

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

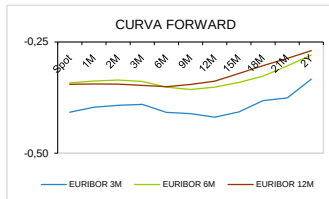
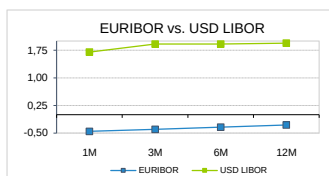
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

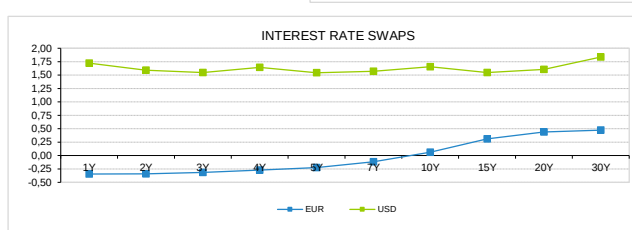
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4510	0	1	1M	1,6995	0	-11	0,7129	-0,7542
3M	-0,3990	1	1	3M	1,9186	0	-1	0,7838	-0,7166
6M	-0,3380	0	1	6M	1,9191	1	-1	0,8448	-0,6522
12M	-0,2790	0	1	12M	1,9418	3	-1	0,9333	-0,5246

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3451	0	1	-0,3390	-0,1714	0,0604
2Y	-0,3410	-1	2	-0,3052	-0,1189	0,1321
3Y	-0,3140	-1	2	-0,2605	-0,0590	0,2020
4Y	-0,2720	-1	3	-0,2119	0,0052	0,2696
5Y	-0,2240	0	4	-0,1571	0,0717	0,3300
7Y	-0,1160	0	4	-0,0352	0,1998	0,4400
10Y	0,0630	0	4	0,1474	0,3635	0,5660
15Y	0,3110	0	4	0,3700	0,5191	0,6540
20Y	0,4380	0	5	0,4757	0,5714	0,6474
30Y	0,4730	0	4	0,4848	0,5312	0,5636

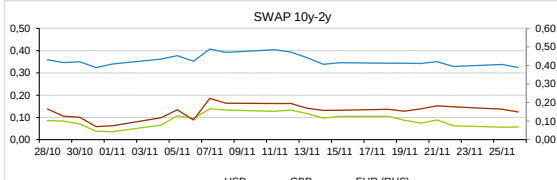
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7230	2	-2	1,4410	1,4670	1,6080
2Y	1,5900	2	-4	1,4290	1,5080	1,6390
3Y	1,5480	1	-4	1,4552	1,5528	1,6740
4Y	1,6430	6	11	1,4790	1,5720	1,7339
5Y	1,5430	1	-4	1,4960	1,6055	1,7701
7Y	1,5700	-9	-5	1,5530	1,6770	1,7990
10Y	1,6550	0	-5	1,6485	1,7530	1,8450
15Y	1,5480	-8	9	1,7430	1,8190	1,8820
20Y	1,6040	-7	9	1,7850	1,8613	1,9066
30Y	1,8360	0	-6	1,8192	1,8473	1,8673

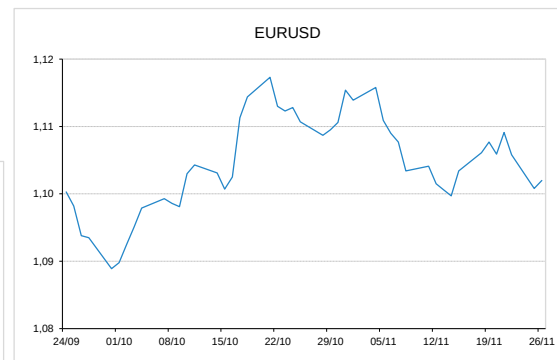
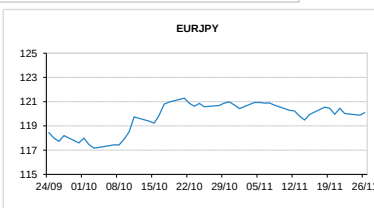
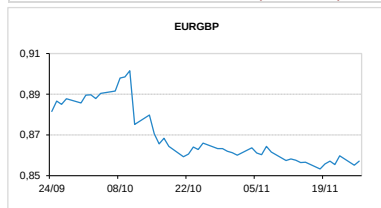


