

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

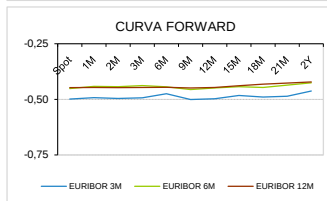
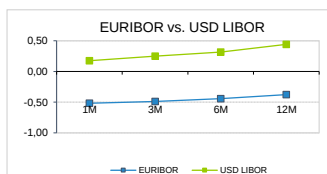
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

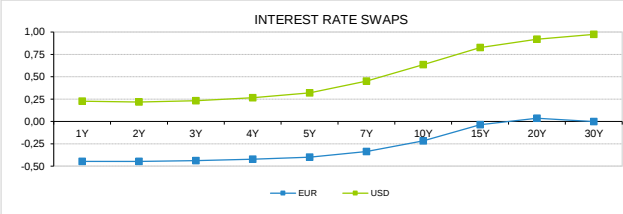
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5180	0	-1	1M	0,1751	-1	0	0,0510	-0,7830
3M	-0,4880	0	-4	3M	0,2500	-1	-1	0,0698	-0,7164
6M	-0,4420	0	-7	6M	0,3144	2	-3	0,1154	-0,6658
12M	-0,3770	0	-9	12M	0,4410	0	-2	0,2568	-0,5250

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4470	0	-6	-0,4468	-0,3745	-0,2297
2Y	-0,4468	0	-5	-0,4339	-0,3425	-0,1824
3Y	-0,4385	0	-4	-0,4145	-0,3040	-0,1373
4Y	-0,4227	0	-4	-0,3885	-0,2613	-0,0901
5Y	-0,3997	1	-4	-0,3563	-0,2183	-0,0414
7Y	-0,3366	1	-3	-0,2794	-0,1255	0,0480
10Y	-0,2178	1	-3	-0,1500	0,0010	0,1393
15Y	-0,0370	1	-1	0,0098	0,1024	0,1775
20Y	0,0357	1	1	0,0586	0,1032	0,1347
30Y	-0,0015	1	2	0,0023	0,0159	0,0223

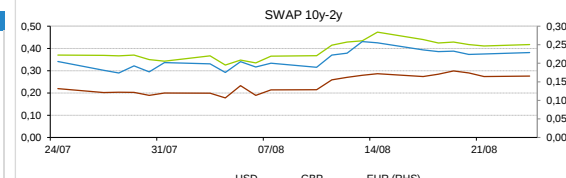
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2257	0	-1	0,2081	0,3595	0,7087
2Y	0,2172	0	0	0,2320	0,4524	0,7480
3Y	0,2316	0	1	0,2770	0,5086	0,8355
4Y	0,2653	0	1	0,3420	0,5885	0,9145
5Y	0,3189	0	1	0,4158	0,6940	0,9617
7Y	0,4512	0	2	0,5601	0,8137	1,0095
10Y	0,6351	1	5	0,7319	0,9353	1,0710
15Y	0,8260	1	10	0,8810	1,0294	1,1085
20Y	0,9200	1	13	0,9550	1,0470	1,1373
30Y	0,9736	1	16	0,9630	1,0410	1,0760

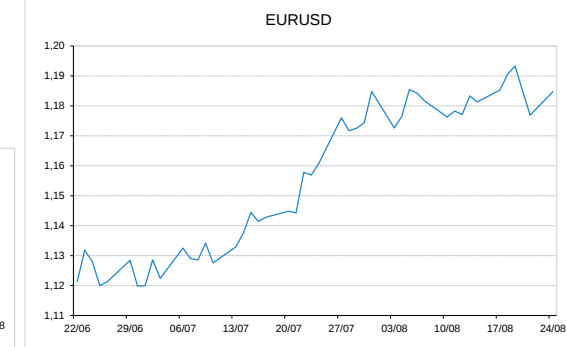
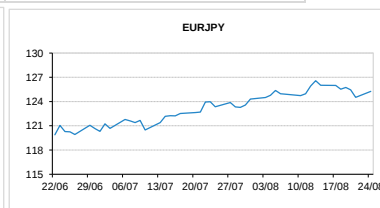
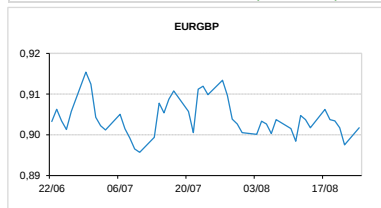


