

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

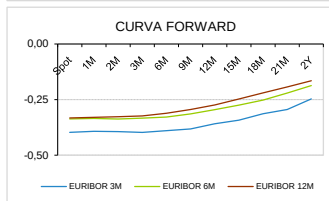
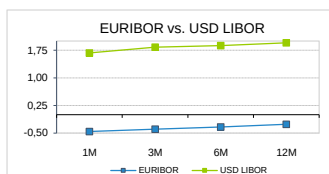
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

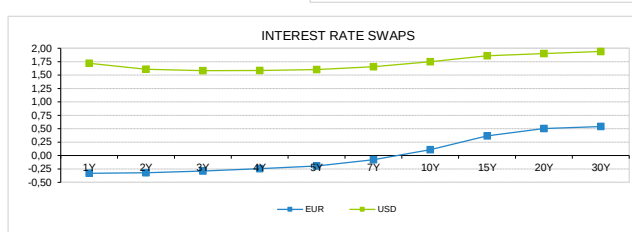
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4560	-1	-1	1M	1,6771	-2	-4	0,7019	-0,7648
3M	-0,3930	0	0	3M	1,8340	-4	-6	0,7973	-0,6742
6M	-0,3330	0	0	6M	1,8744	-1	-1	0,8720	-0,6168
12M	-0,2600	-1	2	12M	1,9511	0	3	0,9749	-0,4758

INTEREST RATE SWAPS							
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y	
1Y	-0,3313	0	1	-0,2756	-0,0350	0,2129	
2Y	-0,3220	-1	0	-0,2223	0,0310	0,2780	
3Y	-0,2900	-1	0	-0,1600	0,0926	0,3482	
4Y	-0,2460	-1	0	-0,0955	0,1548	0,4169	
5Y	-0,1950	-1	0	-0,0332	0,2214	0,4849	
7Y	-0,0790	-1	0	0,0945	0,3507	0,5894	
10Y	0,1100	-1	1	0,2826	0,5112	0,7125	
15Y	0,3670	-1	2	0,5083	0,6680	0,8024	
20Y	0,5020	0	3	0,6165	0,7196	0,7953	
30Y	0,5400	0	3	0,6242	0,6765	0,7091	

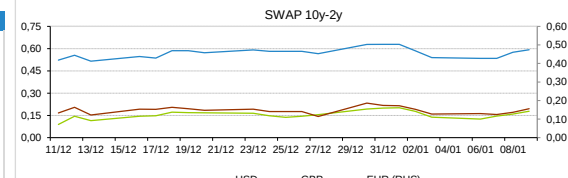
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7200	-6	0	1,5903	1,6828	1,8648
2Y	1,6090	0	-2	1,5810	1,7100	1,8800
3Y	1,5820	0	-3	1,6130	1,7520	1,9180
4Y	1,5840	-6	-6	1,6440	1,7940	1,9530
5Y	1,6010	0	-3	1,7006	1,8330	2,0104
7Y	1,6550	0	-2	1,7580	1,9060	2,0390
10Y	1,7480	1	-1	1,8792	1,9830	2,0830
15Y	1,8590	1	0	1,9630	2,0676	2,1418
20Y	1,9020	1	1	2,0297	2,0730	2,1160
30Y	1,9400	2	0	2,0250	2,0610	2,0914

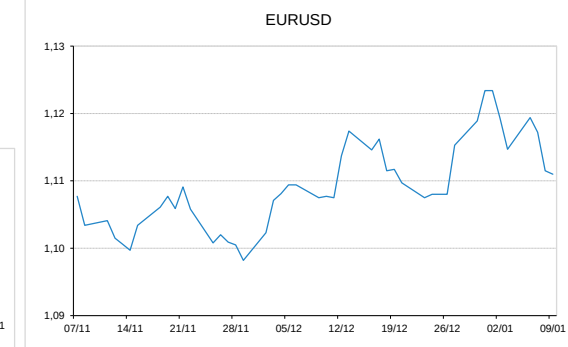
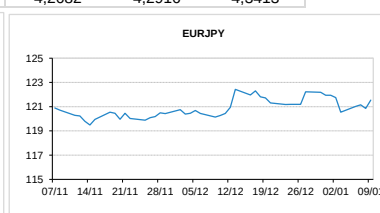


