

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

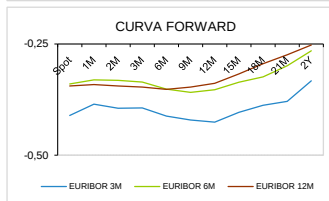
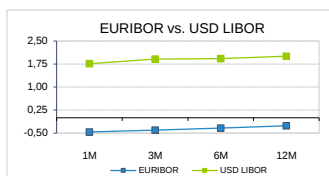
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

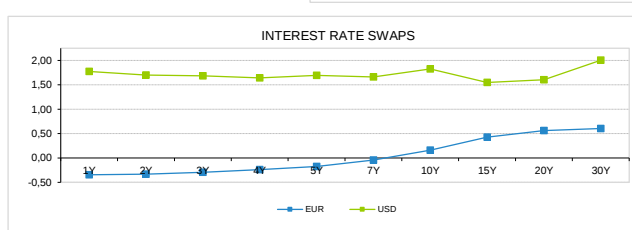
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4630	-1	1	1M	1,7616	0	-15	0,7151	-0,7416
3M	-0,4020	0	2	3M	1,9093	0	-9	0,7911	-0,7038
6M	-0,3360	-1	2	6M	1,9261	0	-5	0,8814	-0,6430
12M	-0,2610	-1	4	12M	2,0056	1	5	0,9708	-0,5232

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3445	0	5	-0,3410	-0,1331	0,1330
2Y	-0,3310	0	10	-0,2951	-0,0676	0,2060
3Y	-0,2930	0	13	-0,2409	-0,0007	0,2796
4Y	-0,2380	1	15	-0,1807	0,0685	0,3457
5Y	-0,1760	1	18	-0,1186	0,1400	0,4100
7Y	-0,0420	2	21	0,0156	0,2709	0,5160
10Y	0,1610	3	24	0,2053	0,4319	0,6373
15Y	0,4270	3	27	0,4301	0,5886	0,7195
20Y	0,5620	4	28	0,5324	0,6331	0,7097
30Y	0,6040	4	29	0,5429	0,5935	0,6265

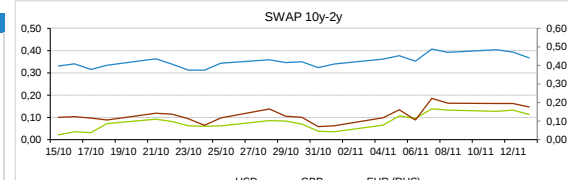
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7750	3	11	1,5720	1,6430	1,7615
2Y	1,7000	5	24	1,5730	1,6520	1,7820
3Y	1,6830	6	30	1,5860	1,6770	1,8360
4Y	1,6430	6	11	1,6125	1,7220	1,8921
5Y	1,6950	7	36	1,6586	1,7805	1,9279
7Y	1,6610	-3	31	1,6930	1,8155	1,9570
10Y	1,8240	8	39	1,8020	1,8880	1,9845
15Y	1,5480	-8	9	1,8940	1,9540	2,0180
20Y	1,6040	-7	9	1,9265	1,9760	2,0170
30Y	2,0040	8	38	1,9370	1,9685	1,9890

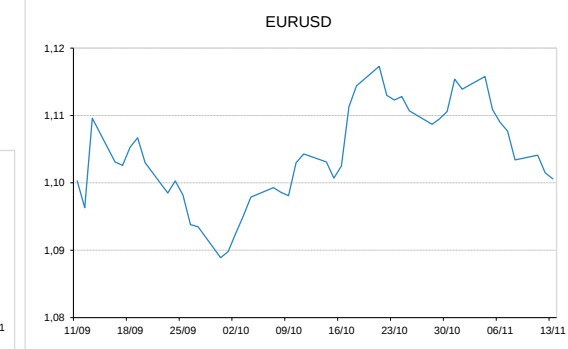
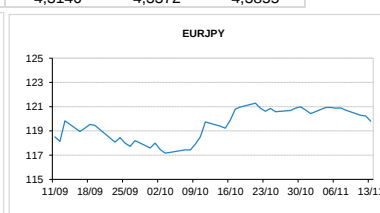


