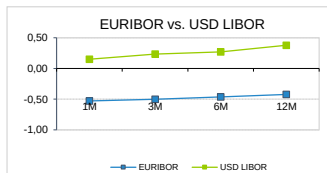


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

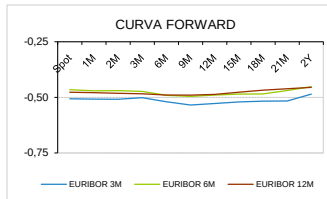
RENTA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5290	0	-1	1M	0,1500	0	0	0,0519
3M	-0,5010	-1	-2	3M	0,2333	-1	-4	0,0525
6M	-0,4630	0	-3	6M	0,2704	0	-6	0,0865
12M	-0,4230	0	-7	12M	0,3780	-1	-8	0,1674
								-0,7954
								-0,7558
								-0,7082
								-0,5644

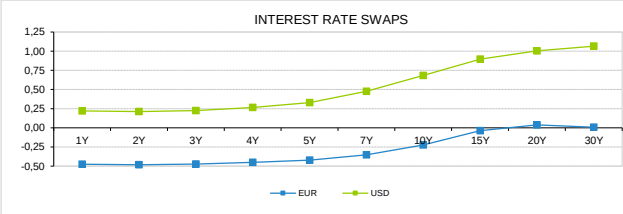


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4760	0	-5	-0,4883	-0,3886	-0,2320
2Y	-0,4820	-1	-6	-0,4708	-0,3464	-0,1801
3Y	-0,4730	-1	-7	-0,4423	-0,3070	-0,1300
4Y	-0,4507	-1	-6	-0,4080	-0,2621	-0,0790
5Y	-0,4220	-1	-5	-0,3730	-0,2156	-0,0337
7Y	-0,3518	-1	-5	-0,2883	-0,1190	0,0615
10Y	-0,2238	-1	-4	-0,1510	0,0108	0,1500
15Y	-0,0380	-1	-3	0,0135	0,1100	0,1890
20Y	0,0385	-1	-3	0,0649	0,1158	0,1500
30Y	0,0084	-1	-2	0,0156	0,0314	0,0386

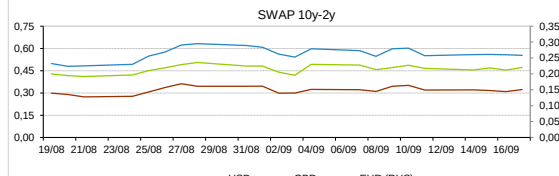
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2212	-1	-2	0,1993	0,3871	0,7590
2Y	0,2120	-1	-2	0,2252	0,4805	0,8531
3Y	0,2256	-1	-2	0,2796	0,5781	0,9289
4Y	0,2659	-1	-1	0,3547	0,6350	0,9959
5Y	0,3286	0	-1	0,4372	0,7489	1,0512
7Y	0,4764	0	0	0,5980	0,8740	1,1338
10Y	0,6837	1	2	0,7930	1,0198	1,1989
15Y	0,8965	1	4	0,9717	1,1279	1,2320
20Y	1,0051	1	5	1,0460	1,1265	1,2000
30Y	1,0649	1	6	1,0550	1,1155	1,1535

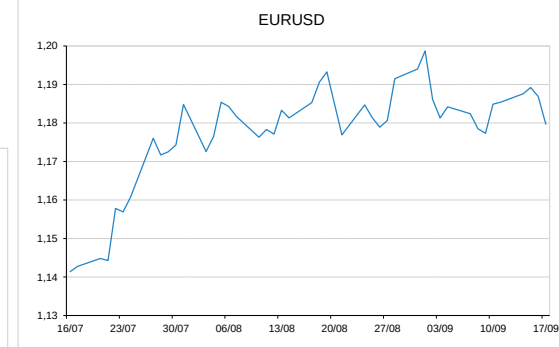
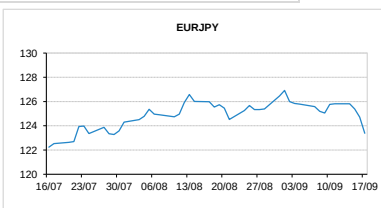
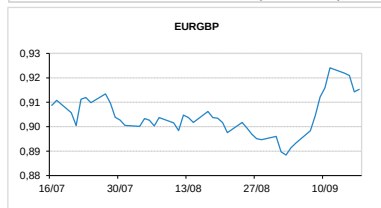


