

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

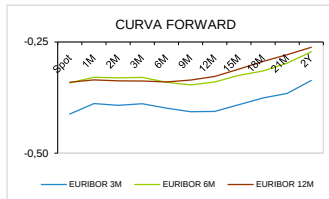
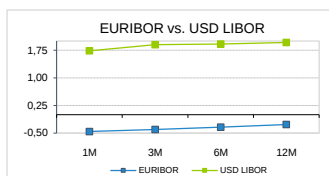
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

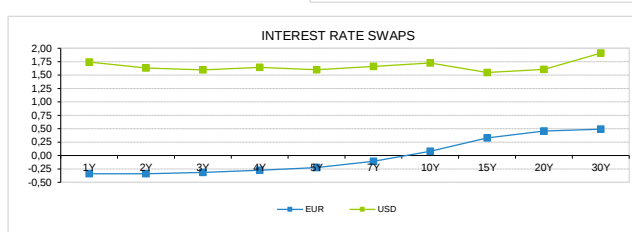
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4550	-1	-2	1M	1,7333	-3	-16	0,7118	-0,7444
3M	-0,4030	0	0	3M	1,9026	0	-10	0,7871	-0,7046
6M	-0,3380	-1	1	6M	1,9185	0	-6	0,8565	-0,6452
12M	-0,2670	0	3	12M	1,9610	-1	-1	0,9513	-0,5200

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,3400	0	3	-0,3285	-0,1452	0,1095	
2Y	-0,3400	1	7	-0,2960	-0,0850	0,1780	
3Y	-0,3150	1	8	-0,2451	-0,0201	0,2512	
4Y	-0,2740	0	10	-0,1900	0,0469	0,3179	
5Y	-0,2240	0	11	-0,1301	0,1166	0,3795	
7Y	-0,1070	0	12	-0,0010	0,2462	0,4884	
10Y	0,0800	1	13	0,1853	0,4048	0,6110	
15Y	0,3290	0	13	0,4031	0,5553	0,6925	
20Y	0,4560	0	13	0,5068	0,6053	0,6866	
30Y	0,4910	0	13	0,5194	0,5673	0,6001	

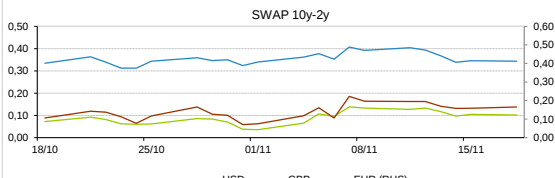
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7430	1	-5	1,4723	1,5170	1,6780
2Y	1,6330	1	-3	1,4725	1,5864	1,7276
3Y	1,5980	1	-1	1,5032	1,5935	1,7330
4Y	1,6430	6	11	1,5355	1,6270	1,8050
5Y	1,5990	0	2	1,5657	1,6620	1,8387
7Y	1,6610	-3	31	1,6060	1,7636	1,8615
10Y	1,7260	0	5	1,7278	1,8120	1,9090
15Y	1,5480	-8	9	1,8265	1,9094	1,9807
20Y	1,6040	-7	9	1,8770	1,9352	1,9812
30Y	1,9090	0	6	1,8953	1,9015	1,9505

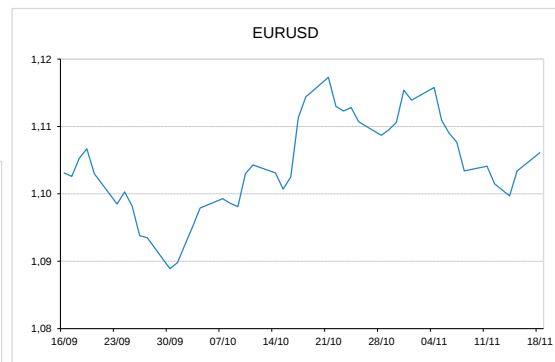
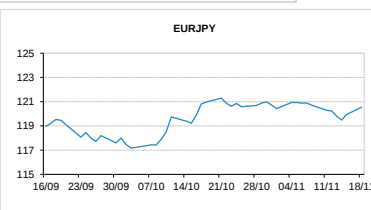
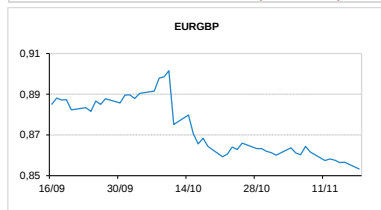