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,45	0,39	2,33	OT 2Y	-0,467	0,02	11,90
JETFUEL	616,28	1,07	-16,61	OT 5Y	-0,101	0,00	13,60
DIESEL	579,58	1,33	-20,42	OT 10Y	0,366	0,00	18,90
COBRE	5.854,00	-9,50	73,00	BUND 10Y	-0,749	-5,72	15,40
ZINCO	2.514,50	-23,50	65,00	SCHATZ 2Y	-0,005	-1,38	7,70
OURO	1.462,41	8,33	-22,66	T-NOTE 10Y	2,699	-2,31	14,30
TRIGO	508,75	-8,25	0,75	T-NOTE 2Y	2,118	-1,15	8,40
LICENÇA C02	24,31	0,19	-0,13	GILT 10Y	0,743	-4,90	10,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1006	-0,08%	-0,23%	1,1078	1,1138	1,1262
EUR/GBP	0,8576	0,07%	2,59%	0,8605	0,8632	0,8689
EUR/JPY	119,79	0,38%	-0,33%	119,79	119,79	119,79
EUR/CHF	1,0885	0,47%	1,02%	1,0875	1,0867	1,0850
EUR/BRL	4,5972	-0,27%	-1,02%	4,6441	4,6832	4,7903
EUR/PLN	4,2888	-0,20%	0,12%	4,3146	4,3372	4,3855



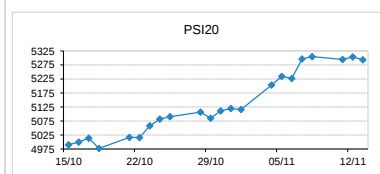
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1006	0,8576	119,79	1,0885	10,7087	7,4726	1,4568	1,61096	4,5972	10,1123
USD	0,9082	-	0,7788	108,705	0,9894	9,7345	6,7868	1,3245	1,4638	4,1758	9,1897

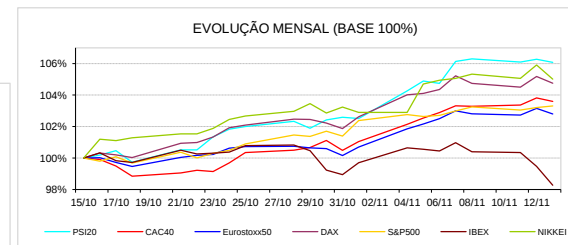
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,960	-0,75	2,76
BCP	0,210	-1,87	-8,50
CORT. AMORIM	10,080	1,20	12,00
CTT	3,154	1,09	7,06
EDP	3,716	0,81	21,88
EDP R	10,240	0,59	31,70
GALP	15,060	0,07	9,17
IBERSOL	7,540	0,53	-4,56
J MARTINS	15,150	-1,75	46,52
MOTA ENGL	2,070	-0,67	28,57
NAVIGATOR	3,576	0,96	-0,67
NOS	5,280	-0,75	-0,28
NOVABASE	2,780	0,72	37,62
PHAROL	0,108	1,70	-34,07
RAMADA	6,200	0,00	-17,33
REN	14,040	0,43	7,18
SEMAPA	0,815	0,25	-4,00
SONAE CAP.	0,938	-0,27	15,74
SONAE SGPS	6,200	0,00	-17,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	1,70
CORT. AMORIM	1,20
CTT	1,09
NAVIGATOR	0,96
EDP	0,81
MOTA ENGL	-0,67
ALTRI	-0,75
NOS	-0,75
J MARTINS	-1,75
BCP	-1,87



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.293,74	-0,19%	11,88%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.907,09	-0,21%	24,87%	5.931,19	4.555,99
ESTX 50 PR	3.699,50	-0,34%	23,26%	3.719,40	2.908,70
XTRA DAX	13.230,07	-0,40%	25,30%	13.308,26	10.279,20
S&P 500	3.094,98	0,10%	23,45%	3.102,61	2.346,58
IBEX 35	9.194,50	-1,21%	7,67%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.319,87	-0,85%	16,51%	23.591,09	18.948,58



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.

2017 © Caixa - Banco de Investimento, SA. Todos os direitos reservados.

O Caixa - Banco de Investimento, S.A. é membro da Euronext e é um intermediário financeiro registado na CMVM com o número 102.