

**AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS**

Sónia Oliveira - sonia.oliveira@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	-0,3720	0	0	1M	1,2306	0	0	0,2489	-0,7878
3M	-0,3290	0	0	3M	1,3161	0	1	0,2765	-0,7262
6M	-0,2740	0	0	6M	1,4533	0	0	0,4003	-0,6516
12M	-0,1610	0	-1	12M	1,7118	0	-1	0,5905	-0,5056

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,2617	0	-1	-0,1226	0,3765	0,9547	
2Y	-0,1880	0	-4	-0,0090	0,5239	1,1047	
3Y	-0,0870	0	-6	0,1190	0,6665	1,2393	
4Y	0,0320	-1	-9	0,2558	0,8126	1,3617	
5Y	0,1630	-1	-11	0,3938	0,9490	1,4620	
7Y	0,4290	-1	-13	0,6705	1,1899	1,6328	
10Y	0,7950	-1	-14	1,0189	1,4371	1,7822	
15Y	1,1960	-1	-13	1,3531	1,6354	1,8640	
20Y	1,3760	-1	-12	1,4987	1,7005	1,8550	
30Y	1,4750	0	-11	1,5645	1,6990	1,7944	

Taxa de Referência Banco Central	
Zona Euro	0,00
EUA	1,25
Reino Unido	0,25
Japão	0,10