

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

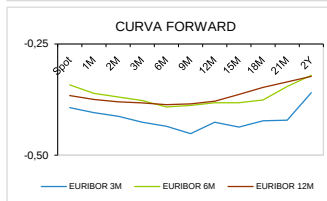
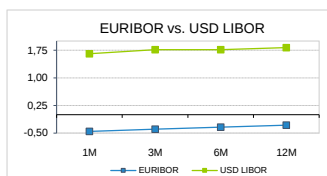
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

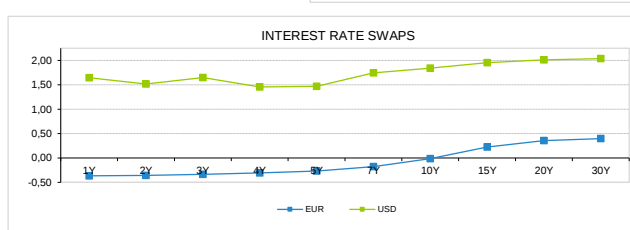
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,4540	0	-2	1M	1,6550	1	-13	0,6220
3M	-0,3930	1	-1	3M	1,7633	-1	-15	0,6924
6M	-0,3380	0	-1	6M	1,7634	-2	-15	0,7448
12M	-0,2840	-1	-4	12M	1,8216	-3	-18	0,8031
								-0,5042

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3663	0	-5	-0,3792	-0,2499	-0,0586
2Y	-0,3580	-1	-6	-0,3523	-0,2071	0,0003
3Y	-0,3370	-1	-9	-0,3197	-0,1570	0,0643
4Y	-0,3060	-1	-12	-0,2790	-0,1030	0,1255
5Y	-0,2690	-1	-14	-0,2344	-0,0437	0,1842
7Y	-0,1780	-1	-17	-0,1337	0,0754	0,2939
10Y	-0,0150	-1	-20	0,0320	0,2310	0,4135
15Y	0,2250	-2	-22	0,2491	0,3896	0,5083
20Y	0,3560	-2	-22	0,3474	0,4367	0,5052
30Y	0,3970	-2	-21	0,3550	0,3929	0,4199

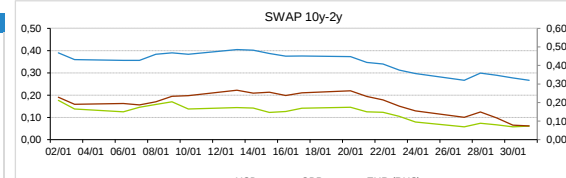
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,75
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	4,50
Austrália	0,75
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	1,6450	0	-13	1,2800	1,2820	1,4520
2Y	1,5180	2	-17	1,2440	1,3275	1,4735
3Y	1,6480	7	4	1,2570	1,3670	1,5115
4Y	1,4570	3	-19	1,3005	1,4070	1,5660
5Y	1,4670	3	-22	1,3160	1,4470	1,6214
7Y	1,7440	9	7	1,4018	1,5220	1,6630
10Y	1,8400	9	9	1,4910	1,6246	1,7160
15Y	1,9530	9	9	1,6154	1,7010	1,7395
20Y	2,0120	11	12	1,6691	1,7268	1,7620
30Y	2,0370	10	11	1,6750	1,7070	1,7270

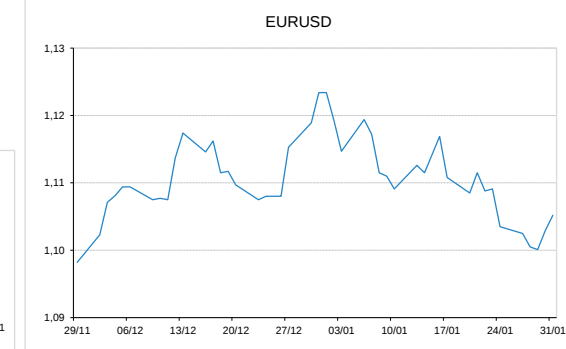
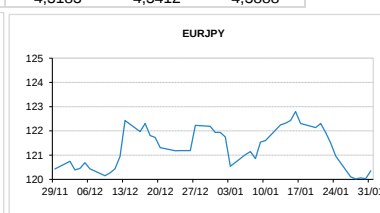


