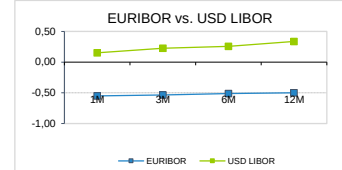


AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

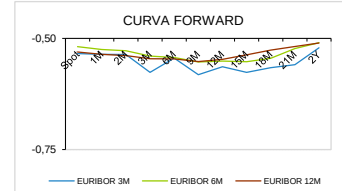
RENDA FIXA

INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5500	-1	-2	1M	0,1518	0	2	0,0343	-0,8384
3M	-0,5340	0	-2	3M	0,2259	0	-1	0,0353	-0,7864
6M	-0,5130	0	0	6M	0,2558	0	1	0,0521	-0,7328
12M	-0,4990	-1	-2	12M	0,3368	0	0	0,1264	-0,6116

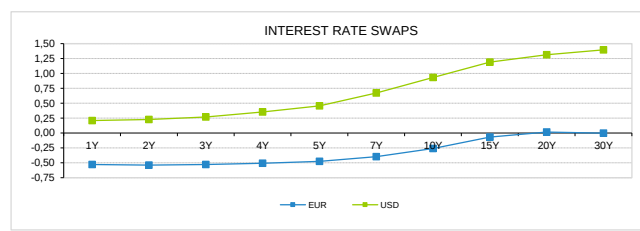


INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5297	-1	-2	-0,5480	-0,4410	-0,2596
2Y	-0,5386	-1	-2	-0,5286	-0,3972	-0,2043
3Y	-0,5291	-1	-3	-0,4990	-0,3510	-0,1532
4Y	-0,5063	-1	-3	-0,4631	-0,3003	-0,0977
5Y	-0,4757	-2	-4	-0,4219	-0,2501	-0,0480
7Y	-0,3972	-2	-5	-0,3290	-0,1467	0,0399
10Y	-0,2595	-2	-7	-0,1843	-0,0171	0,1323
15Y	-0,0680	-3	-8	-0,0152	0,0911	0,1777
20Y	0,0162	-3	-8	0,0450	0,1030	0,1464
30Y	-0,0012	-3	-8	0,0073	0,0280	0,0394

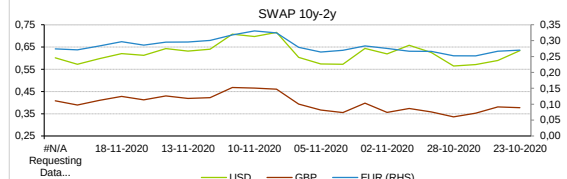
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2093	0	0	0,2375	0,5840	1,1296
2Y	0,2262	-1	-2	0,2935	0,7402	1,2167
3Y	0,2688	-1	-3	0,3890	0,8560	1,3044
4Y	0,3529	-2	-3	0,5120	0,9804	1,3690
5Y	0,4552	-3	-3	0,6347	1,0700	1,4332
7Y	0,6709	-3	-2	0,8478	1,2235	1,5208
10Y	0,9317	-4	0	1,0823	1,3824	1,5690
15Y	1,1888	-5	1	1,2938	1,4950	1,6447
20Y	1,3138	-5	2	1,3887	1,5230	1,6406
30Y	1,3955	-5	3	1,4270	1,5234	1,5670

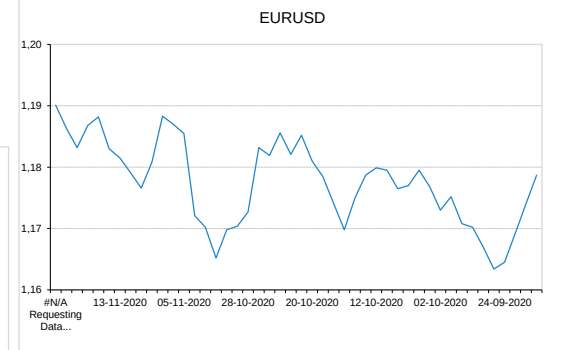
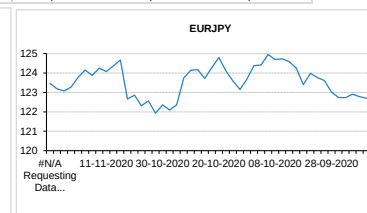


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	49,07	-0,18	9,23	OT 2Y	-0,712	-0,01	-12,10
JETFUEL	416,37	1,68	75,08	OT 5Y	-0,448	-0,03	-14,20
DIESEL	403,87	1,68	69,83	OT 10Y	0,014	-0,03	-17,50
COBRE	7.758,00	86,00	923,00	BUND 10Y	-1,259	-4,63	-1,60
ZINCO	2.735,00	-3,00	150,00	SCHATZ 2Y	-0,188	-1,83	2,50
OURO	1.864,02	25,16	-87,33	T-NOTE 10Y	1,854	-2,85	0,00
TRIGO	577,00	1,50	-32,00	T-NOTE 2Y	0,743	-0,74	0,60
LICENÇA C02	29,73	-0,38	4,31	GILT 10Y	0,456	-7,46	3,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2128	-0,26%	2,06%	1,2158	1,2183	1,2235
EUR/GBP	0,91215	-1,02%	-1,09%	0,9135	0,9150	0,9181
EUR/JPY	126,3	0,11%	-1,29%	126,30	126,30	126,30
EUR/CHF	1,0791	0,18%	0,01%	1,0784	1,0777	1,0763
EUR/BRL	6,1576	1,12%	3,32%	6,1840	6,2193	6,3381
EUR/PLN	4,4701	-0,01%	0,18%	4,4792	4,4875	4,5062



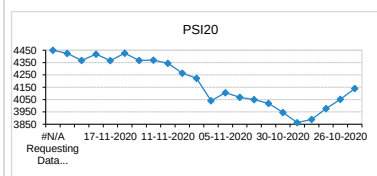
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2128	0,9122	126,30	1,0791	10,1802	7,4441	1,5532	1,62901	6,1576	10,6038
USD	0,8241	-	0,7511	104,045	0,8889	8,3901	6,1342	1,2811	1,3435	5,0729	8,7305

ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,010	0,00	-11,80
BCP	0,124	0,57	-39,00
CORT. AMORIM	10,260	-0,58	-9,20
CTT	2,570	0,19	-19,44
EDP	4,620	0,33	22,34
EDP R	18,120	1,12	72,57
GALP	9,150	-1,97	-38,59
IBERSOL	5,160	-0,77	-35,50
J MARTINS	14,075	-0,04	-4,02
MOTA ENGIL	1,404	-1,96	-24,92
NAVIGATOR	2,580	-0,77	-25,19
NOS	3,256	0,18	-32,17
PHAROL	0,127	0,00	27,51
RAMADA	3,750	-1,83	-35,79
REN	2,310	-0,43	-15,07
SEMAPA	9,320	0,65	-32,07
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A N/A	2,26
SONAE SGPS	0,683	0,74	-24,95

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	1,12
SONAE SGPS	0,74
SEMAPA	0,65
BCP	0,57
EDP	0,33
IBERSOL	-0,77
IBERSOL	-0,77
RAMADA	-1,83
MOTA ENGIL	-1,96
GALP	-1,97



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.703,77	0,02%	-9,79%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.573,38	-0,64%	-6,77%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.530,08	-0,31%	-5,79%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.271,00	-0,21%	0,17%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.695,78	-0,11%	14,37%	3.699,20	2.191,86
IBEX 35	8.275,60	-0,48%	-13,26%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.547,44	-0,76%	12,22%	26.894,25	16.358,19

