

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

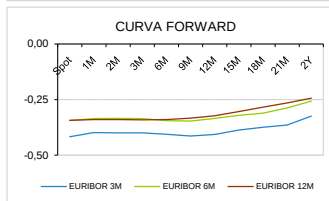
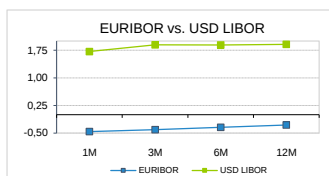
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENDA FIXA

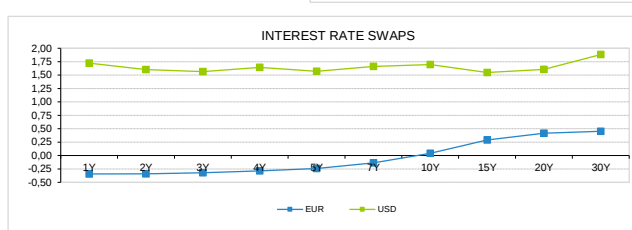
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4590	-1	-2	1M	1,7156	-1	-13	0,7139	-0,7566
3M	-0,4080	0	0	3M	1,8988	0	-5	0,8024	-0,7142
6M	-0,3400	0	1	6M	1,8911	-2	-6	0,8583	-0,6424
12M	-0,2800	-1	1	12M	1,9093	-3	-8	0,9586	-0,5238

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3435	0	2	-0,3249	-0,1364	0,1096
2Y	-0,3430	-1	3	-0,2832	-0,0740	0,1760
3Y	-0,3210	-2	3	-0,2339	-0,0122	0,2492
4Y	-0,2860	-2	3	-0,1780	0,0510	0,3168
5Y	-0,2430	-3	3	-0,1210	0,1180	0,3786
7Y	-0,1370	-4	3	0,0040	0,2488	0,4875
10Y	0,0410	-4	2	0,1887	0,4061	0,6102
15Y	0,2900	-5	2	0,4062	0,5571	0,6938
20Y	0,4150	-5	2	0,5114	0,6095	0,6830
30Y	0,4520	-5	1	0,5195	0,5650	0,5940

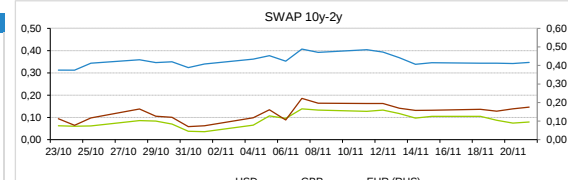
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



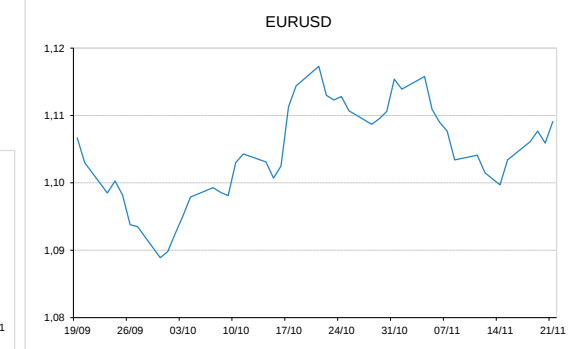
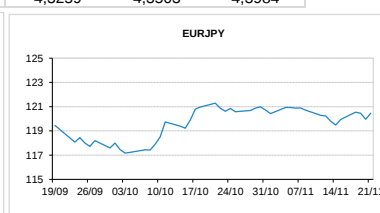
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7210	-2	-2	1,4359	1,4860	1,6355
2Y	1,6010	-3	-2	1,4422	1,5388	1,6682
3Y	1,5650	-3	0	1,4490	1,5505	1,7080
4Y	1,6430	6	11	1,4770	1,5900	1,7459
5Y	1,5710	-3	2	1,5070	1,6386	1,7844
7Y	1,6610	-3	31	1,5600	1,6945	1,8060
10Y	1,6960	-3	3	1,6782	1,7700	1,8450
15Y	1,5480	-8	9	1,7620	1,8562	1,9272
20Y	1,6040	-7	9	1,8269	1,8830	1,8955
30Y	1,8830	-3	2	1,8060	1,8450	1,8610