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,32	-0,12	2,04	OT 2Y	-0,480	0,01	7,10
JETFUEL	637,81	-20,16	31,06	OT 5Y	-0,096	0,01	1,70
DIESEL	602,22	-20,34	10,03	OT 10Y	0,406	0,01	1,20
COBRE	6.189,00	29,00	188,00	BUND 10Y	-0,803	4,42	7,60
ZINCO	2.418,50	56,50	176,00	SCHATZ 2Y	0,039	2,30	3,40
OURO	1.548,95	-13,03	88,95	T-NOTE 10Y	2,712	1,39	3,00
TRIGO	562,00	9,25	39,25	T-NOTE 2Y	2,057	1,53	-1,50
LICENÇA C02	24,78	0,70	-0,52	GILT 10Y	0,746	2,31	2,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,111	-0,05%	0,32%	1,1175	1,1237	1,1363
EUR/GBP	0,85285	-0,49%	-1,28%	0,8555	0,8582	0,8635
EUR/JPY	121,54	-0,56%	-1,14%	121,54	121,54	121,54
EUR/CHF	1,0803	0,17%	1,19%	1,0796	1,0788	1,0771
EUR/BRL	4,5219	-0,15%	1,31%	4,5643	4,6069	4,7184
EUR/PLN	4,2450	-0,31%	0,97%	4,2682	4,2916	4,3413



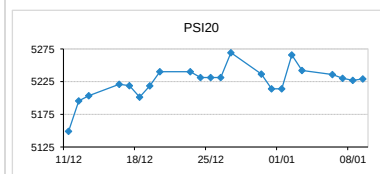
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1110	0,8529	121,54	1,0803	10,5391	7,4731	1,4539	1,61971	4,5219	9,8606
USD	0,9007	-	0,7665	109,545	0,9730	9,4906	6,7313	1,3095	1,4591	4,0758	8,8831

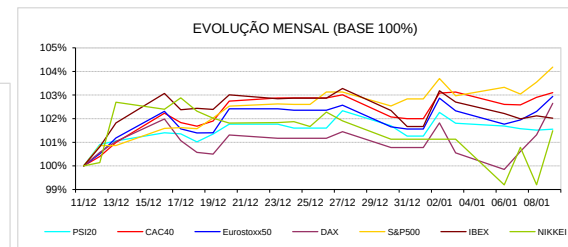
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,835	1,39	2,73
BCP	0,205	0,99	0,84
CORT. AMORIM	11,660	0,52	3,19
CTT	3,378	4,45	5,89
EDP	3,813	-0,26	-1,32
EDP R	10,160	-0,39	-3,24
GALP	15,400	-1,28	3,36
IBERSOL	8,200	0,00	2,50
J MARTINS	15,010	0,57	2,35
MOTA ENGIL	1,845	0,05	-1,34
NAVIGATOR	3,380	-1,63	-1,99
NOS	4,848	0,33	1,00
NOVABASE	2,570	-1,15	-0,39
PHAROL	0,103	0,39	3,61
RAMADA	5,860	0,34	0,34
REN	13,340	-2,34	-2,77
SEMAPA	0,775	0,78	2,92
SONAE CAP.	0,897	0,06	-1,43
SONAE SGPS	5,860	0,34	0,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CTT	4,45
ALTRI	1,39
BCP	0,99
SEMAPA	0,78
J MARTINS	0,57
EDP R	-0,39
NOVABASE	-1,15
GALP	-1,28
NAVIGATOR	-1,63
REN	-2,34



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.229,19	0,04%	0,29%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.042,55	0,19%	1,08%	6.071,66	4.730,55
ESTX 50 PR	3.795,96	0,62%	1,36%	3.807,09	3.037,13
XTRA DAX	13.495,06	1,31%	1,86%	13.523,34	10.786,75
S&P 500	3.273,11	0,61%	1,31%	3.273,90	2.562,02
IBEX 35	9.582,00	-0,10%	0,34%	9.705,40	8.409,20
NIKKEI 225	23.739,87	2,31%	0,35%	24.091,12	20.101,93



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.