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	62,26	-1,04	3,17	OT 2Y	-0,484	-0,03	8,10
JETFUEL	611,45	-15,56	-17,56	OT 5Y	-0,123	-0,01	11,20
DIESEL	577,80	-14,70	-16,45	OT 10Y	0,347	-0,03	16,90
COBRE	5,841,00	37,00	76,00	BUND 10Y	-0,783	0,07	6,10
ZINCO	2,409,50	-22,50	-53,75	SCHATZ 2Y	-0,002	0,46	4,20
OURO	1,472,28	4,55	-19,73	T-NOTE 10Y	2,640	-2,15	5,30
TRIGO	511,75	5,75	-25,25	T-NOTE 2Y	2,072	-1,91	3,40
LICENÇA C02	23,53	-0,46	-2,54	GILT 10Y	0,729	2,48	3,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1061	0,24%	-0,74%	1,1130	1,1191	1,1311
EUR/GBP	0,8533	0,39%	1,30%	0,8561	0,8588	0,8645
EUR/JPY	120,55	-0,50%	0,35%	120,55	120,55	120,55
EUR/CHF	1,0944	-0,04%	0,45%	1,0934	1,0925	1,0908
EUR/BRL	4,6451	-0,63%	-1,13%	4,6912	4,7302	4,8426
EUR/PLN	4,2937	-0,43%	-0,27%	4,3186	4,3417	4,3905



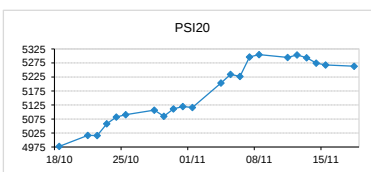
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1061	0,8533	120,55	1,0944	10,6540	7,4724	1,4637	1,6247	4,6451	10,0900
USD	0,9026	-	0,7715	108,575	0,9879	9,6206	6,7446	1,3217	1,4680	4,1911	9,1082

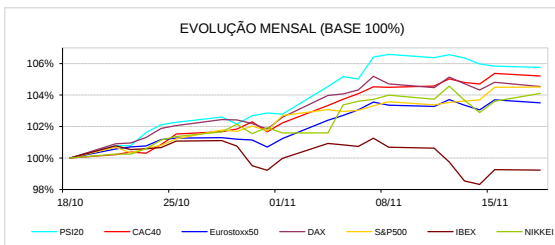
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,910	-2,64	1,90
BCP	0,205	-1,91	-10,59
CORT. AMORIM	10,100	0,20	12,22
CTT	3,148	0,58	6,86
EDP	3,767	1,51	23,55
EDP R	10,200	0,00	31,19
GALP	15,210	0,16	10,26
IBERSOL	7,400	-0,80	-6,33
J MARTINS	15,050	1,35	45,55
MOTA ENGIL	2,090	0,58	29,81
NAVIGATOR	3,566	-1,60	-0,94
NOS	5,125	-0,29	-3,21
NOVABASE	2,870	0,70	42,08
PHAROL	0,113	-2,25	-30,88
RAMADA	6,180	-1,59	-17,60
REN	14,060	-0,14	7,33
SEMAPA	0,801	-0,25	-5,65
SONAE CAP.	0,928	0,05	14,51
SONAE SGPS	6,180	-1,59	-17,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	1,51
J MARTINS	1,35
NOVABASE	0,70
MOTA ENGIL	0,58
CTT	0,58
RAMADA	-1,59
NAVIGATOR	-1,60
BCP	-1,91
PHAROL	-2,25
ALTRI	-2,64



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5,263,61	-0,08%	11,25%	5,429,32	4,551,84
CAC40	5,929,79	-0,16%	25,35%	5,947,62	4,555,99
ESTX 50 PR	3,704,92	-0,18%	23,44%	3,719,40	2,908,70
XTRA DAX	13,207,01	-0,26%	25,08%	13,308,26	10,279,20
S&P 500	3,120,73	0,02%	24,50%	3,121,48	2,346,58
IBEX 35	9,258,00	-0,04%	8,41%	9,587,60	8,286,20
NIKKEI 225	23,416,76	0,49%	17,00%	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.