

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

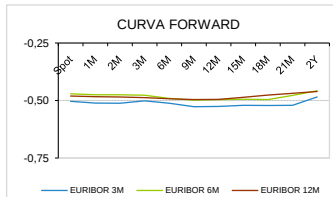
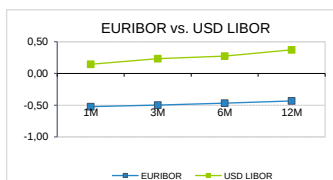
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

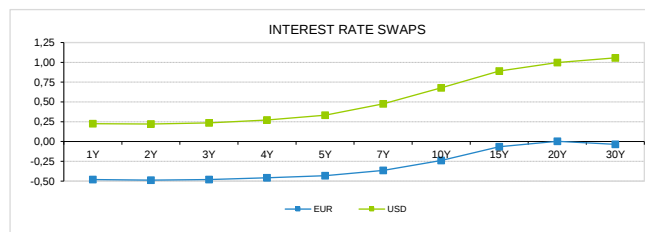
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5230	-1	-1	1M	0,1448	0	-3	0,0485	-0,8068
3M	-0,4980	-1	-2	3M	0,2333	1	0	0,0648	-0,7584
6M	-0,4680	0	-3	6M	0,2735	0	-2	0,0948	-0,7230
12M	-0,4330	0	-6	12M	0,3721	0	-7	0,1619	-0,5898

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4806	0	-4	-0,4955	-0,4000	-0,2538
2Y	-0,4877	0	-5	-0,4790	-0,3630	-0,2010
3Y	-0,4793	-1	-6	-0,4526	-0,3257	-0,1540
4Y	-0,4586	-1	-6	-0,4205	-0,2810	-0,1050
5Y	-0,4321	-1	-6	-0,3866	-0,2368	-0,0560
7Y	-0,3650	-1	-6	-0,3052	-0,1421	0,0273
10Y	-0,2405	-2	-7	-0,1730	-0,0223	0,1123
15Y	-0,0658	-2	-8	-0,0200	0,0722	0,1435
20Y	0,0030	-3	-8	0,0254	0,0715	0,1015
30Y	-0,0360	-3	-9	-0,0320	-0,0195	-0,0149

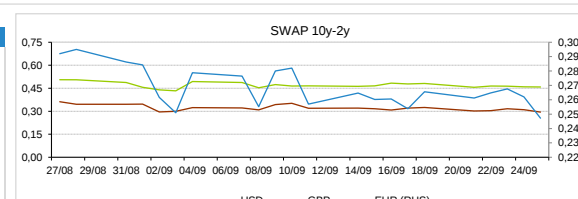
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2260	-1	-1	0,2170	0,3890	0,7480
2Y	0,2210	-1	-1	0,2404	0,4795	0,8361
3Y	0,2348	-1	-1	0,2895	0,5698	0,9120
4Y	0,2720	-1	-1	0,3595	0,6485	0,9822
5Y	0,3325	-1	-1	0,4387	0,7393	1,0377
7Y	0,4767	-1	-1	0,5944	0,8736	1,1020
10Y	0,6788	-1	0	0,7865	1,0090	1,1869
15Y	0,8896	-1	1	0,9540	1,1060	1,2235
20Y	0,9975	-1	2	1,0390	1,1440	1,2220
30Y	1,0566	-1	3	1,0760	1,1379	1,1766

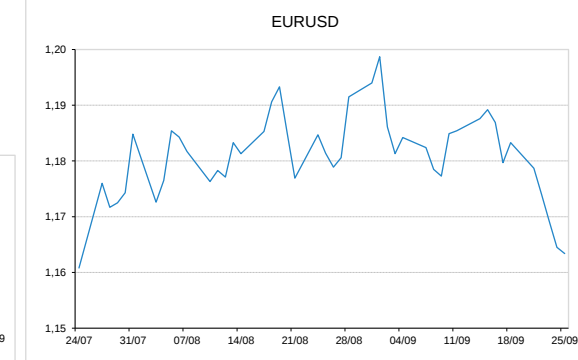
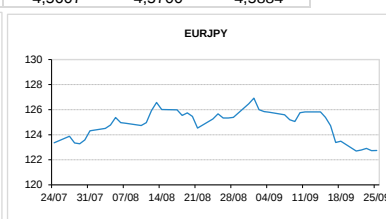


