

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

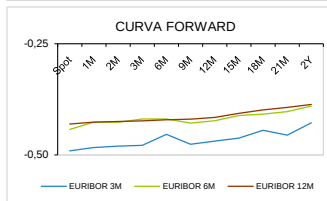
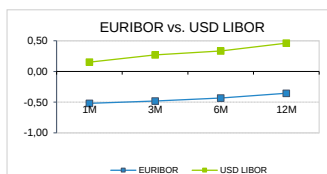
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

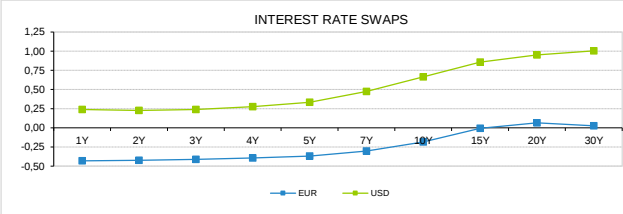
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5190	0	-1	1M	0,1515	-1	-3	0,0571	-0,7800
3M	-0,4800	0	-4	3M	0,2704	-1	0	0,0715	-0,7074
6M	-0,4330	0	-8	6M	0,3325	-1	-1	0,1251	-0,6534
12M	-0,3550	0	-7	12M	0,4609	0	-2	0,2720	-0,5130

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4308	0	-6	-0,4155	-0,3444	-0,1911
2Y	-0,4230	-1	-3	-0,4010	-0,3113	-0,1449
3Y	-0,4107	-1	-2	-0,3827	-0,2710	-0,0986
4Y	-0,3930	-2	-2	-0,3563	-0,2275	-0,0515
5Y	-0,3695	-2	-2	-0,3230	-0,1831	-0,0045
7Y	-0,3040	-3	-1	-0,2451	-0,0919	0,0804
10Y	-0,1850	-3	-1	-0,1178	0,0324	0,1703
15Y	-0,0060	-3	0	0,0404	0,1321	0,2059
20Y	0,0650	-3	1	0,0870	0,1303	0,1613
30Y	0,0260	-3	1	0,0297	0,0413	0,0459

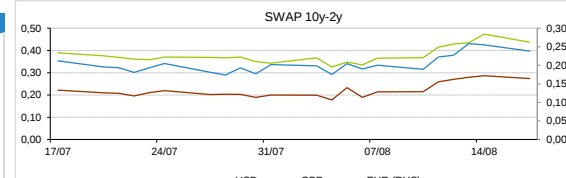
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2400	-1	-1	0,2156	0,3910	0,7574
2Y	0,2265	-1	0	0,2367	0,4768	0,8220
3Y	0,2394	-1	1	0,2879	0,5700	0,8920
4Y	0,2755	-2	1	0,3554	0,6450	0,9586
5Y	0,3331	-2	1	0,4362	0,7240	1,0074
7Y	0,4757	-3	2	0,5820	0,8370	1,0610
10Y	0,6641	-4	5	0,7647	0,9610	1,1155
15Y	0,8564	-5	9	0,9257	1,0550	1,1570
20Y	0,9515	-5	11	0,9880	1,0947	1,1705
30Y	1,0048	-5	13	1,0287	1,0771	1,1103

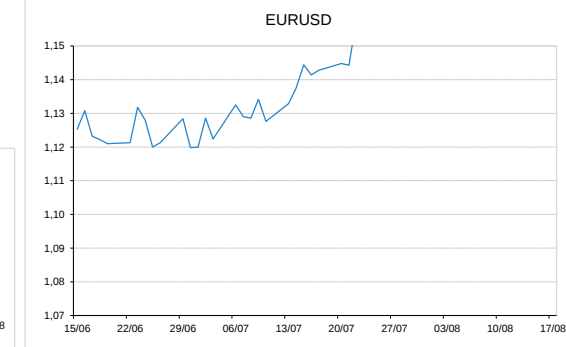
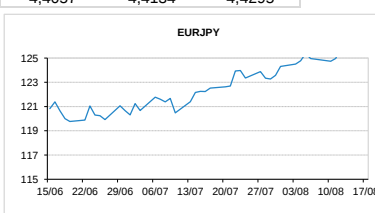
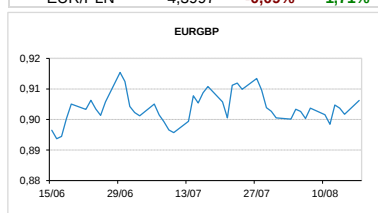


