

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

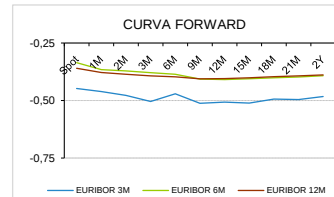
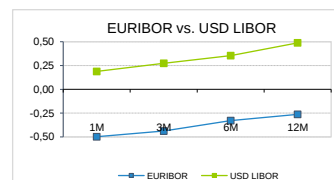
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

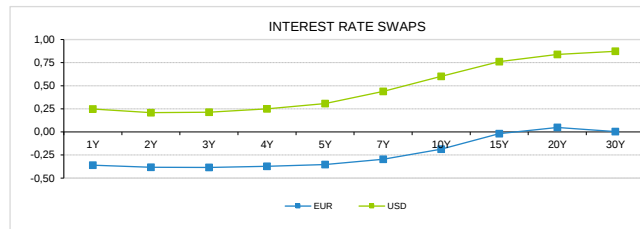
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4980	1	-1	1M	0,1883	1	1	0,0786	-0,7690
3M	-0,4380	-1	-7	3M	0,2729	0	-4	0,1154	-0,6860
6M	-0,3280	-1	-13	6M	0,3534	-1	-13	0,2554	-0,6330
12M	-0,2630	0	-13	12M	0,4881	0	-14	0,3834	-0,5024

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3600	0	-9	-0,4045	-0,3386	-0,2024
2Y	-0,3822	0	-8	-0,3966	-0,3036	-0,1604
3Y	-0,3848	-1	-9	-0,3772	-0,2700	-0,1133
4Y	-0,3744	-1	-10	-0,3499	-0,2321	-0,0679
5Y	-0,3555	-2	-11	-0,3204	-0,1893	-0,0244
7Y	-0,2994	-2	-14	-0,2490	-0,1024	0,0584
10Y	-0,1887	-2	-16	-0,1278	0,0147	0,1443
15Y	-0,0206	-2	-17	0,0223	0,1097	0,1782
20Y	0,0452	-3	-18	0,0655	0,1062	0,1333
30Y	0,0024	-3	-17	0,0064	0,0199	0,0268

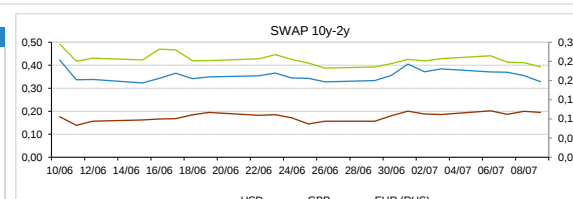
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2466	-1	-7	0,1704	0,3568	0,6920
2Y	0,2077	-1	-8	0,1962	0,4410	0,7727
3Y	0,2111	-2	-11	0,2476	0,5140	0,8070
4Y	0,2457	-2	-13	0,3147	0,5920	0,8664
5Y	0,3017	-2	-15	0,3910	0,6550	0,9051
7Y	0,4325	-3	-18	0,5333	0,7706	0,9315
10Y	0,5938	-4	-20	0,6740	0,8530	0,9840
15Y	0,7516	-4	-22	0,8129	0,9270	1,0285
20Y	0,8292	-5	-22	0,8570	0,9460	1,0000
30Y	0,8618	-5	-23	0,8880	0,9090	0,9260

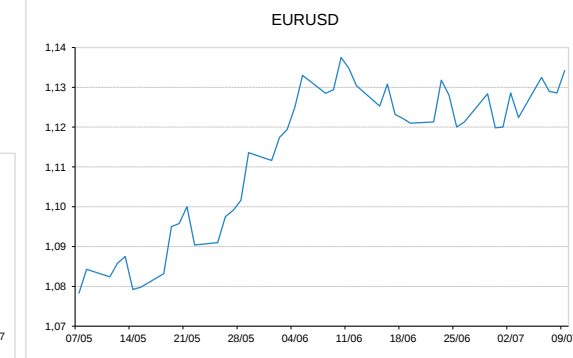
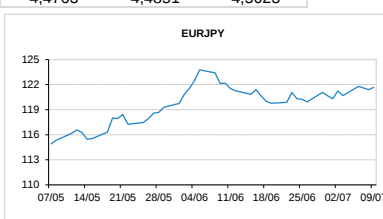


