependent on step-up barriers Spread = 6% * n/N, where n is number of days when EIM fixes below 1.65% or above 5.00%
122	Valor Ambiente	BBVA	KO Collar	01-Jun-06	28-Dec-15	20,000,000	-419,385	E6M + 0.1275%	E6M capped @ 4.53% w/ KO @ 5.50%	E6M floored @ 2.75%
123	EEM	BARC	Callable Swap vs Average Eur/IBor	03-Out-08	15-Nov-17	66,000,000	-9,661,219	E6M + 0.50%	Daily average of E6M from the 1st to last business day of month preceeding accrual	3.55%
133	RAM	RBS	Vanilla Swap	30-Sep-11	10-Jan-19	243,410,000	-18,434,816	E6M + 0.065%	E6M	E6M + Spread, Spread = 1.3% and 0.9% on last period
134	RAM	BES	KO Collar	19-Mai-06	28-Mar-13	156,884,000	-	E6M + 0.1225%	E6M capped @ 4.82% w/ KO @ 5.25%	E6M floored @ 2.9%
136	SMD	BSN	KO Collar + Venda de KI Cap	14-Dec-09	13-Dec-22	50,274,000	-5,698,590	E6M + 0.425%	E6M capped @ 4.43% w/ KO @ 5.50%	E6M floored according to schedule + short cap @ 4.52% w/ KI @ 5.50%
137	SDPS	BSN	KO Collar + Venda de KI Cap	14-Dec-09	13-Dec-22	42,636,000	-4,832,818	E6M + 0.425%	E6M capped @ 4.43% w/ KO @ 5.50%	E6M floored according to schedule + short cap @ 4.52% w/ KI @ 5.50%
138	SDNM	BSN	KO Collar + Venda de KI Cap	14-Dec-09	13-Dec-22	60,971,000	-2,397,026	E6M + 0.425%	E6M capped @ 4.43% w/ KO @ 5.50%	E6M floored according to schedule + short cap @ 4.52% w/ KI @ 5.50%
139	SDPO	BSN	KO Collar + Venda de KI Cap	14-Dec-09	13-Dec-22	21,147,000	-6,911,102	E6M + 0.425%	E6M capped @ 4.43% w/ KO @ 5.50%	E6M floored according to schedule + short cap @ 4.52% w/ KI @ 5.50%
140	MPE	BSN	KO Collar + Venda de KI Cap	14-Dec-09	13-Dec-22	14,972,000	-1,644,174	E6M + 0.425%	E6M capped @ 4.43% w/ KO @ 5.50%	E6M floored according to schedule + short cap @ 4.52% w/ KI @ 5.50%

Tabela 2 – Transações vencidas em 31.12.2012

Ref IGCP	Empresa	Contraparte	Tipo de Instrumento	Trade Date	Maturity Date	Notional (Original)	Cupão a Receber	Cupão a Pagar
RAM - Via Expresso	128	BCP	Vanilla Swap	29-Dez-08	31-Dez-12	56,861,842.29	E6M	3.235%
RAM - Via Expresso	129	BESI	Vanilla Swap	29-Dez-08	31-Dez-12	56,861,842.29	E6M	3.235%
RAM - Via Expresso	130	CGDBI	Vanilla Swap	29-Dez-08	31-Dez-12	56,861,842.29	E6M	3.235%
RAM - Via Expresso	131	BPI	Vanilla Swap	29-Dez-08	31-Dez-12	56,861,842.29	E6M	3.235%
RAM - Via Expresso	132	CJMadrid	Vanilla Swap	29-Dez-08	31-Dez-12	56,861,842.29	E6M	3.235%