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,85	-0,09	-4,44	OT 2Y	-0,583	0,00	-9,00
JETFUEL	315,25	4,00	-27,50	OT 5Y	-0,219	0,00	-6,00
DIESEL	325,73	3,73	-47,52	OT 10Y	0,268	-0,01	-12,30
COBRE	6,576,00	-81,00	7,50	BUND 10Y	-1,043	-1,35	-12,40
ZINCO	2,355,75	-32,00	-83,00	SCHATZ 2Y	-0,140	-0,23	-4,80
OURO	1,860,45	-7,63	-67,73	T-NOTE 10Y	1,675	-0,84	-4,50
TRIGO	545,75	-4,00	10,25	T-NOTE 2Y	0,715	-0,55	-2,20
LICENÇA C02	26,29	-0,50	-2,32	GILT 10Y	0,295	-2,30	-12,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1634	-0,09%	-1,52%	1,1656	1,1683	1,1731
EUR/GBP	0,91343	-0,13%	-1,53%	0,9148	0,9162	0,9192
EUR/JPY	122,74	-0,01%	2,39%	122,74	122,74	122,74
EUR/CHF	1,0796	0,17%	-0,50%	1,0789	1,0781	1,0767
EUR/BRL	6,4694	-0,61%	0,79%	6,5000	6,5352	6,6258
EUR/PLN	4,5531	0,04%	-3,36%	4,5607	4,5700	4,5884



FIXINGS CONTRA USD e EUR

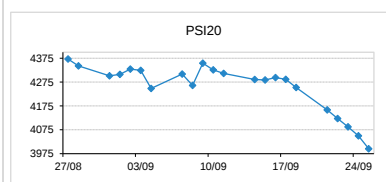
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1634	0,9134	122,74	1,0796	10,6162	7,4465	1,5580	1,65724	6,4694	11,1434
USD	0,8607	-	0,787	105,645	0,9291	9,1201	6,4091	1,3407	1,4252	5,5704	9,5828

ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,764	-2,23	-33,73
BCP	0,079	-4,23	-60,95
CORT. AMORIM	10,480	-0,19	-7,26
CTT	2,385	0,21	-25,24
EDP	4,160	0,00	10,16
EDP R	13,620	-1,73	29,71
GALP	7,806	-2,20	-47,61
IBERSOL	5,200	4,00	-35,00
J MARTINS	13,605	-0,87	-7,23
MOTA ENGIL	1,072	-2,19	-42,67
NAVIGATOR	2,066	-1,90	-40,09
NOS	2,916	-1,55	-39,25
PHAROL	0,109	-0,18	9,84
RAMADA	3,200	-1,54	-45,21
REN	2,350	-1,26	-13,60
SEMAPA	7,170	-1,92	-47,74
SONAE CAP.	0,700	-0,28	-7,04
SONAE SGPS	0,570	-0,44	-37,36
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS

Título	Variação %
IBERSOL	4,00
CTT	0,21
SEMAPA	-1,92
MOTA ENGIL	-2,19
GALP	-2,20
ALTRI	-2,23
BCP	-4,23



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.995,60	-1,33%	-23,37%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.729,66	-0,69%	-20,88%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.129,52	-0,95%	-16,44%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.469,20	-1,09%	-5,89%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.264,84	0,54%	1,04%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.614,40	-0,44%	-30,73%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.204,62	0,51%	-1,91%	24.115,95	16.358,19

