

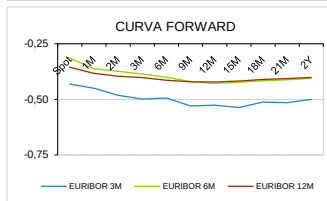
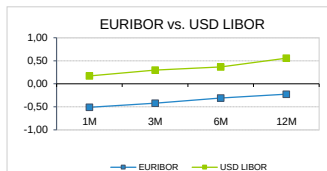
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

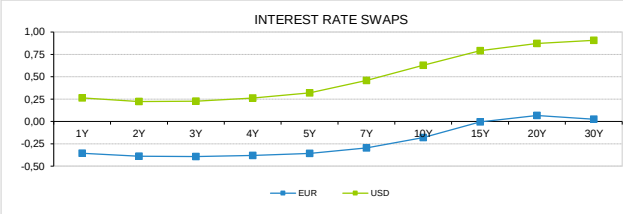
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5100	0	-3	1M	0,1710	-1	-1	0,0916	-0,7638
3M	-0,4220	-1	-12	3M	0,2961	-1	-5	0,1316	-0,6698
6M	-0,3080	-2	-15	6M	0,3669	1	-14	0,2783	-0,6176
12M	-0,2250	-2	-14	12M	0,5559	-1	-12	0,4574	-0,4646

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3565	-1	-11	-0,4235	-0,3474	-0,1912
2Y	-0,3890	-1	-9	-0,4128	-0,3116	-0,1454
3Y	-0,3925	-1	-9	-0,3907	-0,2712	-0,0990
4Y	-0,3803	-1	-8	-0,3617	-0,2280	-0,0537
5Y	-0,3585	-1	-8	-0,3277	-0,1837	-0,0072
7Y	-0,2959	0	-8	-0,2482	-0,0932	0,0779
10Y	-0,1796	0	-8	-0,1217	0,0294	0,1671
15Y	0,0046	0	-6	0,0358	0,1277	0,2038
20Y	0,0665	1	-6	0,0836	0,1278	0,1589
30Y	0,0251	2	-6	0,0257	0,0394	0,0457

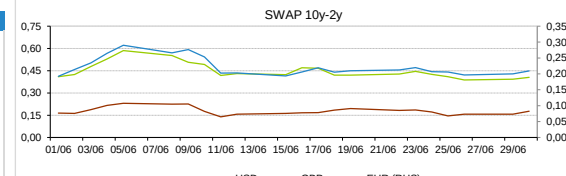
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2640	0	-3	0,1865	0,3416	0,7220
2Y	0,2225	-1	-2	0,2092	0,4540	0,7865
3Y	0,2256	-1	-3	0,2589	0,5516	0,8370
4Y	0,2609	0	-4	0,3280	0,6353	0,9020
5Y	0,3189	0	-4	0,4070	0,6820	0,9473
7Y	0,4578	0	-3	0,5530	0,7950	0,9560
10Y	0,6279	1	-3	0,7040	0,8860	1,0045
15Y	0,7917	1	-4	0,8235	0,9455	1,0330
20Y	0,8713	1	-5	0,9110	0,9510	1,0175
30Y	0,9072	1	-7	0,9251	0,9672	0,9972

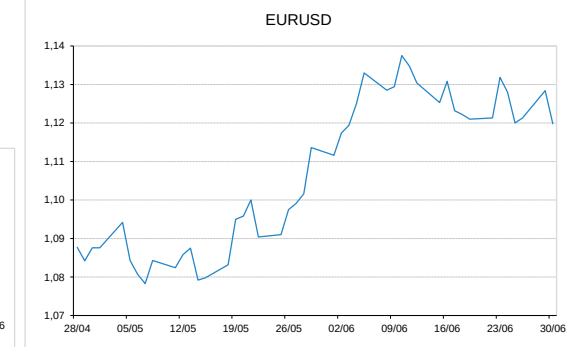
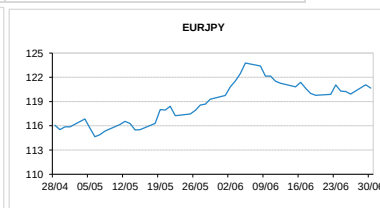
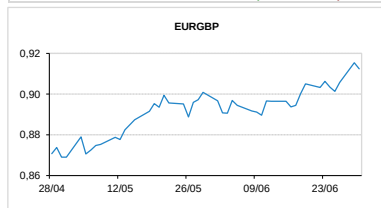


