

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

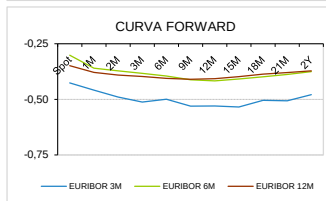
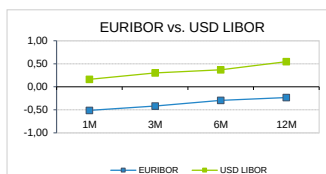
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

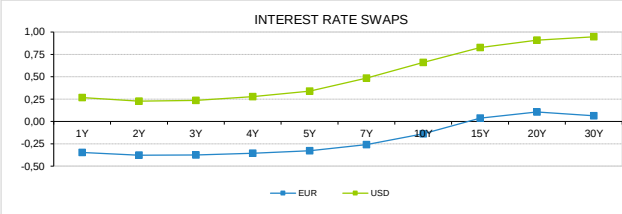
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5120	0	-1	1M	0,1623	-1	-2	0,0903	-0,7674
3M	-0,4170	1	-9	3M	0,3020	1	-4	0,1409	-0,6760
6M	-0,2950	1	-13	6M	0,3693	0	-14	0,2944	-0,6264
12M	-0,2330	-1	-13	12M	0,5458	-1	-13	0,4286	-0,4724

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3478	1	-10	-0,4074	-0,3023	-0,1450
2Y	-0,3778	1	-8	-0,3894	-0,2578	-0,0961
3Y	-0,3758	1	-7	-0,3617	-0,2201	-0,0503
4Y	-0,3562	2	-6	-0,3244	-0,1768	-0,0049
5Y	-0,3273	3	-5	-0,2879	-0,1328	0,0480
7Y	-0,2592	3	-5	-0,2061	-0,0426	0,1256
10Y	-0,1389	4	-4	-0,0766	0,0777	0,2135
15Y	0,0362	3	-2	0,0790	0,1725	0,2469
20Y	0,1057	3	-2	0,1254	0,1712	0,1997
30Y	0,0635	3	-2	0,0657	0,0809	0,0871

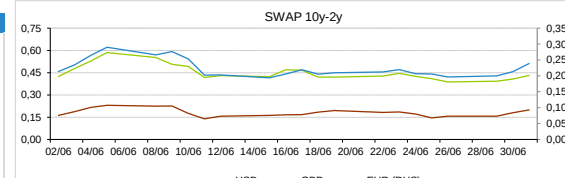
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2675	0	-2	0,1882	0,4014	0,7595
2Y	0,2269	0	-2	0,2208	0,4890	0,8380
3Y	0,2357	1	-2	0,2789	0,5912	0,8980
4Y	0,2767	1	-2	0,3582	0,6630	0,9430
5Y	0,3391	2	-2	0,4425	0,7320	0,9901
7Y	0,4840	2	-1	0,5850	0,8330	1,0250
10Y	0,6589	3	0	0,7385	0,9300	1,0853
15Y	0,8272	3	-1	0,8780	1,0195	1,0990
20Y	0,9089	3	-1	0,9400	1,0398	1,1025
30Y	0,9465	3	-3	0,9668	1,0133	1,0350

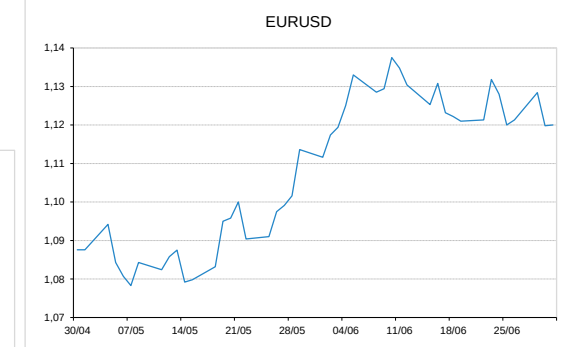
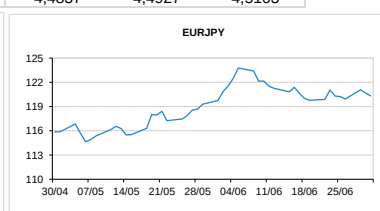


