

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

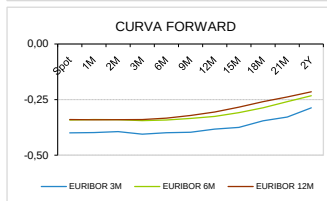
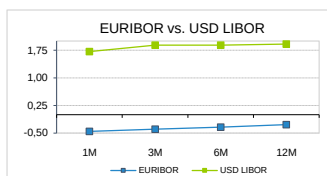
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

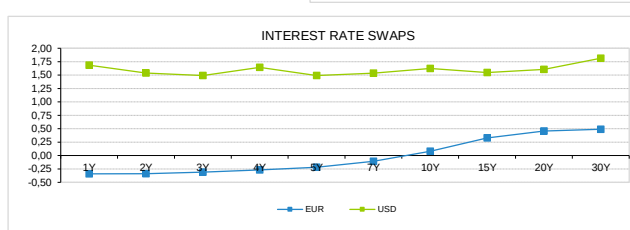
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4530	0	-2	1M	1,7131	1	-6	0,7096	-0,8154
3M	-0,3950	0	1	3M	1,8871	0	-2	0,7831	-0,7242
6M	-0,3360	0	1	6M	1,8875	-1	-4	0,8589	-0,6606
12M	-0,2690	0	1	12M	1,9170	-2	-4	0,9616	-0,5200

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3415	0	1	-0,3060	-0,1024	0,1424
2Y	-0,3380	-1	3	-0,2604	-0,0413	0,2110
3Y	-0,3100	-2	3	-0,2083	0,0176	0,2780
4Y	-0,2690	-2	3	-0,1520	0,0830	0,3460
5Y	-0,2190	-3	4	-0,0942	0,1480	0,4105
7Y	-0,1070	-3	3	0,0318	0,2790	0,5140
10Y	0,0800	-3	3	0,2166	0,4347	0,6320
15Y	0,3290	-3	2	0,4341	0,5867	0,7120
20Y	0,4570	-3	1	0,5336	0,6299	0,7020
30Y	0,4900	-3	1	0,5372	0,5838	0,6140

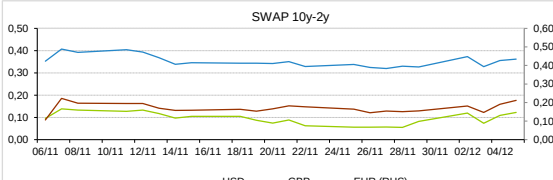
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	5,00
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6830	-6	-6	1,5024	1,5620	1,7010
2Y	1,5380	-9	-11	1,5060	1,5990	1,7000
3Y	1,4910	-9	-12	1,5135	1,6165	1,7540
4Y	1,6430	6	11	1,5440	1,6195	1,8090
5Y	1,4920	-8	-11	1,5740	1,6745	1,8695
7Y	1,5340	-3	-15	1,6556	1,7315	1,8835
10Y	1,6230	-6	-10	1,7380	1,8210	1,9305
15Y	1,5480	-8	9	1,8090	1,9340	2,0039
20Y	1,6040	-7	9	1,8645	1,9320	1,9695
30Y	1,8140	-4	-10	1,9207	1,9070	1,9470

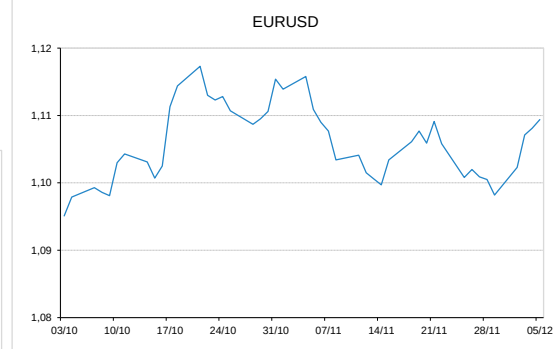
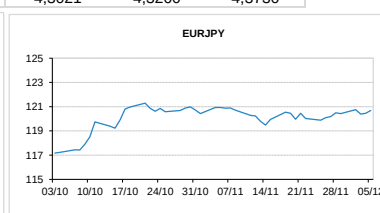