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,38	0,98	4,70	OT 2Y	-0,474	0,00	7,20
JETFUEL	619,19	6,21	-4,80	OT 5Y	-0,053	0,03	14,90
DIESEL	583,25	4,50	-4,75	OT 10Y	0,422	0,04	20,90
COBRE	5.854,00	0,00	69,00	BUND 10Y	-0,769	3,05	5,40
ZINCO	2.335,50	-28,00	-139,00	SCHATZ 2Y	0,007	2,06	4,10
OURO	1.468,69	-2,76	-15,87	T-NOTE 10Y	2,622	2,44	2,60
TRIGO	515,75	-3,00	-13,75	T-NOTE 2Y	2,070	1,72	4,00
LICENÇA C02	24,03	0,00	-1,90	GILT 10Y	0,736	3,02	5,00


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1091	0,29%	-0,73%	1,1160	1,1222	1,1340
EUR/GBP	0,85548	0,20%	0,45%	0,8583	0,8610	0,8666
EUR/JPY	120,46	-0,42%	0,69%	120,46	120,46	120,46
EUR/CHF	1,0981	-0,11%	0,13%	1,0971	1,0962	1,0945
EUR/BRL	4,6636	-0,36%	-1,27%	4,7100	4,7522	4,8698
EUR/PLN	4,3000	-0,10%	-0,54%	4,3259	4,3503	4,3984

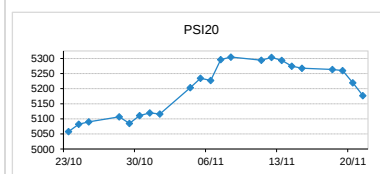

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1091	0,8555	120,46	1,0981	10,6647	7,4729	1,4700	1,62973	4,6636	10,1094
USD	0,9029	-	0,7737	108,52	0,9913	9,6372	6,7474	1,3279	1,4718	4,2137	9,1324

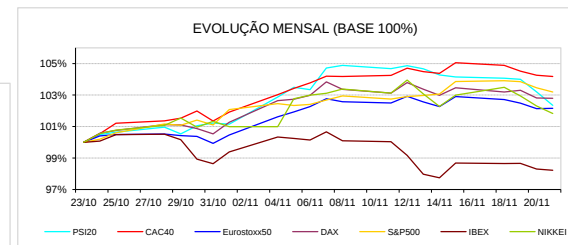
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,795	-0,34	-0,09
BCP	0,203	-0,88	-11,59
CORT. AMORIM	10,620	0,19	18,00
CTT	3,010	-4,20	2,17
EDP	3,647	-1,83	19,61
EDP R	10,020	-1,76	28,87
GALP	15,085	-0,23	9,35
IBERSOL	7,440	1,36	-5,82
J MARTINS	14,580	-0,72	41,01
MOTA ENIGL	2,040	-1,54	26,71
NAVIGATOR	3,510	-0,85	-2,50
NOS	5,055	-0,30	-4,53
NOVABASE	2,880	0,35	42,57
PHAROL	0,113	3,10	-30,64
RAMADA	6,060	-0,98	-19,20
REN	13,900	-1,00	6,11
SEMAPA	0,807	-0,49	-4,95
SONAE CAP.	0,912	0,00	12,59
SONAE SGPS	6,060	-0,98	-19,20

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,10
IBERSOL	1,36
NOVABASE	0,35
CORT. AMORIM	0,19
REN	-1,00
MOTA ENIGL	-1,54
EDP R	-1,76
EDP	-1,83
CTT	-4,20



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.176,69	-0,82%	9,41%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.889,71	-0,07%	24,50%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.684,87	0,03%	22,77%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.155,70	-0,02%	24,59%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.100,53	-0,25%	23,68%	3.127,64	2.346,58
IBEX 35	9.218,10	-0,08%	7,94%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.038,58	-0,48%	15,11%	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.