

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

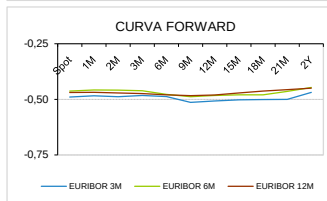
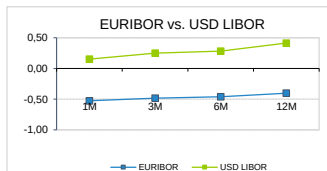
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

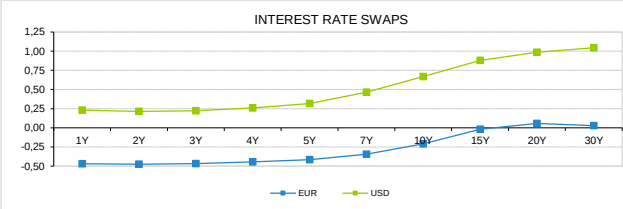
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5260	-1	-1	1M	0,1524	0	-1	0,0509	-0,7940
3M	-0,4840	0	0	3M	0,2504	0	0	0,0570	-0,7480
6M	-0,4600	-1	-3	6M	0,2819	0	-6	0,0808	-0,7068
12M	-0,4030	-1	-5	12M	0,4139	0	-4	0,1634	-0,5608

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4691	-1	-4	-0,4823	-0,3813	-0,2152
2Y	-0,4750	-1	-6	-0,4651	-0,3430	-0,1644
3Y	-0,4665	-1	-7	-0,4375	-0,3057	-0,1116
4Y	-0,4453	0	-7	-0,4031	-0,2519	-0,0588
5Y	-0,4164	0	-7	-0,3653	-0,2030	-0,0060
7Y	-0,3438	0	-6	-0,2774	-0,1005	0,0848
10Y	-0,2100	0	-5	-0,1353	0,0313	0,1782
15Y	-0,0194	0	-4	0,0308	0,1317	0,2164
20Y	0,0576	0	-4	0,0839	0,1363	0,1766
30Y	0,0282	0	-2	0,0370	0,0528	0,0645

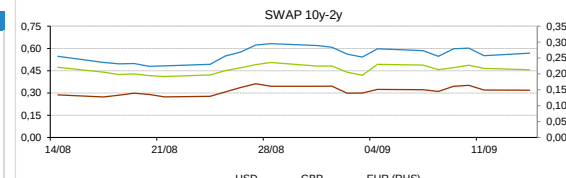
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2308	0	-1	0,1979	0,3698	0,7510
2Y	0,2140	0	-2	0,2196	0,4611	0,8394
3Y	0,2232	0	-3	0,2692	0,5558	0,9145
4Y	0,2593	0	-3	0,3376	0,6494	0,9795
5Y	0,3174	0	-4	0,4226	0,7311	1,0338
7Y	0,4643	0	-4	0,5829	0,8671	1,0970
10Y	0,6695	-1	-4	0,7742	0,9870	1,1630
15Y	0,8804	-1	-2	0,9420	1,0930	1,2110
20Y	0,9860	-1	-1	1,0375	1,1300	1,2090
30Y	1,0450	-1	-1	1,0711	1,1261	1,1623

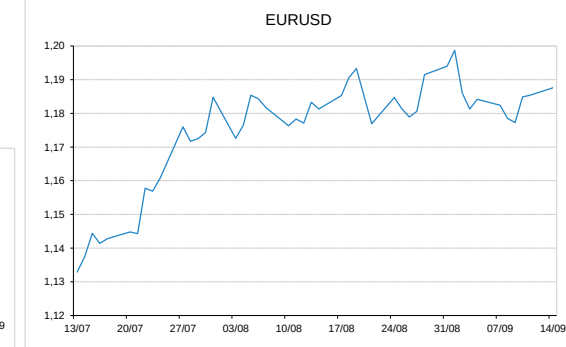
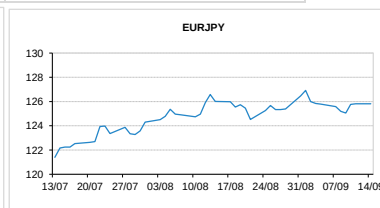
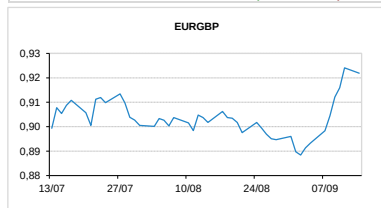


