

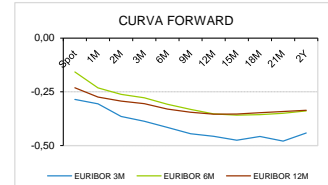
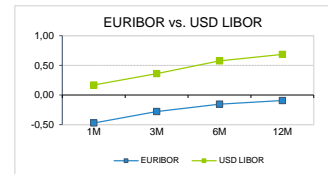
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

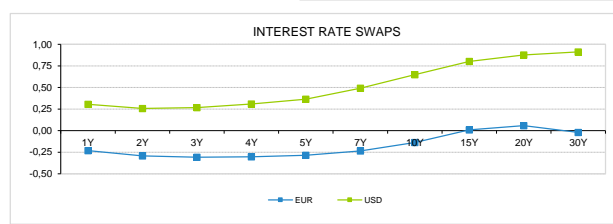
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4730	0	-6	1M	0,1683	0	-46	0,1199	-0,7476
3M	-0,2790	0	-9	3M	0,3595	0	-68	0,2650	-0,6408
6M	-0,1540	-1	-3	6M	0,5766	-1	-45	0,4273	-0,5914
12M	-0,0930	-2	-4	12M	0,6849	-2	-30	0,6039	-0,4640

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2315	0	-8	-0,3538	-0,2936	-0,1540
2Y	-0,2925	0	-10	-0,3448	-0,2585	-0,1142
3Y	-0,3080	0	-11	-0,3288	-0,2229	-0,0697
4Y	-0,3031	0	-12	-0,3026	-0,1855	-0,0308
5Y	-0,2862	0	-12	-0,2728	-0,1458	0,0106
7Y	-0,2350	0	-13	-0,2033	-0,0678	0,0782
10Y	-0,1370	0	-14	-0,0944	0,0350	0,1519
15Y	0,0088	0	-15	0,0374	0,1105	0,1689
20Y	0,0580	0	-14	0,0646	0,0928	0,1072
30Y	-0,0200	0	-12	-0,0312	-0,0352	-0,0462

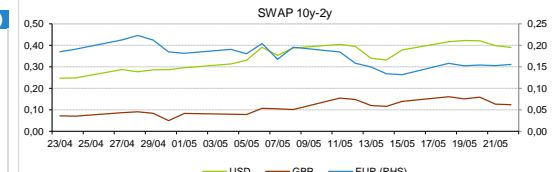
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,3050	1	-23	0,2222	0,4300	0,7360
2Y	0,2571	0	-15	0,2541	0,5060	0,8124
3Y	0,2673	0	-13	0,3060	0,5820	0,8550
4Y	0,3079	-1	-11	0,3585	0,6345	0,8950
5Y	0,3651	-1	-10	0,4470	0,7225	0,9396
7Y	0,4916	-1	-7	0,5650	0,8161	0,9930
10Y	0,6475	-1	-2	0,7200	0,8740	0,9925
15Y	0,8018	-1	3	0,8290	0,9650	1,0603
20Y	0,8766	-1	6	0,9133	0,9943	1,0340
30Y	0,9122	0	8	0,8975	0,9685	0,9899

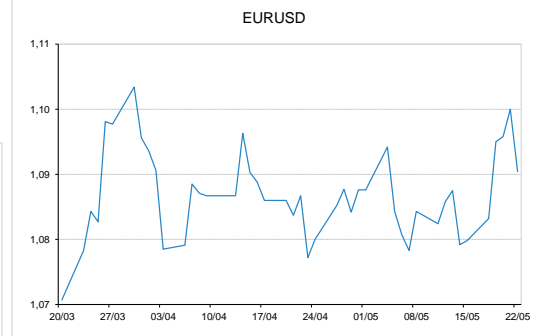
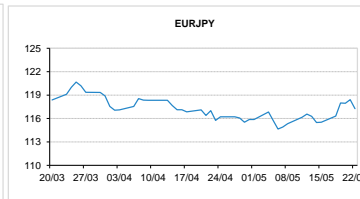
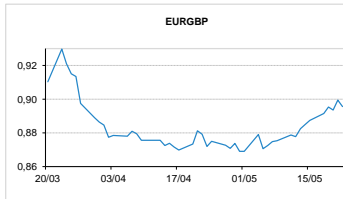


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	34,57	-1,49	10,51	OT 2Y	-0,340	-0,02	-59,20
JETFUEL	280,43	-6,32	131,44	OT 5Y	0,178	-0,01	-63,30
DIESEL	285,34	-9,16	77,85	OT 10Y	0,725	-0,03	-55,30
COBRE	5.390,00	-52,00	360,50	BUND 10Y	-0,935	0,68	-7,20
ZINCO	1.985,75	-55,25	76,75	SCHATZ 2Y	-0,050	0,46	0,50
OURO	1.731,18	6,97	17,29	T-NOTE 10Y	1,715	-1,40	-1,60
TRIGO	507,75	-8,25	-36,00	T-NOTE 2Y	0,811	-0,74	-3,90
LICENÇA C02	21,42	0,24	0,76	GILT 10Y	0,126	-0,17	-14,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0904	-0,87%	0,34%	1,0924	1,0947	1,0996
EUR/GBP	0,89563	0,42%	-1,83%	0,8970	0,8985	0,9016
EUR/JPY	117,26	0,99%	-0,21%	117,26	117,26	117,26
EUR/CHF	1,0590	0,35%	-0,71%	1,0583	1,0573	1,0555
EUR/BRL	6,0616	0,29%	-2,59%	6,0873	6,0794	6,1308
EUR/PLN	4,5179	-0,04%	0,88%	4,5283	4,5373	4,5570



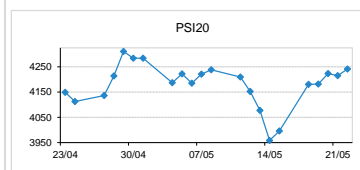
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0904	0,8956	117,26	1,0590	10,5525	7,4585	1,5279	1,66937	6,0616	10,9077
USD	0,9184	-	0,8203	107,485	0,9726	9,6922	6,8494	1,4033	1,5329	5,5640	10,0233

ACCIONISTA

TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,440	-0,63	-21,83
BCP	0,091	-1,41	-55,28
CORT. AMORIM	9,270	-0,32	-17,96
CTT	2,055	0,74	-35,58
EDP	4,220	0,62	9,21
EDP R	11,460	0,35	9,14
GALP	10,450	0,10	-29,87
IBERSOL	6,940	16,05	-13,25
J MARTINS	15,290	2,31	4,26
MOTA ENGIL	1,164	-1,85	-37,75
NAVIGATOR	2,230	0,36	-35,33
NOS	3,374	2,30	-29,71
PHAROL	0,068	-0,15	-31,63
RAMADA	4,170	2,96	-28,60
REN	2,445	0,41	-10,11
SEMAPA	8,300	-0,24	-39,50
SONAE CAP.	0,478	3,46	-36,52
SONAE SGPS	0,673	-0,15	-26,10

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	16,05
SONAE CAP.	3,46
RAMADA	2,96
J MARTINS	2,31
NOS	2,30
SEMAPA	-0,24
CORT. AMORIM	-0,32
ALTRI	-0,63
BCP	-1,41
MOTA ENGIL	-1,85



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD %	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.241,25	0,62%	-18,66%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.444,56	-0,02%	-25,65%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.905,54	0,02%	-22,42%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	11.073,87	0,07%	-16,42%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.940,32	-0,28%	-8,99%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.698,60	0,19%	-29,85%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	20.388,16	-0,80%	-13,82%	24.115,95	16.358,19

