

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
1M	-0,5560	-1	0	1M	0,1061	0	0	0,0505
3M	-0,5380	0	1	3M	0,1895	1	0	0,0795
6M	-0,5150	0	1	6M	0,1940	0	-1	0,1016
12M	-0,4820	0	2	12M	0,2781	0	-2	0,1539
								CHF LIBOR
								-0,8014
								-0,7572
								-0,7112
								-0,5912

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5112	0	1	-0,4760	-0,2475	0,0770
2Y	-0,4920	-1	2	-0,4300	-0,1689	0,1568
3Y	-0,4555	-1	2	-0,3690	-0,0866	0,2255
4Y	-0,4032	-2	2	-0,2990	-0,0053	0,2940
5Y	-0,3410	-2	3	-0,2235	0,0681	0,3600
7Y	-0,1982	-2	5	-0,0739	0,2065	0,4640
10Y	0,0080	-3	6	0,1278	0,3715	0,5745
15Y	0,2674	-2	8	0,3540	0,5171	0,6416
20Y	0,3910	-2	8	0,4458	0,5473	0,6194
30Y	0,4140	-2	8	0,4417	0,4933	0,5262

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	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00

