

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

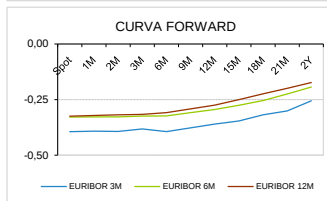
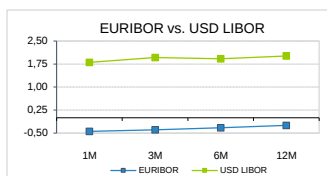
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

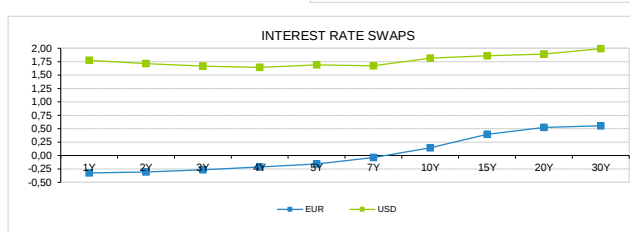
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4440	1	0	1M	1,8048	1	10	0,7069	-0,7940
3M	-0,3900	1	1	3M	1,9605	1	4	0,7976	-0,6956
6M	-0,3250	1	2	6M	1,9213	0	1	0,8823	-0,6106
12M	-0,2470	0	3	12M	2,0120	1	10	0,9793	-0,4932

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3248	0	2	-0,2775	-0,0603	0,1979
2Y	-0,3080	0	3	-0,2238	0,0040	0,2613
3Y	-0,2660	0	4	-0,1704	0,0689	0,3359
4Y	-0,2130	-1	5	-0,1103	0,1332	0,3984
5Y	-0,1570	-1	6	-0,0487	0,2007	0,4688
7Y	-0,0390	-2	8	0,0787	0,3330	0,5731
10Y	0,1450	-2	8	0,2679	0,4940	0,6954
15Y	0,3950	-3	8	0,4906	0,6479	0,7812
20Y	0,5250	-3	8	0,5965	0,6967	0,7716
30Y	0,5540	-3	8	0,6040	0,6546	0,6885

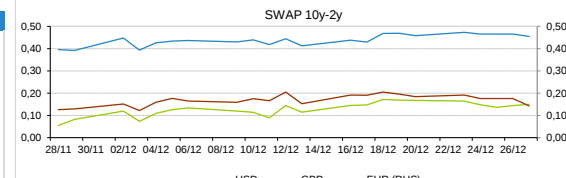
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7750	3	3	1,5904	1,6710	1,8570
2Y	1,7140	1	12	1,5840	1,7120	1,8640
3Y	1,6660	5	7	1,6140	1,7500	1,9214
4Y	1,6430	6	11	1,6616	1,7910	1,9380
5Y	1,6900	5	9	1,6830	1,8270	1,9877
7Y	1,6720	3	1	1,7510	1,8920	2,0105
10Y	1,8150	4	9	1,8662	1,9640	2,0550
15Y	1,8610	2	31	1,9430	2,0290	2,0940
20Y	1,8930	29	29	1,9930	2,0470	2,0905
30Y	1,9910	4	8	2,0030	2,0350	2,0570

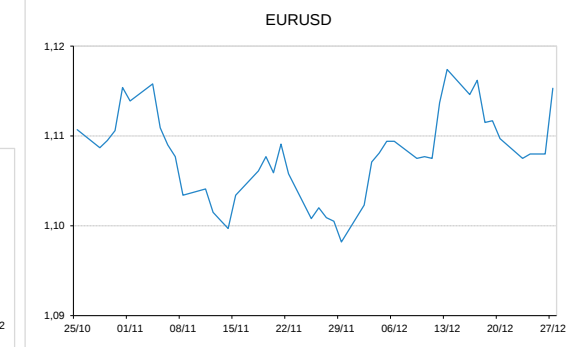
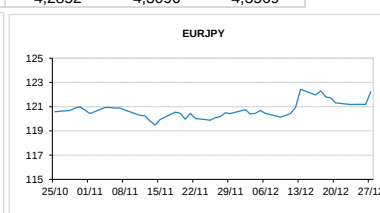