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,63	0,63	1,50	OT 2Y	-0,543	0,03	0,50
JETFUEL	606,75	-1,22	-21,42	OT 5Y	-0,083	0,04	9,60
DIESEL	586,29	12,25	-5,36	OT 10Y	0,424	0,05	17,50
COBRE	5.875,00	70,00	8,00	BUND 10Y	-0,873	3,22	2,00
ZINCO	2.262,00	46,00	-320,00	SCHATZ 2Y	0,014	1,38	3,90
OURO	1.479,28	5,19	-4,16	T-NOTE 10Y	2,649	1,53	-3,40
TRIGO	524,00	-3,50	3,75	T-NOTE 2Y	2,005	0,38	-2,30
LICENÇA C02	24,50	-0,24	-1,01	GILT 10Y	0,700	4,51	3,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1094	0,12%	-0,14%	1,1161	1,1223	1,1343
EUR/GBP	0,8447	0,17%	1,95%	0,8474	0,8501	0,8557
EUR/JPY	120,69	-0,20%	0,20%	120,69	120,69	120,69
EUR/CHF	1,0960	-0,01%	0,30%	1,0951	1,0942	1,0924
EUR/BRL	4,6647	-0,09%	-5,24%	4,6962	4,7376	4,8532
EUR/PLN	4,2773	0,06%	-0,28%	4,3021	4,3260	4,3730



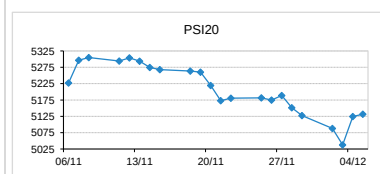
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1094	0,8447	120,69	1,0960	10,5359	7,4716	1,4631	1,62471	4,6647	10,1458
USD	0,9015	-	0,7602	108,745	0,9884	9,4979	6,7360	1,3184	1,4653	4,2128	9,1459

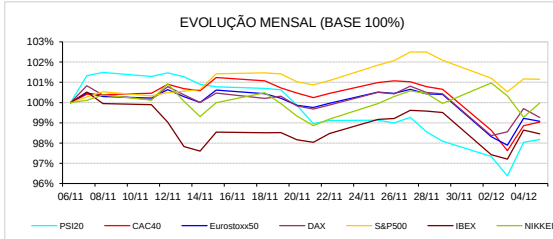
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,640	-0,18	-2,76
BCP	0,195	0,15	-15,29
CORT. AMORIM	11,020	-0,18	22,44
CTT	3,320	3,23	12,70
EDP	3,631	0,41	19,09
EDP R	10,100	0,40	29,90
GALP	14,505	0,28	5,15
IBERSOL	7,580	-0,52	-4,05
J MARTINS	14,545	0,07	40,67
MOTA ENGIL	1,813	0,17	12,61
NAVIGATOR	3,536	-0,17	-1,78
NOS	5,010	-0,50	-5,38
NOVABASE	2,780	0,00	44,63
PHAROL	0,104	1,17	-36,27
RAMADA	5,900	-0,67	-21,33
REN	13,620	-0,15	3,97
SEMAPA	0,775	0,26	-8,72
SONAE CAP.	0,933	-0,85	15,12
SONAE SGPS	5,900	-0,67	-21,33

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	3,23
PHAROL	1,17
EDP	0,41
EDP R	0,40
GALP	0,28
NOS	-0,50
IBERSOL	-0,52
RAMADA	-0,67
RAMADA	-0,67
SONAE CAP.	-0,85



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.131,52	0,14%	8,46%	5.429,32	4.551,84
CAC40	5.810,06	0,18%	22,82%	5.966,79	4.555,99
ESTX 50 PR	3.654,65	-0,15%	21,76%	3.733,45	2.908,70
XTRA DAX	13.082,03	-0,44%	23,90%	13.374,27	10.279,20
S&P 500	3.112,11	-0,02%	24,14%	3.154,26	2.346,58
IBEX 35	9.253,70	-0,19%	8,35%	9.587,60	8.286,20
NIKKEI 225	23.300,09	0,71%	16,41%	23.608,06	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.