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,19	-0,52	3,35	OT 2Y	-0,473	0,00	-6,50
JETFUEL	329,15	10,40	47,90	OT 5Y	-0,080	0,02	-6,80
DIESEL	350,75	10,00	53,00	OT 10Y	0,473	0,00	-3,10
COBRE	5.969,00	4,50	585,00	BUND 10Y	-1,164	1,40	-5,30
ZINCO	2.054,25	22,75	68,00	SCHATZ 2Y	-0,064	0,46	-2,50
OURO	1.782,44	12,51	52,17	T-NOTE 10Y	1,715	0,98	-1,40
TRIGO	487,50	1,00	-36,00	T-NOTE 2Y	0,746	-0,19	0,50
LICENÇA C02	27,02	0,39	5,62	GILT 10Y	0,205	2,19	-0,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1198	-0,76%	0,74%	1,1221	1,1249	1,1294
EUR/GBP	0,91243	0,33%	-1,72%	0,9138	0,9154	0,9186
EUR/JPY	120,66	0,34%	-0,75%	120,66	120,66	120,66
EUR/CHF	1,0642	0,47%	0,53%	1,0635	1,0626	1,0613
EUR/BRL	6,163	-1,41%	-3,04%	6,1927	6,2225	6,2931
EUR/PLN	4,4433	0,43%	-0,95%	4,4510	4,4604	4,4766



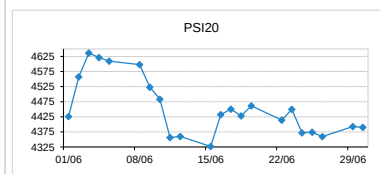
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1198	0,9124	120,66	1,0642	10,4662	7,4521	1,5300	1,63031	6,1630	10,8482
USD	0,8906	-	0,8092	107,845	0,9476	9,3148	6,6377	1,3619	1,4521	5,4904	9,6506

ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,266	2,30	-24,89
BCP	0,107	-0,74	-47,14
CORT. AMORIM	10,160	2,21	-10,09
CTT	2,120	-1,85	-33,54
EDP	4,240	-0,16	9,73
EDP R	12,300	1,15	17,14
GALP	10,250	-1,73	-31,21
IBERSOL	5,200	-0,38	-35,00
J MARTINS	15,640	-0,79	6,65
MOTA ENGIL	1,142	-0,70	-38,93
NAVIGATOR	2,170	1,02	-37,07
NOS	3,868	1,42	-19,42
PHAROL	0,102	0,00	2,41
RAMADA	3,900	-2,50	-33,22
REN	2,430	-0,82	-10,66
SEMAPA	8,160	1,12	-40,52
SONAE CAP.	0,508	0,40	-32,54
SONAE SGPS	0,643	-0,46	-29,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
ALTRI	2,30
CORT. AMORIM	2,21
NOS	1,42
EDP R	1,15
SEMAPA	1,12
J MARTINS	-0,79
REN	-0,82
GALP	-1,73
CTT	-1,85
RAMADA	-2,50



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.390,24	-0,06%	-15,80%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.947,29	0,04%	-17,24%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.240,48	0,26%	-13,48%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.335,76	0,85%	-6,89%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.077,06	0,77%	-4,76%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.243,80	-0,47%	-24,14%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.288,14	1,33%	-5,78%	24.115,95	16.358,19

