

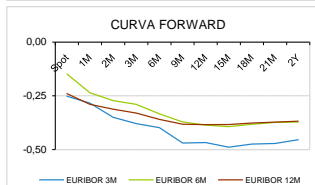
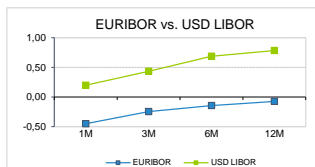
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

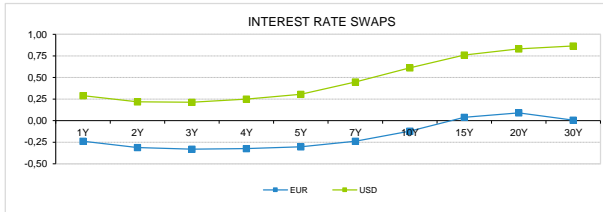
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4510	-1	-7	1M	0,1980	-2	-67	0,1594	-0,7198
3M	-0,2460	1	1	3M	0,4346	-1	-89	0,3729	-0,6122
6M	-0,1450	-3	5	6M	0,6880	-1	-54	0,5823	-0,5702
12M	-0,0750	0	2	12M	0,7829	-2	-26	0,7465	-0,4526

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2385	-1	-1	-0,3838	-0,3142	-0,1329
2Y	-0,3124	-1	-7	-0,3758	-0,2675	-0,0830
3Y	-0,3305	0	-10	-0,3565	-0,2190	-0,0397
4Y	-0,3240	0	-12	-0,3210	-0,1720	0,0054
5Y	-0,3035	0	-14	-0,2820	-0,1274	0,0630
7Y	-0,2390	1	-16	-0,1992	-0,0370	0,1262
10Y	-0,1221	2	-17	-0,0730	0,0743	0,2015
15Y	0,0385	2	-18	0,0687	0,1509	0,2156
20Y	0,0900	2	-18	0,0978	0,1306	0,1489
30Y	0,0055	2	-17	-0,0050	-0,0080	-0,0204

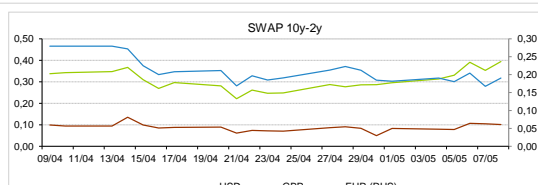
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2899	-1	-39	0,1695	0,3510	0,7125
2Y	0,2174	-3	-29	0,1470	0,4350	0,7760
3Y	0,2131	-3	-28	0,2352	0,5130	0,8495
4Y	0,2490	-3	-29	0,3010	0,6110	0,8900
5Y	0,3051	-3	-29	0,3922	0,6840	0,9271
7Y	0,4477	-1	-25	0,5383	0,7700	0,9530
10Y	0,6114	1	-19	0,6800	0,8580	0,9820
15Y	0,7601	2	-13	0,7960	0,9120	0,9920
20Y	0,8305	3	-11	0,8470	0,9270	0,9820
30Y	0,8650	3	-10	0,8797	0,9309	0,9620

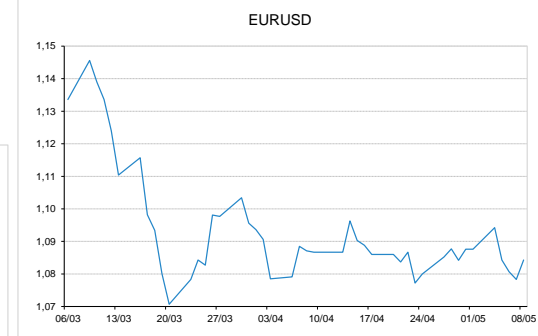
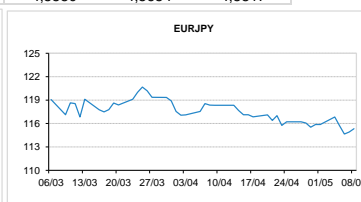
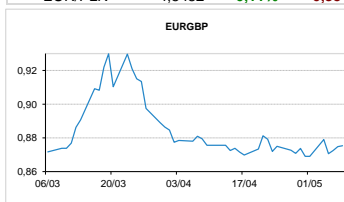


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	30,24	0,78	-4,88	OT 2Y	-0,164	-0,03	-20,70
JETFUEL	199,24	11,74	-47,91	OT 5Y	0,358	-0,01	-15,20
DIESEL	245,24	1,74	-61,63	OT 10Y	0,923	-0,02	-5,40
COBRE	5,280,50	76,00	234,00	BUND 10Y	-0,984	0,75	-22,80
ZINCO	2,001,00	27,00	82,00	SCHATZ 2Y	-0,146	-1,37	-13,90
OURO	1,714,72	-0,90	64,74	T-NOTE 10Y	1,718	0,98	-12,30
TRIGO	521,00	-1,50	-27,50	T-NOTE 2Y	0,785	-0,56	-10,20
LICENÇA C02	19,44	-0,10	-1,70	GILT 10Y	0,193	0,00	-15,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0843	0,56%	-0,26%	1,0864	1,0885	1,0932
EUR/GBP	0,87535	-0,07%	0,47%	0,8767	0,8782	0,8816
EUR/JPY	115,34	-0,37%	2,62%	115,34	115,34	115,34
EUR/CHF	1,0529	0,07%	0,22%	1,0521	1,0513	1,0493
EUR/BRL	6,2402	1,31%	-10,87%	6,2709	6,2631	6,2799
EUR/PLN	4,5482	0,11%	-0,35%	4,5580	4,5654	4,5817

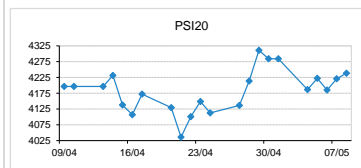


FIXINGS CONTRA USD e EUR											
	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0843	0,8754	115,34	1,0529	10,5947	7,4593	1,5112	1,65926	6,2402	11,0619
USD	0,9198	-	0,8027	106,44	0,9684	9,7393	6,8608	1,3925	1,5289	5,7422	10,1845

ACCIONISTA

TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,730	-0,08	-16,73
BCP	0,095	-0,21	-53,06
CORT. AMORIM	9,410	0,43	-16,73
CTT	2,090	0,24	-34,48
EDP	4,124	6,02	6,73
EDP R	11,100	0,00	5,71
GALP	10,260	-1,16	-31,14
IBERSOL	3,760	-2,59	-53,00
J MARTINS	15,450	-0,35	5,35
MOTA ENGIL	1,102	2,99	-41,07
NAVIGATOR	2,334	0,95	-32,32
NOS	3,366	-1,75	-29,88
PHAROL	0,069	0,88	-30,72
RAMADA	4,200	12,00	-28,08
REN	2,420	-0,21	-11,03
SEMAPA	8,960	0,79	-34,69
SONAE CAP.	0,466	0,22	-38,11
SONAE SGPS	0,695	-0,64	-23,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Varição %
RAMADA	12,00
EDP	6,02
MOTA ENGIL	2,99
NAVIGATOR	0,95
PHAROL	0,88
J MARTINS	-0,35
SONAE SGPS	-0,64
GALP	-1,16
NOS	-1,75
IBERSOL	-2,59



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.238,40	0,42%	-18,71%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.549,64	1,07%	-23,89%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.908,11	0,96%	-22,35%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	10.904,48	1,35%	-17,70%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.919,90	1,34%	-9,63%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.783,10	0,78%	-28,97%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	20.179,09	2,56%	-14,70%	24.115,95	16.358,19

