

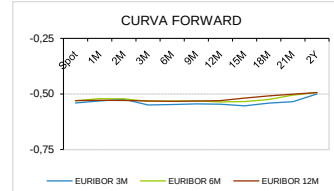
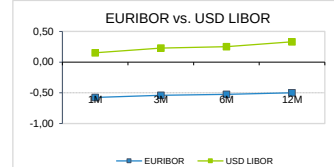
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

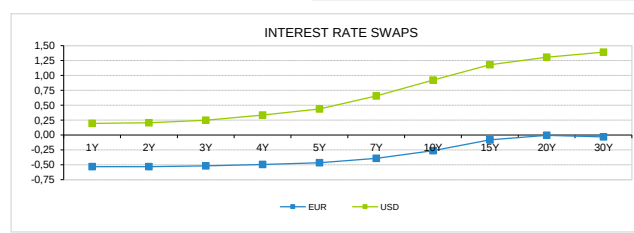
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5750	-1	-4	1M	0,1525	0	2	0,0259	-0,8280
3M	-0,5400	0	-2	3M	0,2288	1	1	0,0426	-0,7924
6M	-0,5250	-1	-2	6M	0,2518	0	1	0,0384	-0,7428
12M	-0,4990	0	-2	12M	0,3313	0	-1	0,1056	-0,6216

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5308	1	-2	-0,5316	-0,4257	-0,2597
2Y	-0,5301	1	-1	-0,5129	-0,3861	-0,2166
3Y	-0,5181	2	-1	-0,4832	-0,3447	-0,1658
4Y	-0,4943	2	-2	-0,4472	-0,3002	-0,1148
5Y	-0,4645	3	-2	-0,4095	-0,2535	-0,0630
7Y	-0,3927	3	-3	-0,3258	-0,1555	0,0226
10Y	-0,2625	3	-4	-0,1884	-0,0302	0,1076
15Y	-0,0820	3	-6	-0,0317	0,0658	0,1474
20Y	-0,0053	3	-7	0,0214	0,0730	0,1125
30Y	-0,0302	3	-7	-0,0209	-0,0037	0,0052

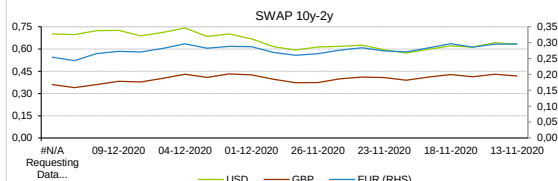
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1951	0	-2	0,2165	0,5690	1,1074
2Y	0,2043	0	-6	0,2773	0,7261	1,2010
3Y	0,2475	1	-7	0,3700	0,8534	1,2986
4Y	0,3344	1	-5	0,5020	0,9550	1,3520
5Y	0,4378	1	-3	0,6210	1,0655	1,4305
7Y	0,6555	1	-1	0,8290	1,1950	1,4850
10Y	0,9208	1	1	1,0746	1,3450	1,5660
15Y	1,1797	1	3	1,2630	1,4640	1,6040
20Y	1,3055	1	4	1,3590	1,5050	1,6060
30Y	1,3906	1	5	1,4230	1,5177	1,5678

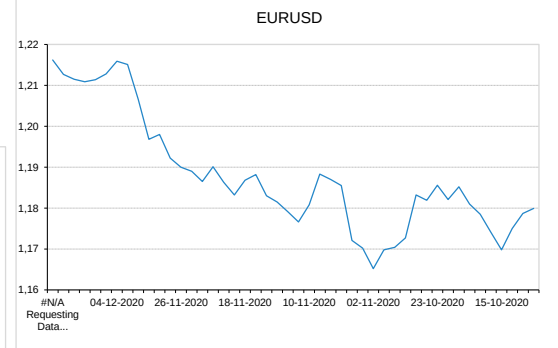
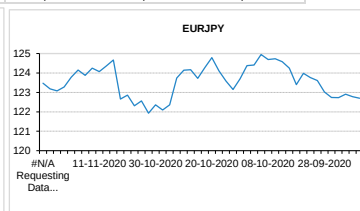
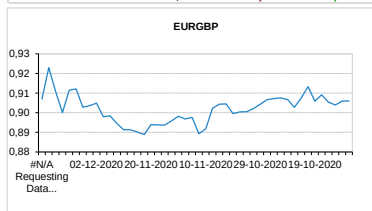


