

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

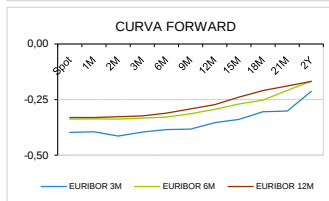
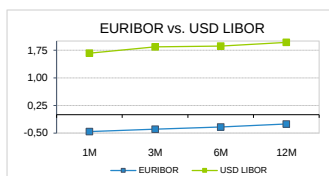
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

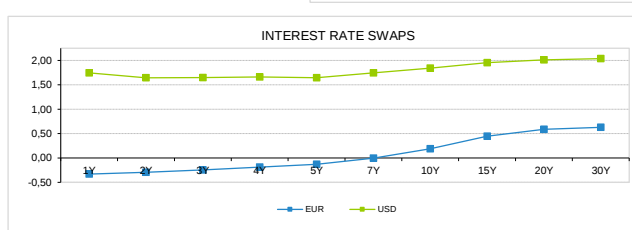
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4580	0	1	1M	1,6696	-1	-7	0,6806	-0,7742
3M	-0,3930	0	1	3M	1,8426	1	-6	0,7578	-0,6732
6M	-0,3340	-1	1	6M	1,8645	-1	-4	0,8050	-0,6176
12M	-0,2520	-1	1	12M	1,9631	0	0	0,8646	-0,4834

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3306	0	1	-0,2729	-0,0487	0,2008
2Y	-0,2940	1	3	-0,2215	0,0118	0,2630
3Y	-0,2460	1	3	-0,1636	0,0737	0,3330
4Y	-0,1890	1	3	-0,1026	0,1370	0,4000
5Y	-0,1290	1	4	-0,0422	0,2040	0,4630
7Y	-0,0050	1	4	0,0829	0,3328	0,5730
10Y	0,1880	1	5	0,2691	0,4980	0,6986
15Y	0,4470	1	5	0,5000	0,6625	0,7910
20Y	0,5860	1	6	0,6066	0,7103	0,7884
30Y	0,6280	1	7	0,6200	0,6717	0,7060

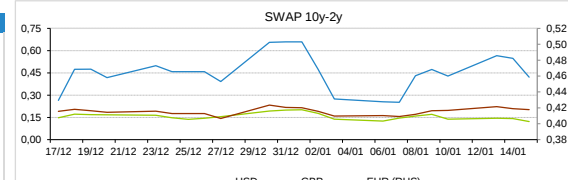
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



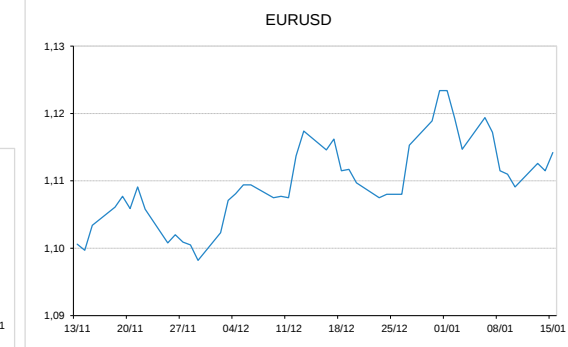
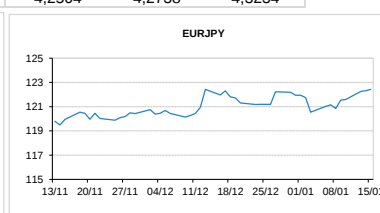
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7450	3	1	1,5353	1,5962	1,7605
2Y	1,6440	1	1	1,5190	1,6336	1,7971
3Y	1,6480	7	4	1,5400	1,6754	1,8329
4Y	1,6600	8	2	1,5865	1,6990	1,8500
5Y	1,6470	2	1	1,6201	1,7516	1,9045
7Y	1,7440	9	7	1,6720	1,7910	1,9475
10Y	1,8400	9	9	1,7867	1,8941	1,9810
15Y	1,9530	9	9	1,8680	1,9520	2,0409
20Y	2,0120	11	12	1,9170	1,9937	2,0170
30Y	2,0370	10	11	1,9434	1,9713	1,9853