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,01	0,21	1,71	OT 2Y	-0,451	-0,01	-4,90
JETFUEL	351,48	-0,02	6,24	OT 5Y	-0,174	-0,02	-10,20
DIESEL	378,41	-0,84	11,16	OT 10Y	0,347	-0,03	-12,40
COBRE	6.365,50	110,50	-132,00	BUND 10Y	-1,150	-3,21	-5,60
ZINCO	2.348,00	-7,00	160,50	SCHATZ 2Y	-0,016	-0,92	0,00
OURO	1.987,79	42,67	177,37	T-NOTE 10Y	1,696	-2,80	-7,50
TRIGO	526,25	16,75	-14,25	T-NOTE 2Y	0,748	-0,37	-4,40
LICENÇA C02	26,30	0,82	-1,52	GILT 10Y	0,242	-3,39	-2,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1853	0,34%	3,72%	1,1876	1,1902	1,1947
EUR/GBP	0,90625	-0,50%	0,50%	0,9076	0,9090	0,9119
EUR/JPY	125,99	0,02%	-2,75%	125,99	125,99	125,99
EUR/CHF	1,0752	0,12%	-0,24%	1,0745	1,0737	1,0725
EUR/BRL	6,5031	-1,20%	-5,33%	6,5311	6,5583	6,6331
EUR/PLN	4,3997	-0,09%	1,71%	4,4057	4,4134	4,4295



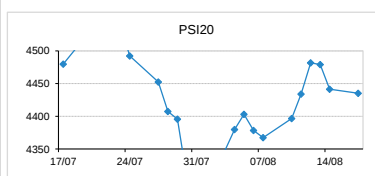
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1853	0,9063	125,99	1,0752	10,3206	7,4454	1,5664	1,64523	6,5031	10,5294
USD	0,8427	-	0,7636	106,075	0,9066	8,6948	6,2743	1,3208	1,3876	5,4645	8,8727

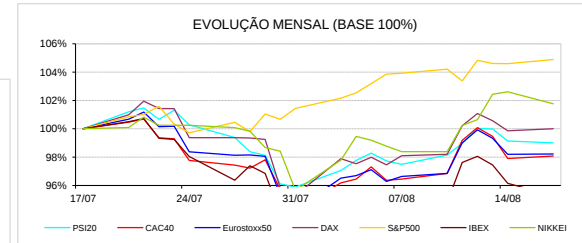
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,490	0,27	-20,95
BCP	0,105	-0,47	-48,08
CORT. AMORIM	10,460	0,77	-7,43
CTT	2,875	-0,35	-9,87
EDP	4,363	0,28	15,53
EDP R	13,820	1,17	31,62
GALP	9,448	-0,84	-36,59
IBERSOL	5,280	-2,94	-34,00
J MARTINS	13,980	-1,13	-4,67
MOTA ENGIL	1,490	4,49	-20,32
NAVIGATOR	2,370	2,69	-31,27
NOS	3,622	-0,88	-24,54
PHAROL	0,116	0,00	16,47
RAMADA	3,540	0,57	-39,38
REN	2,445	-1,61	-10,11
SEMAPA	8,020	-0,62	-41,55
SONAE CAP.	0,674	0,00	-10,49
SONAE SGPS	0,606	-0,66	-33,41

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	4,49
NAVIGATOR	2,69
EDP R	1,17
CORT. AMORIM	0,77
RAMADA	0,57
GALP	-0,84
NOS	-0,88
J MARTINS	-1,13
REN	-1,61
IBERSOL	-2,94



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.435,15	-0,14%	-14,94%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.971,94	0,18%	-16,83%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.305,85	0,02%	-11,73%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.920,66	0,15%	-2,48%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.382,36	0,29%	4,70%	3.393,52	2.191,86
IBEX 35	7.090,10	-0,90%	-25,75%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.096,75	-0,83%	-2,37%	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.