

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

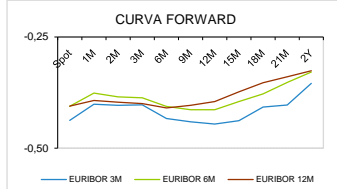
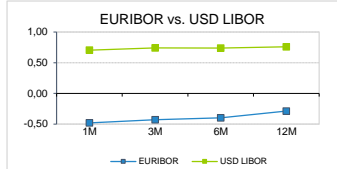
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

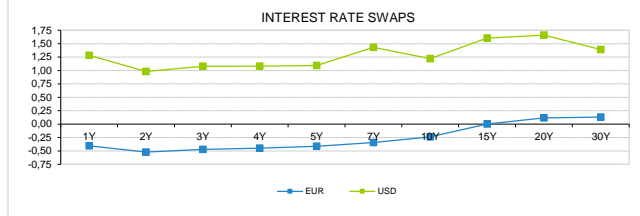
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4800	4	0	1M	0,7046	-9	-95	0,2670	-0,9174
3M	-0,4280	6	-2	3M	0,7405	-3	-96	0,4603	-0,8436
6M	-0,3970	5	-4	6M	0,7379	-1	-99	0,5295	-0,7842
12M	-0,2870	8	0	12M	0,7598	1	-105	0,6078	-0,6806

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4055	5	-3	-0,3959	-0,1963	-0,0352
2Y	-0,5210	-2	-16	-0,3636	-0,1305	-0,0122
3Y	-0,4710	0	-14	-0,3074	-0,1230	0,0090
4Y	-0,4480	0	-15	-0,2465	-0,0711	0,0359
5Y	-0,4120	-1	-14	-0,2041	-0,0468	0,0775
7Y	-0,3430	1	-18	-0,1367	0,0089	0,0513
10Y	-0,2380	-1	-21	-0,0464	0,0751	0,1505
15Y	0,0030	2	-24	0,0425	0,1010	0,1188
20Y	0,1160	2	-26	0,0290	0,0389	0,0185
30Y	0,1310	3	-28	-0,1216	-0,1254	-0,1442

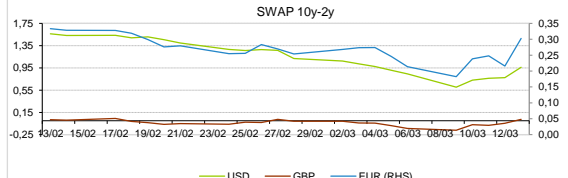
TAXA DE REFERENCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,25
Japão	0,10
Canadá	1,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,25
Austrália	0,50
Índia	4,00



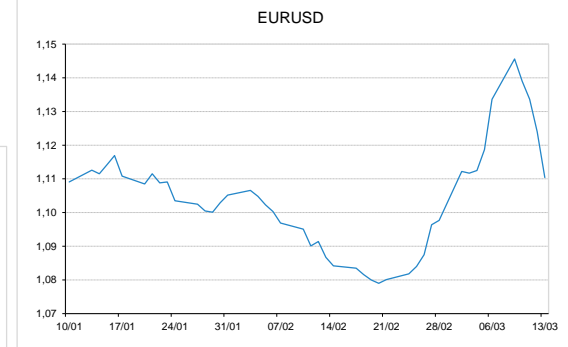
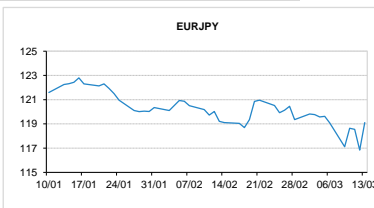
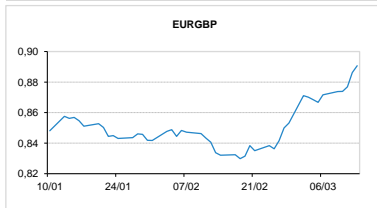
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,2810	-22	-36	0,4867	0,9096	1,0988
2Y	0,9820	-14	-54	0,6092	0,9805	1,1150
3Y	1,0790	-22	-57	0,7077	1,0190	1,1340
4Y	1,0800	-31	-35	0,7920	1,0465	1,1430
5Y	1,0930	-19	-34	0,8560	1,0700	1,1604
7Y	1,4310	-7	-31	0,9355	1,0964	1,1217
10Y	1,2200	-16	-62	1,0005	1,0835	1,0975
15Y	1,6050	-9	-35	1,0100	1,0699	1,0765
20Y	1,6590	-13	-35	1,0129	1,0509	1,0560
30Y	1,3910	-14	-65	0,9836	0,9974	0,9851