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	58,26	-0,03	-7,74	OT 2Y	-0,445	0,00	11,10
JETFUEL	538,13	-30,19	-120,12	OT 5Y	-0,136	-0,02	-2,80
DIESEL	503,00	-24,59	-123,25	OT 10Y	0,265	-0,02	-17,60
COBRE	5.565,00	-53,50	-631,50	BUND 10Y	-1,069	-3,10	-31,10
ZINCO	2.200,25	-20,50	-111,00	SCHATZ 2Y	-0,039	-1,37	-8,30
OURO	1.582,86	-2,07	60,05	T-NOTE 10Y	2,437	-1,35	-29,60
TRIGO	557,00	-3,50	-1,75	T-NOTE 2Y	1,851	-2,28	-17,50
LICENÇA C02	23,91	0,17	-0,73	GILT 10Y	0,431	-1,47	-26,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1052	0,21%	-1,62%	1,1113	1,1173	1,1290
EUR/GBP	0,84175	0,01%	1,08%	0,8444	0,8469	0,8518
EUR/JPY	120,35	-0,27%	1,32%	120,35	120,35	120,35
EUR/CHF	1,0689	0,06%	1,58%	1,0681	1,0673	1,0657
EUR/BRL	4,7442	-1,24%	-4,89%	4,7756	4,8203	4,9366
EUR/PLN	4,2966	-0,07%	-0,98%	4,3183	4,3412	4,3888



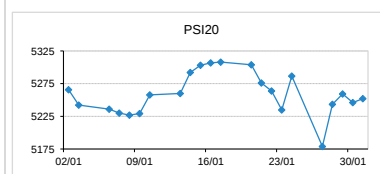
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1052	0,8418	120,35	1,0689	10,6760	7,4730	1,4650	1,65427	4,7442	10,1909
USD	0,9027	-	0,7588	108,415	0,9646	9,6400	6,7457	1,3227	1,4942	4,2751	9,2217

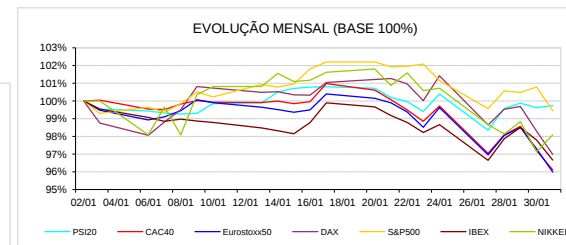
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,580	-1,93	-1,76
BCP	0,192	-0,73	-5,47
CORT. AMORIM	10,820	0,19	-4,25
CTT	2,928	-2,27	-8,21
EDP	4,524	2,12	17,08
EDP R	12,000	1,01	14,29
GALP	13,640	-0,07	-8,46
IBERSOL	8,580	-1,15	7,25
J MARTINS	15,545	0,32	6,00
MOTA ENGIL	1,689	-1,23	-9,68
NAVIGATOR	3,240	-1,04	-6,05
NOS	4,682	-0,38	-2,46
NOVABASE	2,700	-1,10	4,65
PHAROL	0,102	-0,59	2,01
RAMADA	5,720	0,70	-2,05
REN	12,580	-1,41	-8,31
SEMAPA	0,769	-0,26	2,12
SONAE CAP.	0,840	-0,47	-7,75
SONAE SGPS	5,720	0,70	-2,05

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	2,12
EDP R	1,01
RAMADA	0,70
J MARTINS	0,32
IBERSOL	-1,15
MOTA ENGIL	-1,23
REN	-1,41
ALTRI	-1,93
CTT	-2,27



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.252,03	0,11%	0,73%	5.429,32	4.699,20
CAC40	5.806,34	-1,11%	-2,87%	6.109,81	4.946,14
ESTX 50 PR	3.640,91	-1,35%	-2,78%	3.813,80	3.124,62
XTRA DAX	12.981,97	-1,33%	-2,02%	13.640,06	10.863,56
S&P 500	3.239,68	-1,34%	0,27%	3.337,77	2.678,65
IBEX 35	9.367,90	-1,16%	-1,90%	9.709,90	8.409,20
NIKKEI 225	23.205,18	0,99%	-1,91%	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.