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	50,90	0,14	6,91	OT 2Y	-0,733	0,01	-12,10
JETFUEL	435,83	2,83	82,58	OT 5Y	-0,469	0,03	-11,20
DIESEL	421,57	1,32	76,57	OT 10Y	-0,006	0,05	-14,30
COBRE	7 807,00	31,50	800,00	BUND 10Y	-1,238	4,69	-9,20
ZINCO	2 797,75	-23,25	172,25	SCHATZ 2Y	-0,144	3,42	-2,90
OURO	1 854,53	0,89	-34,42	T-NOTE 10Y	1,837	-0,14	-2,70
TRIGO	592,50	-7,25	-12,25	T-NOTE 2Y	0,719	-0,18	-5,70
LICENÇA C02	31,62	-0,56	4,10	GILT 10Y	0,458	1,56	-13,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2189	0,40%	3,03%	1,2220	1,2245	1,2296
EUR/GBP	0,8995	0,94%	-0,15%	0,9009	0,9024	0,9055
EUR/JPY	125,97	0,09%	-1,44%	125,97	125,97	125,97
EUR/CHF	1,0789	-0,24%	0,25%	1,0782	1,0774	1,0759
EUR/BRL	6,2477	-1,05%	3,02%	6,2759	6,3126	6,4306
EUR/PLN	4,4416	-0,03%	0,72%	4,4499	4,4590	4,4797



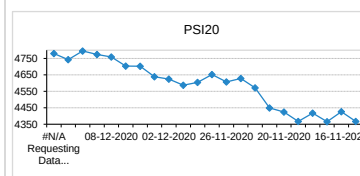
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2189	0,8995	125,97	1,0789	10,1837	7,4408	1,5536	1,60986	6,2477	10,5819
USD	0,8206	-	0,7411	103,515	0,8851	8,3660	6,1059	1,2762	1,3221	5,1253	8,6957

ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,250	-0,76	-7,57
BCP	0,125	-1,57	-38,36
CORT. AMORIM	10,700	0,00	-5,31
CTT	2,520	-1,37	-21,00
EDP	4,845	2,06	28,29
EDP R	19,780	1,75	88,38
GALP	8,808	-0,86	-40,89
IBERSOL	5,580	1,45	-30,25
J MARTINS	14,150	-0,21	-2,59
MOTA ENGIL	1,426	0,42	-23,74
NAVIGATOR	2,562	0,08	-21,46
NOS	2,986	0,00	-37,79
PHAROL	0,139	1,46	39,56
RAMADA	5,140	-0,39	-11,99
REN	2,360	0,64	-13,24
SEMAPA	9,590	-1,24	-30,10
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A N/A	2,26
SONAE SGPS	0,701	1,89	-22,97

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	2,06
SONAE SGPS	1,89
EDP R	1,75
PHAROL	1,46
IBERSOL	1,45
ALTRI	-0,76
GALP	-0,86
SEMAPA	-1,24
CTT	-1,37
BCP	-1,57



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4 796,08	0,42%	-8,02%	5 454,21	3 500,02
CAC40	5 547,68	0,31%	-7,20%	6 111,41	3 632,06
ESTX 50 PR	3 543,00	0,61%	-5,40%	3 867,28	2 302,84
XTRA DAX	13 565,98	1,52%	2,39%	13 795,24	8 255,65
S&P 500	3 702,37	0,21%	14,60%	3 712,39	2 191,86
IBEX 35	8 139,50	-0,16%	-14,76%	10 100,20	5 814,50
NIKKEI 225	26 757,40	0,26%	13,11%	26 894,25	16 358,19

