

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

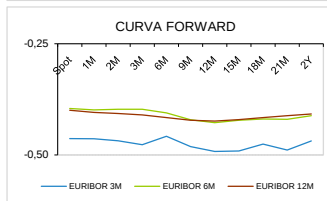
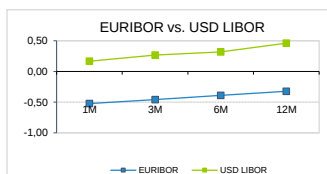
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

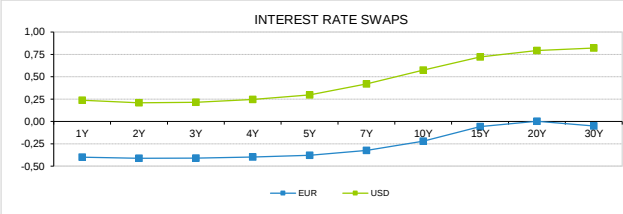
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5230	-1	-2	1M	0,1669	0	-1	0,0684	-0,7836
3M	-0,4580	0	-5	3M	0,2683	0	-4	0,0919	-0,7068
6M	-0,3890	-1	-10	6M	0,3175	0	-4	0,1733	-0,6580
12M	-0,3230	-2	-12	12M	0,4605	0	-11	0,3136	-0,5292

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,3990	-1	-6	-0,4238	-0,3605	-0,2384
2Y	-0,4119	0	-3	-0,4157	-0,3290	-0,1950
3Y	-0,4110	0	-3	-0,3971	-0,3000	-0,1540
4Y	-0,3985	1	-3	-0,3718	-0,2626	-0,1110
5Y	-0,3785	1	-3	-0,3465	-0,2242	-0,0650
7Y	-0,3249	2	-3	-0,2786	-0,1413	0,0127
10Y	-0,2202	2	-4	-0,1632	-0,0275	0,0985
15Y	-0,0575	2	-5	-0,0175	0,0625	0,1250
20Y	0,0020	2	-6	0,0185	0,0533	0,0750
30Y	-0,0508	3	-6	-0,0502	-0,0423	-0,0406

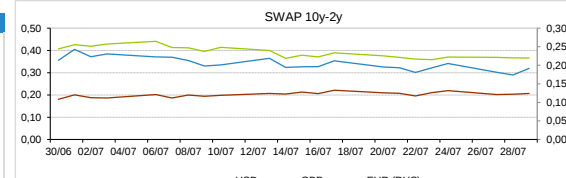
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,25
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2372	-1	-3	0,1763	0,3396	0,6530
2Y	0,2085	-1	-2	0,2008	0,4202	0,7334
3Y	0,2140	-1	-2	0,2470	0,5032	0,7830
4Y	0,2456	-1	-2	0,3025	0,5760	0,8262
5Y	0,2963	-1	-3	0,3770	0,6373	0,8608
7Y	0,4198	-1	-4	0,5115	0,7327	0,8980
10Y	0,5743	-1	-5	0,6542	0,8207	0,9320
15Y	0,7218	-1	-6	0,7753	0,8881	0,9580
20Y	0,7935	-1	-7	0,8200	0,9047	0,9430
30Y	0,8209	0	-7	0,8330	0,8752	0,8978

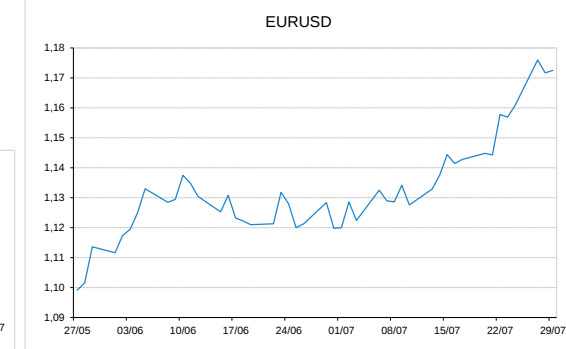
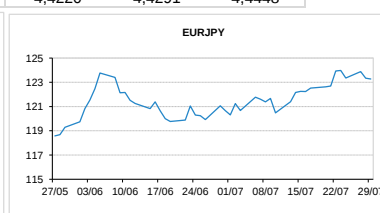


