

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

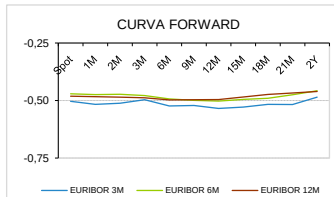
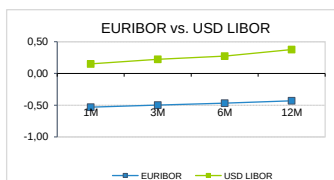
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

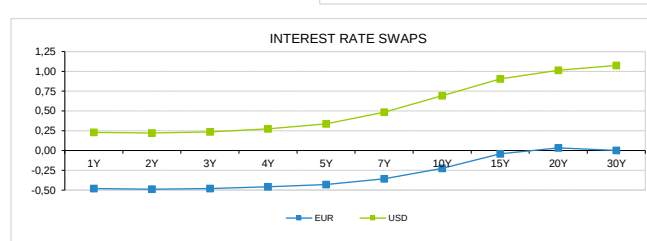
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5310	-1	-1	1M	0,1511	0	-2	0,0490	-0,8062
3M	-0,4980	1	-1	3M	0,2225	0	-3	0,0655	-0,7596
6M	-0,4680	1	-3	6M	0,2748	0	-4	0,0899	-0,7228
12M	-0,4310	1	-6	12M	0,3765	0	-6	0,1651	-0,5762

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4810	1	-3	-0,4987	-0,3939	-0,2338
2Y	-0,4886	1	-4	-0,4780	-0,3549	-0,1758
3Y	-0,4793	0	-4	-0,4497	-0,3135	-0,1247
4Y	-0,4578	1	-3	-0,4158	-0,2650	-0,0748
5Y	-0,4293	1	-3	-0,3793	-0,2165	-0,0250
7Y	-0,3563	0	-2	-0,2925	-0,1178	0,0617
10Y	-0,2250	0	-1	-0,1535	0,0085	0,1485
15Y	-0,0410	0	0	0,0080	0,1055	0,1877
20Y	0,0335	0	0	0,0584	0,1084	0,1435
30Y	0,0010	0	0	0,0075	0,0232	0,0304

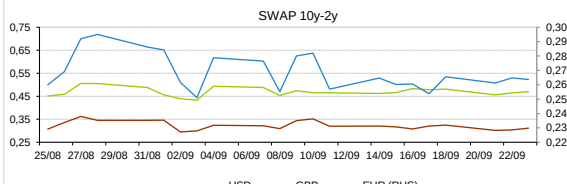
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2292	0	0	0,2123	0,3917	0,7625
2Y	0,2213	0	0	0,2245	0,4840	0,8606
3Y	0,2349	1	0	0,2885	0,5640	0,9357
4Y	0,2741	1	0	0,3628	0,6744	1,0022
5Y	0,3357	1	1	0,4440	0,7555	1,0594
7Y	0,4838	1	2	0,6000	0,8810	1,1411
10Y	0,6912	1	5	0,8017	1,0274	1,2080
15Y	0,9050	1	7	0,9816	1,1240	1,2627
20Y	1,0143	1	9	1,0682	1,1620	1,2601
30Y	1,0745	1	10	1,0950	1,1579	1,1973

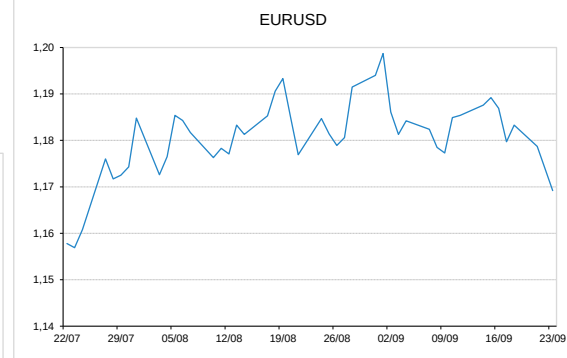
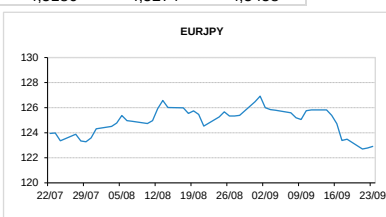


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,74	0,02	-3,19	OT 2Y	-0,599	0,00	-11,60
JETFUEL	311,75	-1,75	-21,25	OT 5Y	-0,248	0,02	-7,00
DIESEL	321,25	-3,75	-42,25	OT 10Y	0,248	-0,01	-10,50
COBRE	6,768,00	88,50	290,00	BUND 10Y	-1,021	0,34	-1,00
ZINCO	2,449,25	5,50	-0,10	SCHATZ 2Y	-0,140	0,91	-2,10
OURO	1,864,04	-36,17	-76,44	T-NOTE 10Y	1,694	1,54	-0,60
TRIGO	552,00	-6,00	17,00	T-NOTE 2Y	0,726	0,74	-0,90
LICENÇA C02	26,63	-1,22	0,98	GILT 10Y	0,328	2,22	1,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1692	-0,41%	-1,31%	1,1715	1,1740	1,1790
EUR/GBP	0,91885	-0,15%	-1,86%	0,9203	0,9217	0,9247
EUR/JPY	122,91	-0,11%	1,91%	122,91	122,91	122,91
EUR/CHF	1,0781	-0,11%	-0,29%	1,0774	1,0766	1,0752
EUR/BRL	6,4783	-1,13%	2,09%	6,5067	6,5416	6,6378
EUR/PLN	4,5110	-0,49%	-2,60%	4,5186	4,5274	4,5458



FIXINGS CONTRA USD e EUR

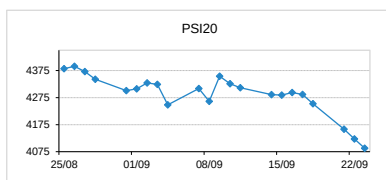
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1692	0,9189	122,91	1,0781	10,4866	7,4424	1,5616	1,64583	6,4783	11,0275
USD	0,8569	-	0,7834	105,295	0,9240	8,9818	6,3787	1,3362	1,4074	5,5528	9,4344

ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,908	-1,71	-31,20
BCP	0,084	-1,64	-58,63
CORT. AMORIM	10,500	-3,49	-7,08
CTT	2,410	0,63	-24,45
EDP	4,171	1,36	10,45
EDP R	13,820	-0,72	31,62
GALP	8,280	-3,18	-44,43
IBERSOL	5,140	-3,02	-35,75
J MARTINS	13,810	0,40	-5,83
MOTA ENGIL	1,114	-3,13	-40,43
NAVIGATOR	2,152	-2,18	-37,60
NOS	3,010	-1,12	-37,29
PHAROL	0,110	0,36	10,44
RAMADA	3,290	6,13	-43,66
REN	2,380	0,00	-12,50
SEMAPA	7,510	-1,83	-45,26
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,571	0,00	-37,25
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
RAMADA	6,13
EDP	1,36
CTT	0,63
J MARTINS	0,40
PHAROL	0,36
NAVIGATOR	-2,18
IBERSOL	-3,02
MOTA ENGIL	-3,13
GALP	-3,18
CORT. AMORIM	-3,49



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.087,51	-0,84%	-21,61%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.802,26	0,62%	-19,67%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.180,11	0,51%	-15,09%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.642,97	0,39%	-4,57%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.296,16	-0,57%	2,04%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.654,20	0,08%	-30,32%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.346,49	-0,06%	-1,31%	24.115,95	16.358,19