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	33,83	0,61	-22,55	OT 2Y	-0,065	0,04	35,90
JETFUEL	342,92	1,96	-197,26	OT 5Y	0,421	0,08	53,60
DIESEL	346,00	5,75	-174,25	OT 10Y	0,817	0,09	51,50
COBRE	5.435,00	-89,00	-324,00	BUND 10Y	-0,975	19,25	-16,30
ZINCO	1.925,00	-52,00	-219,50	SCHATZ 2Y	-0,267	5,46	-25,80
OURO	1.519,32	-75,76	-57,25	T-NOTE 10Y	1,951	5,72	-57,20
TRIGO	507,00	1,50	-37,75	T-NOTE 2Y	0,861	-1,30	-98,40
LICENÇA C02	21,91	-0,61	-2,49	GILT 10Y	0,361	13,27	-29,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1104	-1,21%	2,18%	1,1158	1,1190	1,1251
EUR/GBP	0,8907	-0,50%	-6,39%	0,8933	0,8955	0,9001
EUR/JPY	119,11	-1,91%	0,08%	119,11	119,11	119,11
EUR/CHF	1,0570	0,09%	0,39%	1,0561	1,0549	1,0530
EUR/BRL	5,2868	1,44%	-10,72%	5,3388	5,3827	5,4966
EUR/PLN	4,3734	0,10%	-2,90%	4,3970	4,4147	4,4479

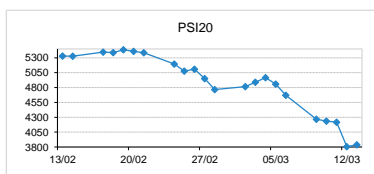

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1104	0,8907	119,11	1,0570	10,8466	7,4737	1,5449	1,79883	5,2868	11,1871
USD	0,9005	-	0,7991	106,97	0,9508	9,7583	6,7297	1,3922	1,5929	4,7240	10,0234

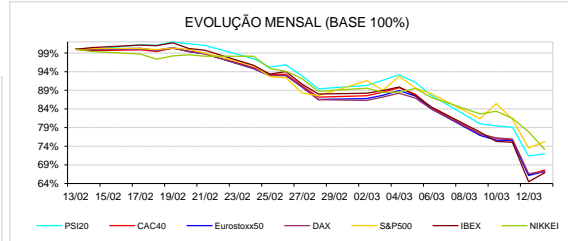
ACCIONISTA

TITULO	COTACAO	1D %	YTD %
ALTRI	3,292	-4,30	-42,04
BCP	0,112	-0,71	-44,63
CORT. AMORIM	8,540	2,15	-24,42
CTT	1,927	1,37	-39,59
EDP	3,551	2,19	-8,10
EDP R	10,380	3,18	-1,14
GALP	8,570	1,42	-42,48
IBERSOL	6,200	-1,27	-22,50
J MARTINS	14,030	1,19	-4,33
MOTA ENGIL	1,083	2,46	-42,09
NAVIGATOR	2,074	-1,52	-39,86
NOS	2,914	1,67	-39,29
PHAROL	0,072	-0,69	-28,21
RAMADA	3,470	-1,42	-40,58
REN	2,175	-0,68	-20,04
SEMAPA	9,050	-2,37	-34,04
SONAE CAP.	0,510	-1,92	-32,27
SONAE SGPS	0,581	-1,02	-36,15
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	3,18
MOTA ENGIL	2,46
EDP	2,19
CORT. AMORIM	2,15
NOS	1,67
RAMADA	-1,42
NAVIGATOR	-1,52
SONAE CAP.	-1,92
SEMAPA	-2,37
ALTRI	-4,30



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	3.837,38	0,83%	-26,40%	5.454,21	3.784,30
CAC40	4.118,36	1,83%	-31,11%	6.111,41	4.025,89
ESTX 50 PR	2.586,02	1,60%	-30,95%	3.867,28	2.535,89
XTRA DAX	9.232,08	0,77%	-30,32%	13.795,24	9.064,68
S&P 500	2.538,16	2,29%	-21,46%	3.393,52	2.478,86
IBEX 35	6.629,60	3,73%	-30,57%	10.100,20	6.347,00
NIKKEI 225	17.431,05	-6,08%	-26,32%	24.115,95	16.690,60



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.