

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

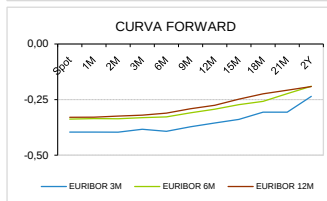
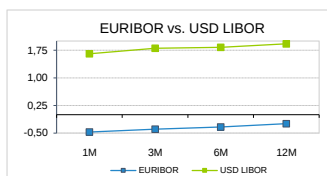
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

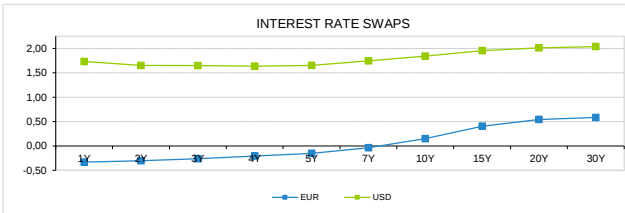
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,4700	-1	-2	1M	1,6534	0	-13	0,6393	-0,7622
3M	-0,3920	0	0	3M	1,8021	-2	-13	0,6991	-0,6750
6M	-0,3340	0	0	6M	1,8295	-2	-9	0,7439	-0,6228
12M	-0,2430	0	1	12M	1,9246	0	-8	0,8039	-0,4958

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3313	0	0	-0,2766	-0,0900	0,1341
2Y	-0,3040	0	1	-0,2331	-0,0358	0,1978
3Y	-0,2610	0	0	-0,1860	0,0201	0,2659
4Y	-0,2080	1	0	-0,1345	0,0805	0,3318
5Y	-0,1520	1	-1	-0,0806	0,1455	0,3973
7Y	-0,0360	1	-2	0,0372	0,2708	0,5060
10Y	0,1490	1	-2	0,2176	0,4355	0,6336
15Y	0,4050	1	-2	0,4442	0,5991	0,7275
20Y	0,5420	1	-1	0,5498	0,6484	0,7259
30Y	0,5850	1	0	0,5630	0,6113	0,6451

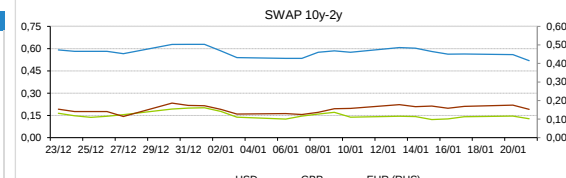
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,7320	0	-4	1,5219	1,5700	1,7538
2Y	1,6510	1	-4	1,5060	1,6045	1,7670
3Y	1,6480	7	4	1,5424	1,6440	1,8030
4Y	1,6360	2	-1	1,5560	1,6860	1,8591
5Y	1,6530	2	-4	1,5890	1,7230	1,8964
7Y	1,7440	9	7	1,6784	1,7805	1,9488
10Y	1,8400	9	9	1,7769	1,8750	1,9988
15Y	1,9530	9	9	1,8807	1,9641	2,0366
20Y	2,0120	11	12	1,9120	1,9690	2,0350
30Y	2,0370	10	11	1,9230	1,9540	1,9829

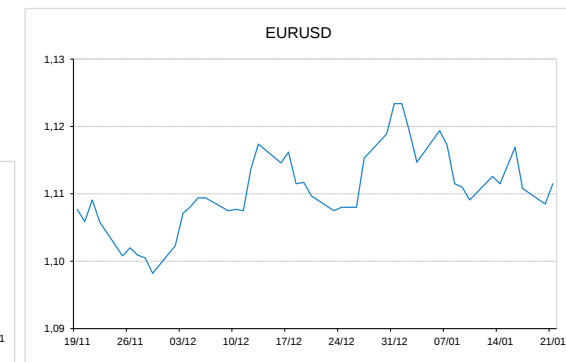
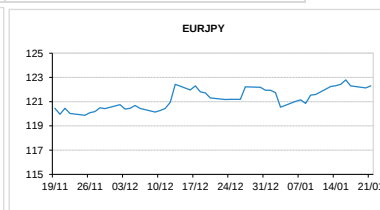