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,92	-0,57	-0,33	OT 2Y	-0,342	0,13	20,40
JETFUEL	622,83	3,99	-12,17	OT 5Y	0,063	0,17	19,60
DIESEL	586,25	4,00	-14,75	OT 10Y	0,502	0,08	12,10
COBRE	6.310,50	12,00	172,00	BUND 10Y	-0,826	-3,18	3,10
ZINCO	2.380,00	-4,00	124,50	SCHATZ 2Y	0,039	-0,92	1,80
OURO	1.550,42	6,84	74,09	T-NOTE 10Y	2,645	-1,69	-8,80
TRIGO	573,25	4,75	40,75	T-NOTE 2Y	2,026	-1,34	-5,80
LICENÇA C02	24,48	0,64	0,31	GILT 10Y	0,573	-7,46	-17,50


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1142	0,24%	-0,04%	1,1205	1,1268	1,1395
EUR/GBP	0,85683	-0,08%	-2,65%	0,8592	0,8616	0,8663
EUR/JPY	122,43	-0,09%	-0,38%	122,43	122,43	122,43
EUR/CHF	1,0752	0,22%	1,91%	1,0744	1,0735	1,0717
EUR/BRL	4,662	-1,36%	-2,96%	4,6893	4,7308	4,8609
EUR/PLN	4,2286	-0,28%	0,70%	4,2504	4,2738	4,3234

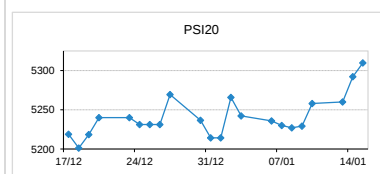

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1142	0,8568	122,43	1,0752	10,5400	7,4728	1,4553	1,61461	4,6620	9,8846
USD	0,8968	-	0,7679	109,985	0,9650	9,4527	6,7014	1,3047	1,4488	4,1723	8,8651

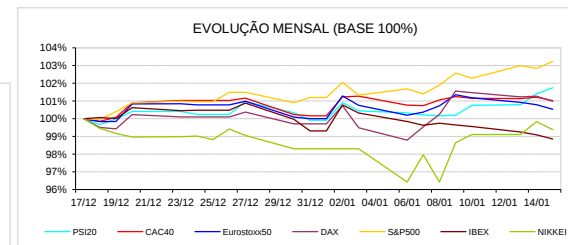
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,770	-0,94	1,58
BCP	0,198	-1,64	-2,47
CORT. AMORIM	11,580	0,52	2,48
CTT	3,268	-1,57	2,45
EDP	4,051	2,87	4,84
EDP R	10,700	0,94	1,90
GALP	15,170	-1,59	1,81
IBERSOL	8,340	0,00	4,25
J MARTINS	15,855	3,70	8,11
MOTA ENGL	1,811	-1,36	-3,16
NAVIGATOR	3,366	-0,18	-2,39
NOS	4,924	-1,05	2,58
NOVABASE	2,700	1,89	4,65
PHAROL	0,101	-0,98	1,41
RAMADA	5,740	0,00	-1,71
REN	13,020	-1,06	-5,10
SEMAPA	0,789	1,28	4,78
SONAE CAP.	0,884	-0,62	-2,86
SONAE SGPS	5,740	0,00	-1,71

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	3,70
EDP	2,87
NOVABASE	1,89
SEMAPA	1,28
EDP R	0,94
REN	-1,06
MOTA ENGL	-1,36
CTT	-1,57
GALP	-1,59
BCP	-1,64



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.309,86	0,33%	1,84%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.029,15	-0,19%	0,85%	6.071,66	4.754,69
ESTX 50 PR	3.765,36	-0,25%	0,54%	3.807,09	3.044,53
XTRA DAX	13.418,77	-0,28%	1,28%	13.548,20	10.812,59
S&P 500	3.295,69	0,38%	2,01%	3.297,91	2.585,10
IBEX 35	9.505,40	-0,24%	-0,46%	9.705,40	8.409,20
NIKKEI 225	23.916,58	-0,45%	1,10%	24.091,12	20.110,76



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.