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,23	1,01	-2,69	OT 2Y	-0,578	-0,01	-12,30
JETFUEL	312,25	8,00	-39,23	OT 5Y	-0,242	-0,01	-6,80
DIESEL	328,25	4,75	-50,16	OT 10Y	0,285	0,00	-5,70
COBRE	6.792,00	15,50	410,50	BUND 10Y	-1,008	-1,42	-3,60
ZINCO	2.513,10	30,85	150,10	SCHATZ 2Y	-0,133	-1,37	-2,30
OURO	1.945,20	-20,23	-42,23	T-NOTE 10Y	1,692	-0,28	-1,80
TRIGO	545,00	3,00	18,75	T-NOTE 2Y	0,719	-0,92	-1,20
LICENÇA C02	28,56	-1,43	2,26	GILT 10Y	0,297	-2,73	-3,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1797	-0,61%	-0,47%	1,1820	1,1847	1,1895
EUR/GBP	0,9153	-0,12%	-0,99%	0,9166	0,9180	0,9208
EUR/JPY	123,38	1,09%	2,12%	123,38	123,38	123,38
EUR/CHF	1,0757	-0,10%	-0,06%	1,0750	1,0741	1,0729
EUR/BRL	6,2132	-0,36%	5,32%	6,2394	6,2718	6,3598
EUR/PLN	4,4551	-0,15%	-1,25%	4,4618	4,4710	4,4888



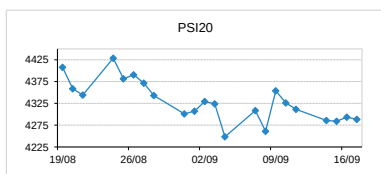
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1797	0,9153	123,38	1,0757	10,4180	7,4396	1,5615	1,62271	6,2132	10,7474
USD	0,8470	-	0,7722	104,71	0,9103	8,8152	6,3011	1,3215	1,3724	5,2611	9,0836

ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,238	1,48	-25,39
BCP	0,092	1,32	-54,49
CORT. AMORIM	10,900	3,42	-3,54
CTT	2,530	-0,59	-20,69
EDP	4,235	-0,45	12,14
EDP R	13,860	-1,70	32,00
GALP	9,066	-0,35	-39,15
IBERSOL	5,420	0,37	-32,25
J MARTINS	14,040	0,29	-4,26
MOTA ENGIL	1,312	4,13	-29,84
NAVIGATOR	2,360	-0,76	-31,56
NOS	3,300	-0,72	-31,25
PHAROL	0,115	-1,54	15,66
RAMADA	3,270	1,24	-44,01
REN	2,410	-0,41	-11,40
SEMAPA	8,070	0,37	-41,18
SONAE CAP.	0,700	-0,28	-7,04
SONAE SGPS	0,605	-0,49	-33,57

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	4,13
CORT. AMORIM	3,42
ALTRI	1,48
BCP	1,32
RAMADA	1,24
CTT	-0,59
NOS	-0,72
NAVIGATOR	-0,76
PHAROL	-1,54
EDP R	-1,70



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.288,44	-0,12%	-17,75%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.047,16	-0,54%	-15,57%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.320,83	-0,54%	-11,33%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.225,02	-0,23%	-0,18%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.368,27	-0,50%	4,26%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	7.090,10	-0,29%	-25,75%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.319,37	-0,67%	-1,43%	24.115,95	16.358,19