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	64,71	-0,49	-0,49	OT 2Y	-0,366	-0,01	18,10
JETFUEL	622,21	9,66	-29,14	OT 5Y	0,013	-0,02	12,60
DIESEL	581,50	9,50	-37,91	OT 10Y	0,466	-0,02	5,10
COBRE	6.263,00	-14,00	84,00	BUND 10Y	-0,874	-3,37	-4,30
ZINCO	2.458,25	15,50	111,25	SCHATZ 2Y	0,048	0,23	3,70
OURO	1.557,59	-3,14	80,19	T-NOTE 10Y	2,625	-4,60	-12,50
TRIGO	577,75	7,25	35,50	T-NOTE 2Y	2,007	-3,05	-7,30
LICENÇA C02	24,92	-0,25	-1,75	GILT 10Y	0,549	-1,83	-15,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1115	0,27%	0,36%	1,1178	1,1240	1,1364
EUR/GBP	0,8503	0,29%	0,80%	0,8527	0,8550	0,8596
EUR/JPY	122,31	-0,14%	-0,92%	122,31	122,31	122,31
EUR/CHF	1,0742	-0,01%	1,39%	1,0735	1,0727	1,0707
EUR/BRL	4,6617	-0,32%	-2,95%	4,6858	4,7262	4,8575
EUR/PLN	4,2314	0,27%	0,91%	4,2534	4,2764	4,3256



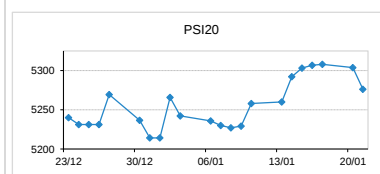
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1115	0,8503	122,31	1,0742	10,5524	7,4726	1,4502	1,61931	4,6617	9,9527
USD	0,9011	-	0,7657	109,905	0,9677	9,5174	6,7335	1,3064	1,4580	4,2011	8,9631

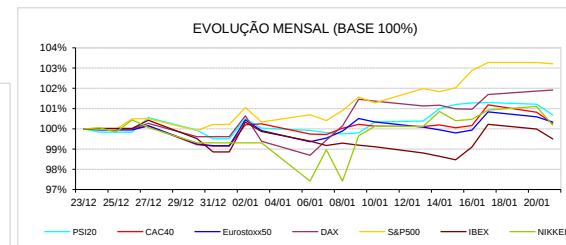
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,245	-0,24	9,95
BCP	0,189	0,05	-6,71
CORT. AMORIM	11,480	0,70	1,59
CTT	3,154	-0,88	-1,13
EDP	4,133	-0,22	6,96
EDP R	10,880	0,93	3,62
GALP	14,850	-1,59	-0,34
IBERSOL	9,000	1,12	12,50
J MARTINS	15,405	-0,80	5,05
MOTA ENGIL	1,777	-1,00	-4,97
NAVIGATOR	3,364	-0,65	-2,45
NOS	4,944	-0,52	3,00
NOVABASE	2,710	-0,73	5,04
PHAROL	0,103	0,00	3,01
RAMADA	5,700	-1,72	-2,40
REN	13,200	-0,90	-3,79
SEMAPA	0,795	-1,36	5,58
SONAE CAP.	0,869	-1,25	-4,51
SONAE SGPS	5,700	-1,72	-2,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,12
EDP R	0,93
CORT. AMORIM	0,70
BCP	0,05
SONAE CAP.	-1,25
SEMAPA	-1,36
GALP	-1,59
RAMADA	-1,72
RAMADA	-1,72



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.276,12	-0,52%	1,19%	5.429,32	4.699,20
CAC40	6.045,99	-0,54%	1,14%	6.109,81	4.820,14
ESTX 50 PR	3.789,12	-0,26%	1,17%	3.813,80	3.094,48
XTRA DAX	13.555,87	0,05%	2,32%	13.560,68	10.863,56
S&P 500	3.327,47	-0,06%	3,00%	3.329,88	2.612,86
IBEX 35	9.611,30	-0,49%	0,65%	9.709,90	8.409,20
NIKKEI 225	23.864,56	-0,91%	0,88%	24.115,95	20.110,76



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.