

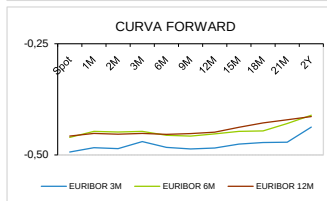
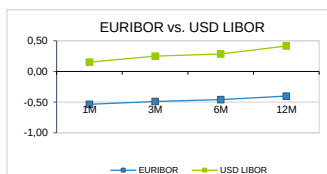
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

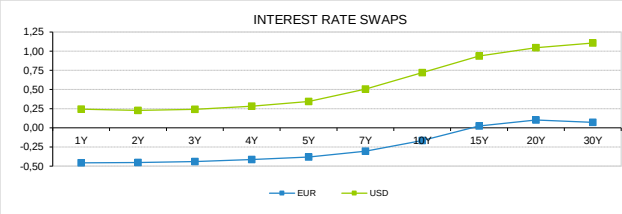
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5350	-2	-2	1M	0,1513	0	-1	0,0546	-0,7954
3M	-0,4880	1	-1	3M	0,2503	0	0	0,0593	-0,7462
6M	-0,4580	1	-4	6M	0,2853	-2	-2	0,0933	-0,7034
12M	-0,4010	1	-5	12M	0,4148	-1	-3	0,1844	-0,5660

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4570	-2	-3	-0,4488	-0,3350	-0,1730
2Y	-0,4530	1	-2	-0,4312	-0,2955	-0,1180
3Y	-0,4405	2	-1	-0,3989	-0,2547	-0,0640
4Y	-0,4147	2	0	-0,3635	-0,2060	-0,0110
5Y	-0,3811	2	2	-0,3252	-0,1562	0,0535
7Y	-0,3047	2	5	-0,2341	-0,0522	0,1330
10Y	-0,1667	2	8	-0,0890	0,0777	0,2250
15Y	0,0248	2	10	0,0785	0,1811	0,2607
20Y	0,1019	1	11	0,1295	0,1830	0,2190
30Y	0,0714	1	13	0,0792	0,0995	0,1102

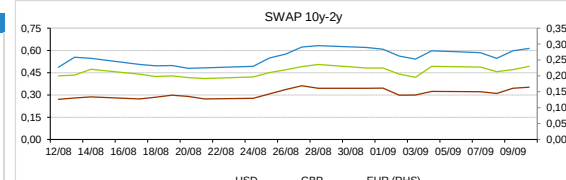
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2424	0	1	0,2145	0,4047	0,8191
2Y	0,2275	0	1	0,2381	0,5005	0,9151
3Y	0,2407	0	2	0,2950	0,6033	0,9790
4Y	0,2817	0	3	0,3701	0,7047	1,0440
5Y	0,3443	0	5	0,4563	0,7640	1,1120
7Y	0,5043	1	8	0,6320	0,9170	1,1720
10Y	0,7210	2	14	0,8320	1,0210	1,2085
15Y	0,9370	3	19	0,9810	1,1355	1,2545
20Y	1,0454	3	22	1,0640	1,1705	1,2460
30Y	1,1064	4	24	1,1025	1,1920	1,2330

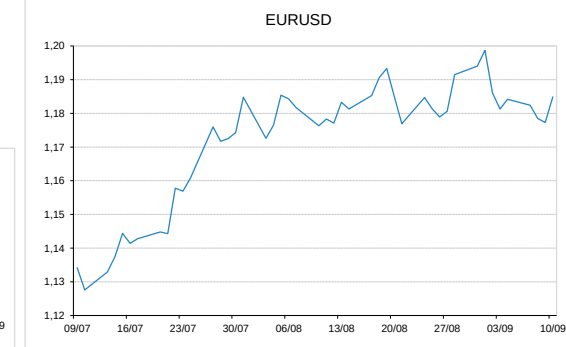
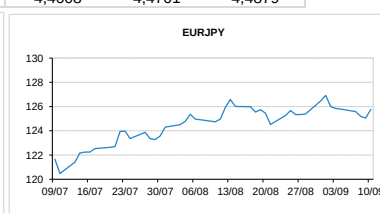


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	40,50	-0,29	-4,89	OT 2Y	-0,550	0,00	-9,80
JETFUEL	305,04	8,20	-40,47	OT 5Y	-0,175	0,00	2,20
DIESEL	329,05	6,46	-42,71	OT 10Y	0,369	0,01	7,10
COBRE	6.759,00	66,00	426,00	BUND 10Y	-0,941	3,68	4,50
ZINCO	2.398,70	7,95	0,45	SCHATZ 2Y	-0,101	2,97	1,30
OURO	1.961,45	13,06	-69,58	T-NOTE 10Y	1,718	0,98	-0,60
TRIGO	551,75	8,00	52,00	T-NOTE 2Y	0,735	0,37	-1,10
LICENÇA C02	28,12	0,92	1,41	GILT 10Y	0,341	-0,34	2,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1849	0,65%	0,73%	1,1873	1,1901	1,1949
EUR/GBP	0,9159	-0,41%	-1,57%	0,9173	0,9187	0,9216
EUR/JPY	125,76	-0,56%	-0,81%	125,76	125,76	125,76
EUR/CHF	1,0784	-0,04%	-0,33%	1,0777	1,0768	1,0756
EUR/BRL	6,2963	-0,51%	2,15%	6,3243	6,3539	6,4296
EUR/PLN	4,4540	-0,31%	-1,28%	4,4608	4,4701	4,4879



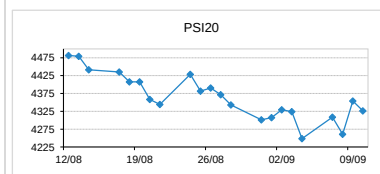
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1849	0,9159	125,76	1,0784	10,3795	7,4404	1,5633	1,62991	6,2963	10,6800
USD	0,8423	-	0,7771	106,175	0,9076	8,7417	6,2670	1,3163	1,3716	5,2972	9,0046

ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,380	-3,18	-22,92
BCP	0,094	-0,63	-53,65
CORT. AMORIM	10,240	-5,19	-9,38
CTT	2,670	0,95	-16,30
EDP	4,290	-0,53	13,60
EDP R	14,000	0,29	33,52
GALP	9,030	-0,31	-39,40
IBERSOL	5,400	0,75	-32,50
J MARTINS	14,100	-0,77	-3,85
MOTA ENGIL	1,370	-2,28	-26,52
NAVIGATOR	2,336	-0,43	-32,26
NOS	3,452	-1,20	-28,13
PHAROL	0,112	-2,61	12,45
RAMADA	3,300	0,00	-43,49
REN	2,405	0,21	-11,58
SEMAPA	8,080	-0,62	-41,11
SONAE CAP.	0,694	0,00	-7,84
SONAE SGPS	0,619	0,73	-32,03

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	0,95
IBERSOL	0,75
SONAE SGPS	0,73
EDP R	0,29
REN	0,21
NOS	-1,20
MOTA ENGIL	-2,28
PHAROL	-2,61
ALTRI	-3,18
CORT. AMORIM	-5,19



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.326,55	-0,64%	-17,03%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.028,38	-0,32%	-15,91%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.315,74	-0,31%	-11,50%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.219,45	-0,17%	-0,26%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.407,26	0,22%	5,44%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	7.001,60	-0,32%	-26,71%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.235,47	0,88%	-1,78%	24.115,95	16.358,19