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,86	0,21	2,13	OT 2Y	-0,538	-0,06	-2,20
JETFUEL	619,58	-0,92	-14,42	OT 5Y	-0,122	-0,02	5,50
DIESEL	585,75	-0,75	-16,35	OT 10Y	0,372	-0,01	15,00
COBRE	5,871,00	13,00	-57,00	BUND 10Y	-0,825	-2,49	-0,70
ZINCO	2,302,50	-26,75	-234,50	SCHATZ 2Y	0,000	-0,46	3,00
OURO	1,458,99	2,63	-43,76	T-NOTE 10Y	2,608	-1,68	-1,50
TRIGO	529,00	-4,00	5,50	T-NOTE 2Y	2,084	-1,34	0,40
LICENÇA C02	24,35	-0,09	-0,62	GILT 10Y	0,631	-4,23	-2,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,102	0,11%	-0,60%	1,1088	1,1150	1,1271
EUR/GBP	0,85715	-0,23%	0,72%	0,8598	0,8625	0,8680
EUR/JPY	120,09	-0,17%	0,50%	120,09	120,09	120,09
EUR/CHF	1,0988	-0,16%	0,52%	1,0978	1,0969	1,0950
EUR/BRL	4,6925	-0,79%	-5,55%	4,7236	4,7654	4,8980
EUR/PLN	4,3052	-0,16%	-0,75%	4,3327	4,3572	4,4051



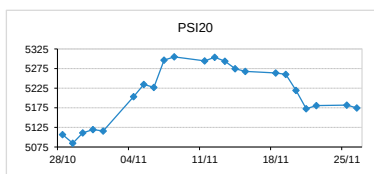
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1020	0,8572	120,09	1,0988	10,5735	7,4713	1,4634	1,62327	4,6925	10,1036
USD	0,9080	-	0,7787	109,075	0,9981	9,5954	6,7833	1,3293	1,4742	4,2654	9,1721

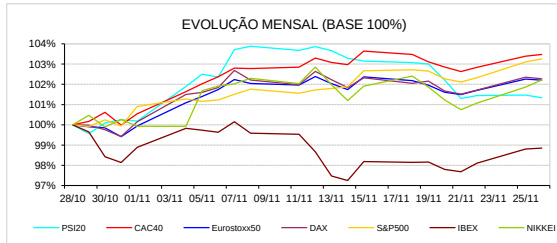
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,695	-0,96	-1,81
BCP	0,201	-0,54	-12,46
CORT. AMORIM	10,680	0,75	18,67
CTT	3,108	-1,52	5,50
EDP	3,655	0,14	19,88
EDP R	10,040	0,00	29,13
GALP	14,940	-0,57	8,30
IBERSOL	7,400	0,27	-6,33
J MARTINS	14,740	0,27	42,55
MOTA ENGIL	1,974	-3,42	22,61
NAVIGATOR	3,620	0,39	0,56
NOS	4,924	-1,01	-7,01
NOVABASE	2,850	0,35	48,27
PHAROL	0,110	-0,36	-32,60
RAMADA	6,140	-0,65	-18,13
REN	13,860	-0,57	5,80
SEMAPA	0,804	0,50	-5,30
SONAE CAP.	0,919	0,22	13,40
SONAE SGPS	6,140	-0,65	-18,13

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,75
SEMAPA	0,50
NAVIGATOR	0,39
NOVABASE	0,35
J MARTINS	0,27
RAMADA	-0,65
ALTRI	-0,96
NOS	-1,01
CTT	-1,52
MOTA ENGIL	-3,42



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.174,80	-0,13%	9,37%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.929,62	0,08%	25,34%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.705,55	-0,06%	23,46%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.236,42	-0,08%	25,36%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.138,88	0,15%	25,19%	3.139,35	2.346,58
IBEX 35	9.324,80	0,05%	9,19%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.373,32	0,35%	16,78%	23.608,06	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.