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,42	-0,87	0,91	OT 2Y	-0,477	0,01	-13,90
JETFUEL	347,60	-3,75	13,07	OT 5Y	-0,110	0,01	-17,40
DIESEL	369,60	-4,21	26,57	OT 10Y	0,410	0,00	-18,50
COBRE	6.236,00	44,00	532,50	BUND 10Y	-1,167	-2,40	-20,40
ZINCO	2.118,85	59,85	84,60	SCHATZ 2Y	-0,041	-0,92	-5,70
OURO	1.801,87	-10,76	86,41	T-NOTE 10Y	1,696	-2,24	-15,50
TRIGO	525,50	9,00	14,75	T-NOTE 2Y	0,743	-0,56	-5,70
LICENÇA CO2	28,63	-0,69	6,15	GILT 10Y	0,185	-2,19	-17,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1342	0,50%	0,43%	1,1365	1,1392	1,1437
EUR/GBP	0,89655	0,30%	-0,60%	0,8979	0,8995	0,9025
EUR/JPY	121,67	-0,23%	0,39%	121,67	121,67	121,67
EUR/CHF	1,0620	0,16%	1,58%	1,0614	1,0606	1,0591
EUR/BRL	6,007	0,67%	-7,55%	6,0361	6,0618	6,1383
EUR/PLN	4,4692	0,11%	-0,49%	4,4763	4,4851	4,5023



FIXINGS CONTRA USD e EUR

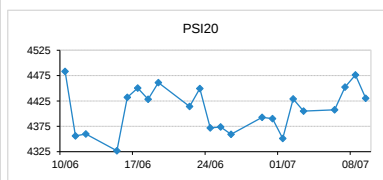
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1342	0,8966	121,67	1,0620	10,4128	7,4485	1,5338	1,62319	6,0070	10,6751
USD	0,8854	-	0,7927	107,285	0,9398	9,2127	6,5958	1,3570	1,4367	5,2994	9,4382

ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,180	-1,55	-26,30
BCP	0,106	-1,49	-47,68
CORT. AMORIM	10,180	0,99	-9,91
CTT	2,200	-0,45	-30,72
EDP	4,485	-0,99	16,72
EDP R	13,440	0,30	28,00
GALP	10,420	-2,15	-29,83
IBERSOL	5,780	0,34	-27,00
J MARTINS	15,320	0,33	4,50
MOTA ENGIL	1,188	-2,61	-36,15
NAVIGATOR	2,142	0,09	-37,60
NOS	3,502	-1,63	-26,92
PHAROL	0,100	0,00	0,80
RAMADA	3,550	-1,39	-39,21
REN	2,490	0,00	-7,90
SEMAPA	8,060	-1,59	-41,40
SONAE CAP.	0,516	-1,51	-30,68
SONAE SGPS	0,634	-1,86	-30,27

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,99
IBERSOL	0,34
J MARTINS	0,33
EDP R	0,30
NAVIGATOR	0,09
SEMAPA	-1,59
NOS	-1,63
SONAE SGPS	-1,86
GALP	-2,15
MOTA ENGIL	-2,61



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.430,35	-0,79%	-14,83%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.921,01	-1,17%	-17,65%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.261,17	-0,76%	-12,92%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.489,46	-0,02%	-5,71%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.127,08	-1,44%	-3,30%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.236,90	-1,22%	-24,21%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.529,29	0,40%	-4,77%	24.115,95	16.358,19