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	45,08	0,73	1,30	OT 2Y	-0,487	-0,02	-1,90
JETFUEL	333,00	-10,75	-33,75	OT 5Y	-0,182	0,01	-1,10
DIESEL	363,50	-12,00	-25,75	OT 10Y	0,344	0,02	1,80
COBRE	6.490,00	-111,50	-44,50	BUND 10Y	-1,198	0,93	-1,60
ZINCO	2.439,85	-35,65	196,85	SCHATZ 2Y	-0,030	0,69	0,20
OURO	1.933,90	-6,58	31,88	T-NOTE 10Y	1,687	0,28	0,80
TRIGO	528,25	-6,75	-17,00	T-NOTE 2Y	0,754	0,74	1,00
LICENÇA C02	27,28	1,63	0,91	GILT 10Y	0,237	0,00	8,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1847	0,66%	2,06%	1,1870	1,1895	1,1941
EUR/GBP	0,90175	-0,47%	0,90%	0,9031	0,9045	0,9074
EUR/JPY	125,26	-0,58%	-1,52%	125,26	125,26	125,26
EUR/CHF	1,0751	0,02%	-0,19%	1,0744	1,0736	1,0723
EUR/BRL	6,6061	0,35%	-7,68%	6,6398	6,6669	6,7368
EUR/PLN	4,3950	0,46%	0,26%	4,4015	4,4096	4,4266



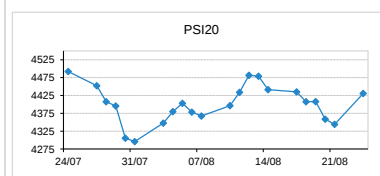
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1847	0,9018	125,26	1,0751	10,3691	7,4435	1,5603	1,64538	6,6061	10,6168
USD	0,8465	-	0,7651	105,845	0,9106	8,7821	6,2999	1,3210	1,3944	5,6089	8,9871

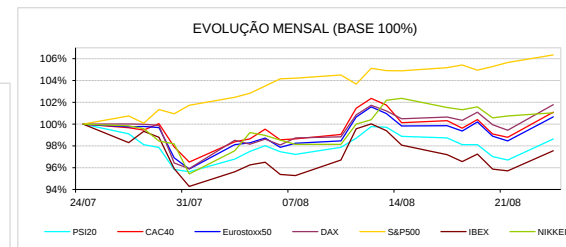
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,286	0,94	-24,54
BCP	0,103	1,18	-49,06
CORT. AMORIM	10,080	0,40	-10,80
CTT	2,800	-0,71	-12,23
EDP	4,431	3,46	17,33
EDP R	14,300	2,29	36,19
GALP	9,366	4,51	-37,14
IBERSOL	5,660	2,17	-29,25
J MARTINS	13,945	0,98	-4,91
MOTA ENGIL	1,442	1,12	-22,89
NAVIGATOR	2,322	3,20	-32,67
NOS	3,590	1,47	-25,21
PHAROL	0,110	-0,54	10,64
RAMADA	3,460	0,00	-40,75
REN	2,475	0,81	-9,01
SEMAPA	7,910	1,41	-42,35
SONAE CAP.	0,672	0,30	-10,76
SONAE SGPS	0,611	1,92	-32,91

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	4,51
EDP	3,46
NAVIGATOR	3,20
EDP R	2,29
IBERSOL	2,17
PHAROL	-0,54
CTT	-0,71



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.430,61	1,99%	-15,03%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.010,19	2,33%	-16,19%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.332,71	2,24%	-11,01%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.066,59	2,36%	-1,38%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.420,14	0,67%	5,85%	3.426,99	2.191,86
IBEX 35	7.115,90	1,92%	-25,48%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	22.985,51	0,28%	-2,84%	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.