

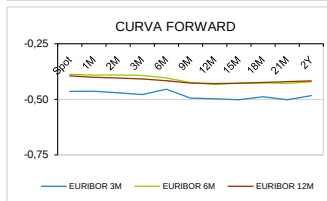
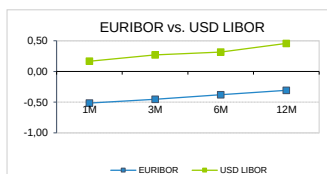
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

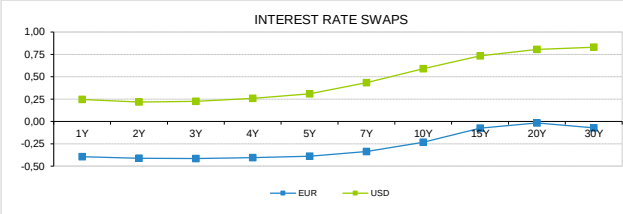
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5150	0	-1	1M	0,1663	-1	-1	0,0703	-0,7802
3M	-0,4540	0	-5	3M	0,2696	2	-4	0,0873	-0,7044
6M	-0,3790	0	-10	6M	0,3166	0	-4	0,1746	-0,6572
12M	-0,3070	-2	-11	12M	0,4569	0	-11	0,3119	-0,5264

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3945	0	-5	-0,4300	-0,3791	-0,2524
2Y	-0,4122	-1	-3	-0,4247	-0,3497	-0,2100
3Y	-0,4148	-1	-3	-0,4093	-0,3177	-0,1680
4Y	-0,4057	-1	-3	-0,3861	-0,2794	-0,1270
5Y	-0,3885	-1	-4	-0,3592	-0,2401	-0,0835
7Y	-0,3361	-1	-4	-0,2922	-0,1580	-0,0050
10Y	-0,2335	-1	-5	-0,1788	-0,0460	0,0770
15Y	-0,0750	-1	-7	-0,0373	0,0410	0,1032
20Y	-0,0168	-1	-8	-0,0019	0,0310	0,0529
30Y	-0,0720	-2	-8	-0,0726	-0,0655	-0,0637

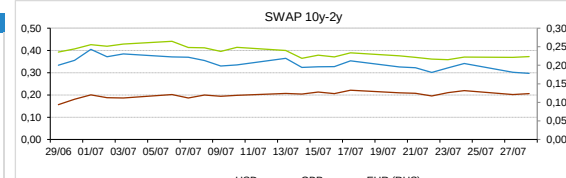
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2450	0	-2	0,1865	0,3555	0,6914
2Y	0,2169	0	-1	0,2100	0,4390	0,7390
3Y	0,2241	0	-1	0,2602	0,4985	0,7765
4Y	0,2575	0	-1	0,3262	0,5720	0,8320
5Y	0,3097	0	-1	0,3946	0,6340	0,8763
7Y	0,4338	0	-2	0,5273	0,7230	0,9090
10Y	0,5889	0	-3	0,6673	0,8220	0,9571
15Y	0,7337	1	-5	0,7866	0,8750	0,9550
20Y	0,8048	1	-5	0,8392	0,8915	0,9380
30Y	0,8298	1	-6	0,8400	0,8790	0,8974

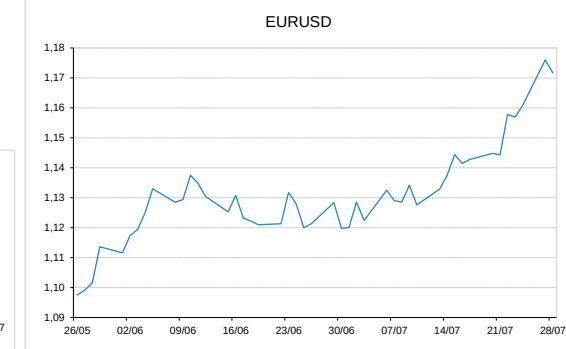
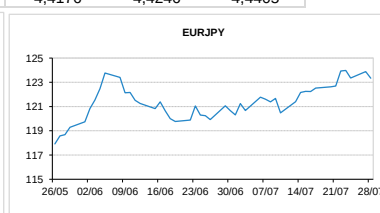


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,33	-0,08	2,40	OT 2Y	-0,443	0,00	3,50
JETFUEL	355,04	0,04	36,29	OT 5Y	-0,158	-0,01	-5,60
DIESEL	380,29	0,79	39,54	OT 10Y	0,364	0,02	-9,40
COBRE	6.434,50	5,50	463,50	BUND 10Y	-1,209	-2,13	-2,80
ZINCO	2.232,50	15,00	198,50	SCHATZ 2Y	-0,053	-2,06	2,30
OURO	1.951,13	15,96	179,84	T-NOTE 10Y	1,685	-0,84	-3,00
TRIGO	522,00	-5,75	46,25	T-NOTE 2Y	0,739	-0,93	-1,70
LICENÇA C02	25,73	0,72	1,00	GILT 10Y	0,136	-0,17	-6,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1717	-0,37%	3,84%	1,1740	1,1767	1,1812
EUR/GBP	0,90968	0,41%	0,63%	0,9110	0,9124	0,9152
EUR/JPY	123,34	0,44%	-1,84%	123,34	123,34	123,34
EUR/CHF	1,0762	0,48%	-0,65%	1,0755	1,0747	1,0732
EUR/BRL	6,0575	-0,02%	0,34%	6,0846	6,1143	6,1862
EUR/PLN	4,4118	-0,42%	1,14%	4,4176	4,4246	4,4405



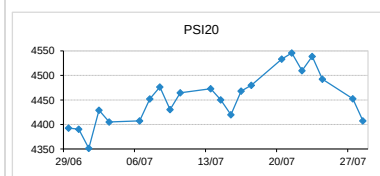
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1717	0,9097	123,34	1,0762	10,2766	7,4428	1,5675	1,63728	6,0575	10,6683
USD	0,8527	-	0,7727	104,975	0,9174	8,7632	6,3465	1,3398	1,3967	5,1738	9,1089

ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,268	-0,42	-24,86
BCP	0,101	0,50	-50,00
CORT. AMORIM	10,040	1,52	-11,15
CTT	2,295	1,77	-28,06
EDP	4,391	-0,68	16,22
EDP R	13,960	-0,43	32,95
GALP	9,606	-5,13	-35,53
IBERSOL	5,640	1,44	-29,50
J MARTINS	14,515	1,01	-1,02
MOTA ENGIL	1,180	-1,34	-36,90
NAVIGATOR	2,160	-1,28	-37,36
NOS	3,852	-3,41	-19,75
PHAROL	0,112	1,08	12,65
RAMADA	3,300	0,00	-43,49
REN	2,485	0,00	-8,64
SEMAPA	7,940	-0,50	-42,13
SONAE CAP.	0,485	-1,22	-35,59
SONAE SGPS	0,615	-1,36	-32,47

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	1,77
CORT. AMORIM	1,52
IBERSOL	1,44
PHAROL	1,08
J MARTINS	1,01
NAVIGATOR	-1,28
MOTA ENGIL	-1,34
SONAE SGPS	-1,36
NOS	-3,41
GALP	-5,13



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.407,45	-1,01%	-15,47%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.934,37	-0,12%	-17,47%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.307,30	0,13%	-11,70%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.845,85	0,04%	-3,06%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.237,43	-0,08%	0,19%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.253,50	1,14%	-24,05%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.657,38	-0,26%	-4,22%	24.115,95	16.358,19