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,89	0,62	3,46	OT 2Y	-0,458	0,01	-5,00
JETFUEL	340,59	7,13	50,79	OT 5Y	-0,056	0,03	-5,80
DIESEL	361,14	4,64	56,84	OT 10Y	0,475	0,00	-3,90
COBRE	6.039,00	53,50	638,50	BUND 10Y	-1,094	7,49	-4,30
ZINCO	2.038,25	-16,00	52,00	SCHATZ 2Y	-0,025	3,89	0,70
OURO	1.765,05	-18,63	26,20	T-NOTE 10Y	1,734	1,40	0,00
TRIGO	494,75	3,00	-23,50	T-NOTE 2Y	0,754	0,93	0,80
LICENÇA C02	27,63	0,66	6,66	GILT 10Y	0,240	4,31	-2,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,12	0,02%	0,76%	1,1223	1,1251	1,1297
EUR/GBP	0,9043	0,90%	-0,84%	0,9057	0,9073	0,9104
EUR/JPY	120,31	0,29%	-0,47%	120,31	120,31	120,31
EUR/CHF	1,0644	0,04%	0,51%	1,0637	1,0628	1,0615
EUR/BRL	6,0375	1,76%	-0,99%	6,0897	6,1223	6,1915
EUR/PLN	4,4757	-0,67%	-1,67%	4,4837	4,4927	4,5103



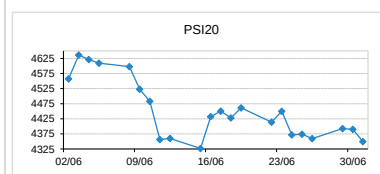
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1200	0,9043	120,31	1,0644	10,4654	7,4524	1,5292	1,62792	6,0375	10,7204
USD	0,8882	-	0,8029	107,52	0,9452	9,3032	6,6190	1,3571	1,4446	5,3544	9,5341

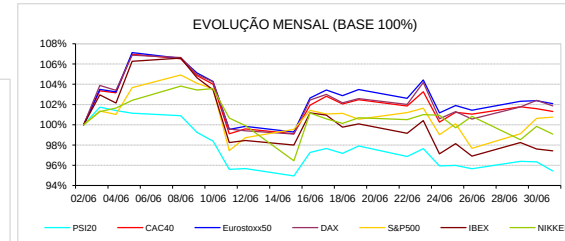
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,220	-1,12	-25,70
BCP	0,107	-0,19	-47,34
CORT. AMORIM	10,220	1,39	-9,56
CTT	2,100	-0,47	-34,17
EDP	4,281	0,73	10,79
EDP R	12,360	0,49	17,71
GALP	10,305	0,10	-30,84
IBERSOL	5,180	-0,38	-35,25
J MARTINS	15,165	-2,69	3,41
MOTA ENGL	1,130	-1,05	-39,57
NAVIGATOR	2,142	-1,02	-37,89
NOS	3,616	0,28	-24,67
PHAROL	0,101	-1,55	1,81
RAMADA	3,810	-2,31	-34,76
REN	2,440	0,41	-10,29
SEMAPA	8,070	-0,25	-41,18
SONAE CAP.	0,510	0,39	-32,27
SONAE SGPS	0,637	-0,86	-30,05

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	1,39
EDP	0,73
EDP R	0,49
REN	0,41
SONAE CAP.	0,39
MOTA ENGL	-1,05
ALTRI	-1,12
PHAROL	-1,55
RAMADA	-2,31
J MARTINS	-2,69



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.349,62	-0,93%	-16,58%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.922,43	-0,27%	-17,66%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.224,80	-0,29%	-13,89%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.245,70	-0,53%	-7,57%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.104,39	0,12%	-3,92%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.217,40	-0,19%	-24,42%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.121,73	-0,75%	-6,49%	24.115,95	16.358,19



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.