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	68,10	0,18	5,09	OT 2Y	-0,546	-0,03	-1,90
JETFUEL	656,00	6,75	35,50	OT 5Y	-0,147	-0,03	-3,00
DIESEL	623,07	4,77	36,57	OT 10Y	0,387	-0,03	0,60
COBRE	6.203,50	25,00	360,00	BUND 10Y	-0,837	-1,38	11,80
ZINCO	2.282,50	-15,25	-36,25	SCHATZ 2Y	0,021	0,69	1,90
OURO	1.513,99	5,30	57,86	T-NOTE 10Y	2,709	-2,78	8,10
TRIGO	559,75	10,75	33,00	T-NOTE 2Y	2,047	-3,63	1,70
LICENÇA C02	26,70	0,62	1,44	GILT 10Y	0,673	-1,15	7,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1153	0,66%	1,31%	1,1219	1,1283	1,1407
EUR/GBP	0,8513	0,47%	0,38%	0,8540	0,8569	0,8625
EUR/JPY	122,23	-0,85%	-1,68%	122,23	122,23	122,23
EUR/CHF	1,0881	0,08%	1,06%	1,0872	1,0863	1,0848
EUR/BRL	4,5299	-0,62%	3,46%	4,5909	4,6375	4,7584
EUR/PLN	4,2602	-0,08%	1,17%	4,2852	4,3090	4,3569



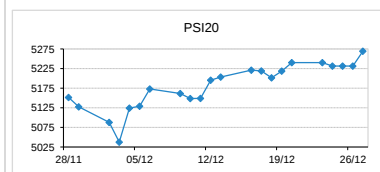
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1153	0,8513	122,23	1,0881	10,4420	7,4702	1,4612	1,60251	4,5299	9,8698
USD	0,8957	-	0,7637	109,57	0,9759	9,3444	6,6890	1,3086	1,4319	4,0561	8,8208

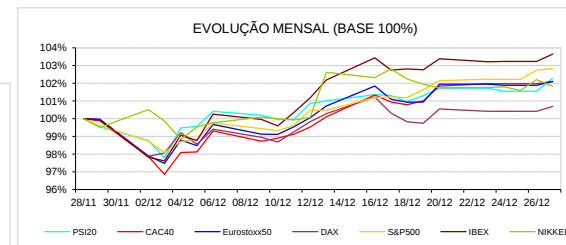
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,690	0,18	-1,90
BCP	0,201	-0,89	-12,29
CORT. AMORIM	11,420	0,00	27,86
CTT	3,196	1,52	8,49
EDP	3,902	2,09	27,98
EDP R	10,500	2,54	35,05
GALP	15,205	-0,10	10,22
IBERSOL	8,000	0,00	1,27
J MARTINS	15,045	1,31	45,50
MOTA ENGIL	1,900	-0,89	18,01
NAVIGATOR	3,606	0,78	0,17
NOS	4,898	0,57	-7,50
NOVABASE	2,560	0,00	33,18
PHAROL	0,100	-0,20	-38,73
RAMADA	5,880	1,03	-21,60
REN	13,820	1,47	5,50
SEMAPA	0,760	-1,04	-10,48
SONAE CAP.	0,918	-0,05	13,33
SONAE SGPS	5,880	1,03	-21,60

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP R	2,54
EDP	2,09
CTT	1,52
REN	1,47
J MARTINS	1,31
GALP	-0,10
PHAROL	-0,20
BCP	-0,89
MOTA ENGIL	-0,89
SEMAPA	-1,04



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.269,31	0,73%	11,37%	5.429,32	4.551,84
CAC40	6.037,39	0,13%	27,62%	6.065,00	4.555,99
ESTX 50 PR	3.782,27	0,21%	26,02%	3.794,93	2.908,70
XTRA DAX	13.337,11	0,27%	26,31%	13.425,85	10.279,20
S&P 500	3.243,02	0,10%	29,37%	3.247,93	2.397,94
IBEX 35	9.700,50	0,40%	13,59%	9.700,50	8.286,20
NIKKEI 225	23.837,72	-0,36%	19,10%	24.091,12	19.241,37



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.