

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

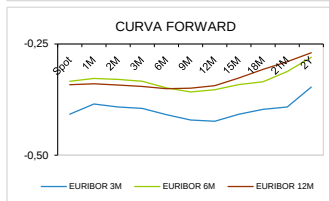
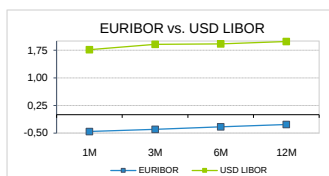
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

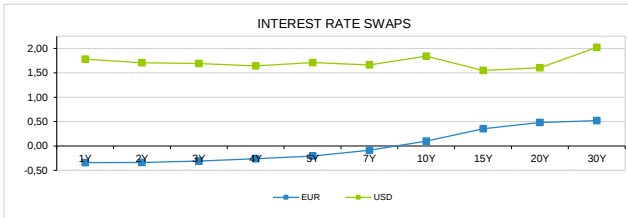
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4550	1	1	1M	1,7654	0	-15	0,7123	-0,7426
3M	-0,3990	0	2	3M	1,9099	0	-9	0,7918	-0,7026
6M	-0,3300	1	2	6M	1,9223	0	-5	0,8661	-0,6466
12M	-0,2660	-1	4	12M	1,9870	-2	3	0,9649	-0,5216

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3415	1	5	-0,3445	-0,1652	0,0916
2Y	-0,3390	-1	10	-0,3066	-0,1067	0,1593
3Y	-0,3100	-2	11	-0,2592	-0,0406	0,2321
4Y	-0,2630	-3	13	-0,2065	0,0262	0,3008
5Y	-0,2080	-3	14	-0,1468	0,0963	0,3600
7Y	-0,0890	-5	16	-0,0187	0,2250	0,4703
10Y	0,0980	-6	17	0,1660	0,3841	0,5908
15Y	0,3540	-7	19	0,3835	0,5326	0,6649
20Y	0,4810	-8	20	0,4848	0,5824	0,6641
30Y	0,5190	-9	20	0,4960	0,5434	0,5750

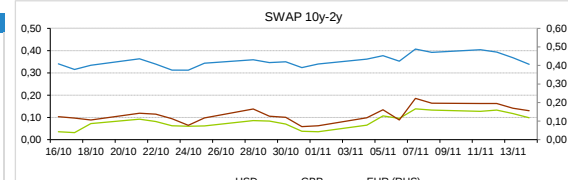
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



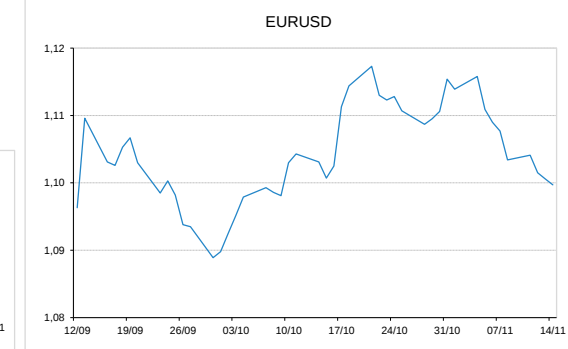
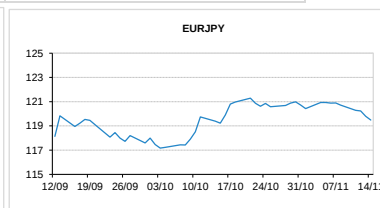
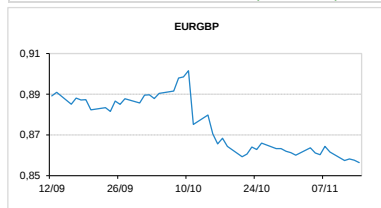
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7800	1	-2	1,4858	1,5235	1,7034
2Y	1,7050	1	5	1,4840	1,5670	1,7444
3Y	1,6910	1	10	1,4970	1,6154	1,7620
4Y	1,6430	6	11	1,5225	1,6450	1,8233
5Y	1,7090	1	15	1,5590	1,6790	1,8592
7Y	1,6610	-3	31	1,6215	1,7550	1,8830
10Y	1,8420	2	18	1,7409	1,8300	1,9285
15Y	1,5480	-8	9	1,8195	1,8980	1,9665
20Y	1,6040	-7	9	1,8680	1,9230	1,9680
30Y	2,0220	2	19	1,8850	1,9355	1,9425



