

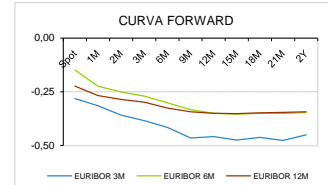
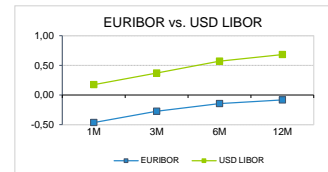
AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

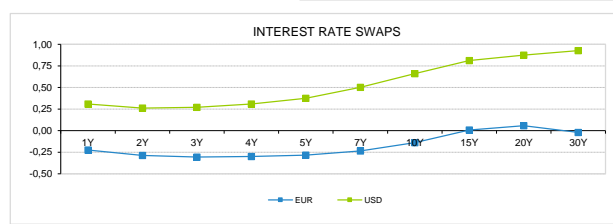
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4650	1	-5	1M	0,1738	1	-40	0,1149	-0,7480
3M	-0,2750	0	-8	3M	0,3693	1	-65	0,2533	-0,6322
6M	-0,1450	1	-1	6M	0,5700	-1	-42	0,4255	-0,5956
12M	-0,0830	1	0	12M	0,6818	0	-29	0,5951	-0,4678

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2240	1	-1	-0,3495	-0,2978	-0,1548
2Y	-0,2870	1	-2	-0,3462	-0,2605	-0,1144
3Y	-0,3058	0	-4	-0,3261	-0,2232	-0,0735
4Y	-0,3002	0	-5	-0,2993	-0,1845	-0,0370
5Y	-0,2844	0	-6	-0,2702	-0,1447	0,0030
7Y	-0,2352	0	-7	-0,2021	-0,0680	0,0771
10Y	-0,1390	0	-9	-0,0932	0,0377	0,1554
15Y	0,0080	0	-9	0,0373	0,1106	0,1715
20Y	0,0570	0	-8	0,0652	0,0938	0,1129
30Y	-0,0201	0	-5	-0,0267	-0,0319	-0,0435

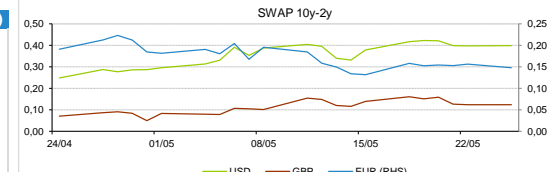
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	3,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,3090	1	-23	0,2220	0,4031	0,7358
2Y	0,2611	0	-12	0,2564	0,5146	0,8275
3Y	0,2710	-1	-11	0,3110	0,5887	0,8672
4Y	0,3090	-1	-10	0,3939	0,6661	0,9098
5Y	0,3750	0	-8	0,4615	0,7350	0,9551
7Y	0,5020	0	-5	0,5959	0,8295	0,9987
10Y	0,6600	0	-1	0,7379	0,9177	1,0436
15Y	0,8116	0	6	0,8647	0,9793	1,0757
20Y	0,8745	-2	8	0,9185	1,0133	1,0792
30Y	0,9270	0	12	0,9435	0,9813	0,9983

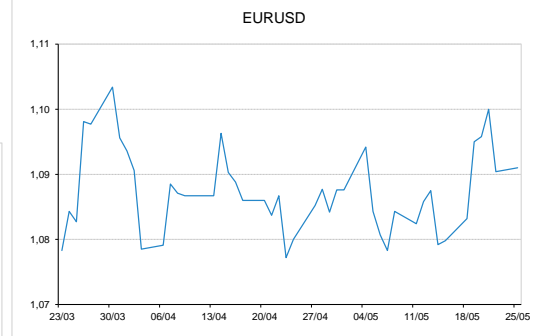
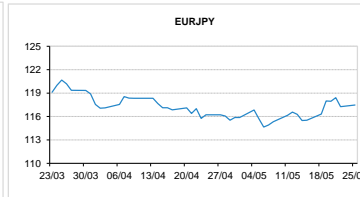
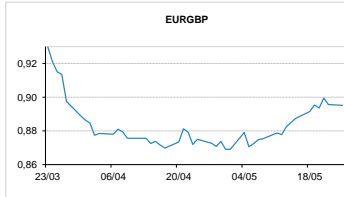


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	35,73	0,60	10,92	OT 2Y	-0,361	-0,03	-56,00
JETFUEL	281,04	-5,71	132,05	OT 5Y	0,150	-0,03	-59,60
DIESEL	290,75	-3,75	83,26	OT 10Y	0,707	-0,02	-48,90
COBRE	5,305,00	-102,00	157,00	BUND 10Y	-0,937	0,20	-6,70
ZINCO	1,985,75	0,00	93,25	SCHATZ 2Y	-0,046	0,23	2,00
OURO	1,729,07	-5,61	-0,53	T-NOTE 10Y	1,717	-0,42	-1,70
TRIGO	508,75	-7,25	-35,00	T-NOTE 2Y	0,817	0,00	-4,00
LICENÇA C02	21,61	0,21	0,87	GILT 10Y	0,124	0,00	-12,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,091	0,06%	0,53%	1,0931	1,0953	1,1002
EUR/GBP	0,89515	0,05%	-2,52%	0,8965	0,8980	0,9011
EUR/JPY	117,47	-0,18%	-1,06%	117,47	117,47	117,47
EUR/CHF	1,0583	0,09%	-0,16%	1,0575	1,0565	1,0547
EUR/BRL	5,9413	1,52%	2,99%	5,9540	5,9641	6,0198
EUR/PLN	4,5037	0,22%	0,76%	4,5140	4,5229	4,5425



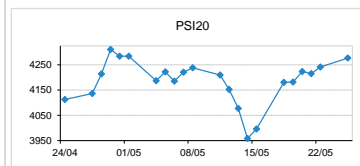
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0910	0,8952	117,47	1,0583	10,5432	7,4563	1,5224	1,66428	5,9413	10,9499
USD	0,9180	-	0,8199	107,69	0,9715	9,6853	6,8442	1,3981	1,5280	5,4584	10,0572

ACCIONISTA

TITULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,460	0,45	-21,48
BCP	0,091	0,66	-54,98
CORT. AMORIM	9,490	2,37	-16,02
CTT	2,100	2,19	-34,17
EDP	4,285	1,54	10,90
EDP R	11,720	2,27	11,62
GALP	10,450	0,00	-29,87
IBERSOL	6,960	0,29	-13,00
J MARTINS	15,000	-1,90	2,28
MOTA ENGIL	1,234	6,01	-34,01
NAVIGATOR	2,250	0,90	-34,75
NOS	3,440	1,96	-28,33
PHAROL	0,069	0,73	-31,12
RAMADA	4,400	5,52	-24,66
REN	2,445	0,00	-10,11
SEMAPA	8,410	1,33	-38,70
SONAE CAP.	0,484	1,26	-35,72
SONAE SGPS	0,678	0,74	-25,55

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	6,01
RAMADA	5,52
CORT. AMORIM	2,37
EDP R	2,27
CTT	2,19
J MARTINS	-1,90



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD %	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.276,97	0,84%	-17,97%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.539,91	2,15%	-24,06%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	2.971,35	2,27%	-20,66%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	11.391,28	2,87%	-14,02%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	2.955,45	0,24%	-8,52%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	6.856,80	2,38%	-28,20%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	20.741,65	1,73%	-12,32%	24.115,95	16.358,19