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	39,56	-0,27	-5,77	OT 2Y	-0,570	-0,01	-14,10
JETFUEL	305,00	7,75	-41,85	OT 5Y	-0,224	-0,02	-9,50
DIESEL	325,00	4,50	-50,60	OT 10Y	0,305	-0,03	-9,20
COBRE	6.715,00	70,50	353,00	BUND 10Y	-0,997	0,00	-8,50
ZINCO	2.448,75	56,50	46,50	SCHATZ 2Y	-0,130	0,00	-4,10
OURO	1.960,09	19,54	14,97	T-NOTE 10Y	1,680	-0,14	-7,10
TRIGO	543,75	1,75	34,25	T-NOTE 2Y	0,722	0,92	-2,80
LICENÇA C02	30,33	2,07	4,85	GILT 10Y	0,303	1,53	-5,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1876	0,19%	0,53%	1,1900	1,1928	1,1977
EUR/GBP	0,9219	0,24%	-2,19%	0,9233	0,9247	0,9276
EUR/JPY	125,82	0,00%	0,15%	125,82	125,82	125,82
EUR/CHF	1,0770	-0,03%	-0,04%	1,0763	1,0754	1,0743
EUR/BRL	6,2832	0,30%	2,27%	6,3100	6,3398	6,4146
EUR/PLN	4,4461	0,06%	-1,10%	4,4529	4,4622	4,4805



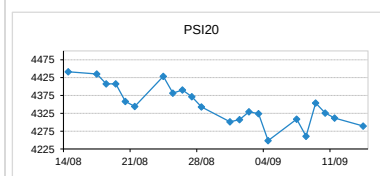
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1876	0,9219	125,82	1,0770	10,4078	7,4407	1,5642	1,6271	6,2832	10,7127
USD	0,8424	-	0,7765	105,655	0,9066	8,7676	6,2676	1,3177	1,3713	5,3033	9,0091

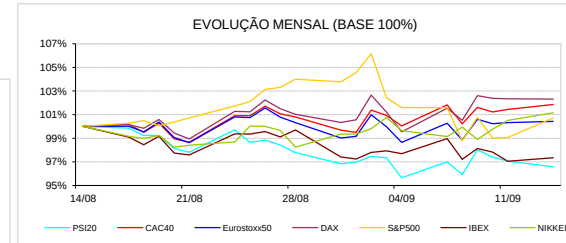
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,184	-0,66	-26,34
BCP	0,092	-0,22	-54,73
CORT. AMORIM	10,620	1,14	-6,02
CTT	2,580	-1,15	-19,12
EDP	4,233	-1,10	12,09
EDP R	14,080	-0,14	34,10
GALP	8,858	-1,01	-40,55
IBERSOL	5,360	-0,74	-33,00
J MARTINS	13,935	-1,17	-4,98
MOTA ENGIL	1,294	-1,07	-30,80
NAVIGATOR	2,330	-0,34	-32,43
NOS	3,456	-0,17	-28,00
PHAROL	0,110	0,37	10,24
RAMADA	3,270	-0,30	-44,01
REN	2,390	-0,21	-12,13
SEMAPA	7,980	-0,62	-41,84
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,617	-0,56	-32,25

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	1,14
PHAROL	0,37
GALP	-1,01
MOTA ENGIL	-1,07
EDP	-1,10
CTT	-1,15
J MARTINS	-1,17



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.289,44	-0,51%	-17,73%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.055,19	0,42%	-15,44%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.319,29	0,10%	-11,37%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.200,80	-0,02%	-0,36%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.397,14	1,68%	5,14%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.964,30	0,30%	-27,07%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.559,30	0,65%	-0,41%	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.