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,38	0,01	3,26	OT 2Y	-0,454	0,01	12,80
JETFUEL	619,90	3,62	1,58	OT 5Y	-0,084	0,02	14,90
DIESEL	585,00	5,42	-0,58	OT 10Y	0,382	0,02	20,10
COBRE	5.829,50	-34,00	39,00	BUND 10Y	-0,797	-4,79	5,80
ZINCO	2.456,00	-58,50	6,50	SCHATZ 2Y	-0,016	-1,61	5,00
OURO	1.472,29	11,22	-21,07	T-NOTE 10Y	2,639	-4,76	3,90
TRIGO	510,25	-3,50	-6,50	T-NOTE 2Y	2,068	-3,82	0,70
LICENÇA C02	23,96	-0,43	-0,19	GILT 10Y	0,695	-4,35	-0,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0997	-0,08%	-0,31%	1,1066	1,1127	1,1248
EUR/GBP	0,85643	0,14%	2,73%	0,8592	0,8619	0,8675
EUR/JPY	119,49	0,25%	-0,08%	119,49	119,49	119,49
EUR/CHF	1,0885	0,03%	1,02%	1,0876	1,0868	1,0850
EUR/BRL	4,6173	-0,40%	-1,45%	4,6638	4,7027	4,8122
EUR/PLN	4,2870	0,05%	0,17%	4,3119	4,3347	4,3828

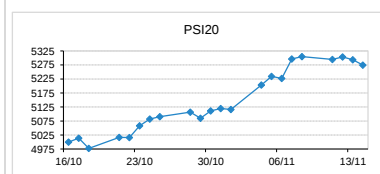

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0997	0,8564	119,49	1,0885	10,6820	7,4723	1,4605	1,6252	4,6173	10,1047
USD	0,9090	-	0,7778	108,575	0,9884	9,7138	6,7926	1,3255	1,4759	4,1885	9,1829

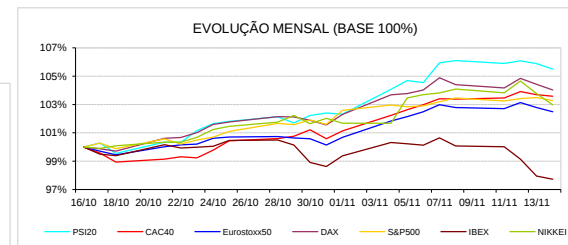
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,955	-0,08	2,67
BCP	0,210	0,00	-8,50
CORT. AMORIM	10,080	0,00	12,00
CTT	3,130	-0,76	6,25
EDP	3,697	-0,51	21,25
EDP R	10,120	-1,17	30,16
GALP	15,120	0,40	9,60
IBERSOL	7,480	-0,80	-5,32
J MARTINS	14,975	-1,16	44,83
MOTA ENGIL	2,060	-0,48	27,95
NAVIGATOR	3,562	-0,39	-1,06
NOS	5,275	-0,09	-0,38
NOVABASE	2,870	3,24	42,08
PHAROL	0,113	5,20	-30,64
RAMADA	6,260	0,97	-16,53
REN	14,060	0,14	7,33
SEMAPA	0,809	-0,74	-4,71
SONAE CAP.	0,926	-1,23	14,32
SONAE SGPS	6,260	0,97	-16,53

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	5,20
NOVABASE	3,24
RAMADA	0,97
RAMADA	0,97
GALP	0,40
CTT	-0,76
IBERSOL	-0,80
J MARTINS	-1,16
EDP R	-1,17
SONAE CAP.	-1,23



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.274,43	-0,36%	11,48%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.901,08	-0,10%	24,74%	5.931,19	4.555,99
ESTX 50 PR	3.688,81	-0,29%	22,90%	3.719,40	2.908,70
XTRA DAX	13.180,23	-0,38%	24,83%	13.308,26	10.279,20
S&P 500	3.087,40	-0,21%	23,16%	3.102,61	2.346,58
IBEX 35	9.173,30	-0,23%	7,42%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.141,55	-0,76%	15,62%	23.591,09	18.948,58



A informação mencionada é meramente indicativa e reflecte o mercado pelas 16h30. As opiniões emitidas não podem ser entendidas como conselho ou recomendação para a prática de qualquer acto. A informação foi recolhida de fontes consideradas fiáveis, não se responsabilizando, no entanto, o CaixaBI por quaisquer incorrecções que as mesmas possam conter. Para mais informações, contactar a Sala de Mercados (Assessoria e Gestão de Risco a Empresas) do CaixaBI.