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,66	0,44	1,81	OT 2Y	-0,446	-0,01	2,80
JETFUEL	349,00	-6,04	30,25	OT 5Y	-0,170	-0,01	-7,40
DIESEL	375,50	-4,79	34,75	OT 10Y	0,352	-0,01	-12,30
COBRE	6.469,00	56,50	520,00	BUND 10Y	-1,197	1,20	-1,90
ZINCO	2.244,25	11,75	210,25	SCHATZ 2Y	-0,048	0,23	2,10
OURO	1.957,20	10,20	187,27	T-NOTE 10Y	1,669	-0,28	-3,50
TRIGO	531,25	7,75	44,75	T-NOTE 2Y	0,730	-0,74	-1,80
LICENÇA C02	25,99	0,25	-0,64	GILT 10Y	0,144	1,01	-3,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1725	0,07%	3,91%	1,1748	1,1775	1,1819
EUR/GBP	0,90385	0,65%	1,28%	0,9052	0,9066	0,9094
EUR/JPY	123,28	0,05%	-1,79%	123,28	123,28	123,28
EUR/CHF	1,0762	-0,04%	-0,65%	1,0755	1,0746	1,0732
EUR/BRL	6,0731	-0,49%	0,04%	6,0994	6,1305	6,1951
EUR/PLN	4,4164	-0,06%	1,04%	4,4220	4,4291	4,4448



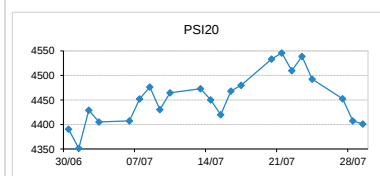
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1725	0,9039	123,28	1,0762	10,3002	7,4427	1,5728	1,64254	6,0731	10,6671
USD	0,8492	-	0,7712	105,08	0,9145	8,7537	6,3208	1,3352	1,3954	5,1536	9,0652

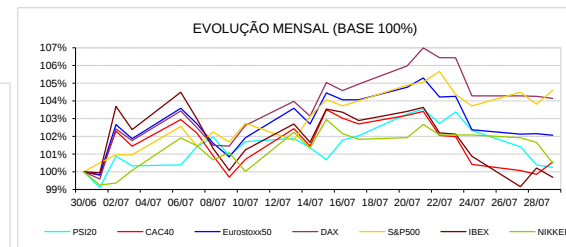
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,292	0,89	-24,44
BCP	0,100	-1,28	-50,54
CORT. AMORIM	9,890	-1,49	-12,48
CTT	2,305	0,88	-27,74
EDP	4,321	-1,91	14,42
EDP R	13,920	-0,43	32,57
GALP	9,470	-1,23	-36,44
IBERSOL	5,540	-1,77	-30,75
J MARTINS	14,705	1,34	0,27
MOTA ENGIL	1,198	1,18	-35,94
NAVIGATOR	2,212	2,60	-35,86
NOS	3,906	1,88	-18,50
PHAROL	0,121	7,84	21,49
RAMADA	3,230	0,31	-44,69
REN	2,485	-0,20	-8,64
SEMAPA	7,950	0,63	-42,06
SONAE CAP.	0,477	-2,85	-36,65
SONAE SGPS	0,609	-0,65	-33,08

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	7,84
NAVIGATOR	2,60
NOS	1,88
J MARTINS	1,34
MOTA ENGIL	1,18
BCP	-1,28
CORT. AMORIM	-1,49
IBERSOL	-1,77
EDP	-1,91
SONAE CAP.	-2,85



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.400,94	-0,15%	-15,60%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.962,95	0,69%	-16,98%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.300,83	-0,08%	-11,86%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.821,02	-0,11%	-3,23%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.243,60	0,77%	0,38%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.208,40	-0,52%	-24,51%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.397,11	-1,15%	-5,32%	24.115,95	16.358,19



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.