

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

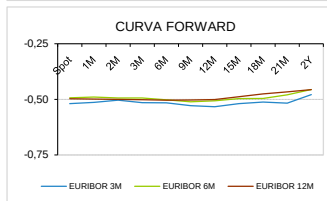
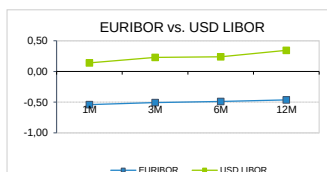
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

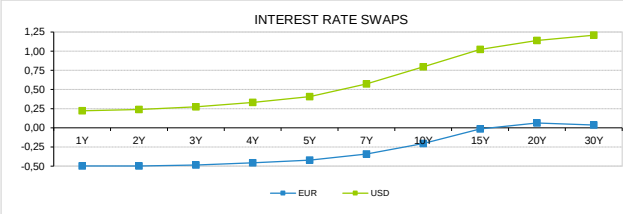
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5400	0	-3	1M	0,1396	0	-1	0,0464	-0,8014
3M	-0,5080	0	-2	3M	0,2298	1	-2	0,0544	-0,7620
6M	-0,4880	-1	-3	6M	0,2393	1	-5	0,0744	-0,7212
12M	-0,4630	0	-6	12M	0,3439	0	-8	0,1515	-0,5976

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4970	-1	-3	-0,5007	-0,3770	-0,2064
2Y	-0,4988	0	-3	-0,4786	-0,3300	-0,1490
3Y	-0,4843	0	-2	-0,4433	-0,2885	-0,0999
4Y	-0,4567	0	-1	-0,4024	-0,2390	-0,0483
5Y	-0,4218	1	-1	-0,3638	-0,1912	0,0050
7Y	-0,3421	1	-1	-0,2723	-0,0904	0,0639
10Y	-0,2057	1	-1	-0,1293	0,0370	0,1833
15Y	-0,0155	2	-1	0,0374	0,1407	0,2213
20Y	0,0631	2	-1	0,0910	0,1456	0,1816
30Y	0,0360	2	-2	0,0443	0,0640	0,0743

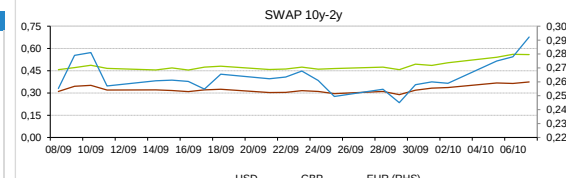
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2221	0	-2	0,2542	0,5020	0,8930
2Y	0,2382	1	1	0,2992	0,6119	0,9948
3Y	0,2741	1	2	0,3706	0,6980	1,0680
4Y	0,3318	1	4	0,4551	0,8024	1,1370
5Y	0,4074	1	4	0,5437	0,8780	1,2022
7Y	0,5732	1	7	0,7110	1,0296	1,2710
10Y	0,7962	0	8	0,9229	1,1530	1,3380
15Y	1,0242	0	9	1,1121	1,2680	1,3930
20Y	1,1402	0	12	1,1910	1,3222	1,4119
30Y	1,2094	-1	11	1,2330	1,3020	1,3390

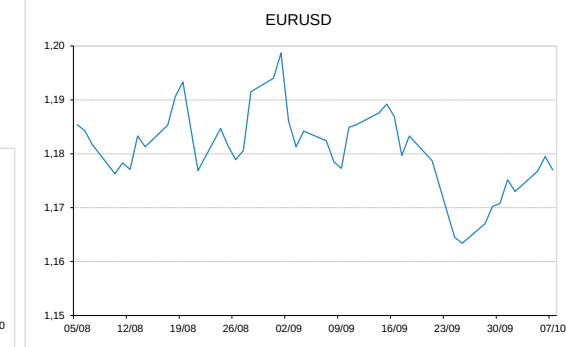
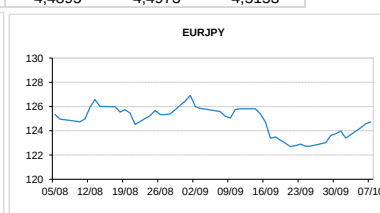


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	41,70	-0,95	-0,84	OT 2Y	-0,584	0,00	-9,00
JETFUEL	345,76	15,51	27,87	OT 5Y	-0,274	-0,01	-6,00
DIESEL	345,75	12,00	3,61	OT 10Y	0,231	0,00	-12,30
COBRE	6.537,50	1,50	-180,00	BUND 10Y	-1,005	1,29	-12,40
ZINCO	2.344,85	36,35	-124,65	SCHATZ 2Y	-0,119	0,69	-4,80
OURO	1.888,49	-15,48	-40,11	T-NOTE 10Y	1,752	2,11	-4,50
TRIGO	605,00	12,25	54,75	T-NOTE 2Y	0,744	0,74	-2,20
LICENÇA C02	27,15	0,36	0,10	GILT 10Y	0,414	1,98	-12,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,177	-0,21%	-0,46%	1,1795	1,1817	1,1867
EUR/GBP	0,91413	-0,39%	-1,73%	0,9156	0,9169	0,9199
EUR/JPY	124,73	-0,12%	0,69%	124,73	124,73	124,73
EUR/CHF	1,0787	-0,07%	0,39%	1,0780	1,0773	1,0759
EUR/BRL	6,6	-0,56%	-4,89%	6,6335	6,6713	6,7820
EUR/PLN	4,4810	0,04%	-0,98%	4,4895	4,4973	4,5153



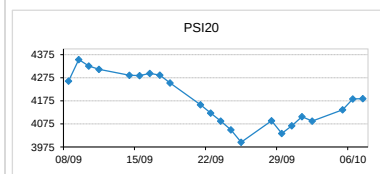
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1770	0,9141	124,73	1,0787	10,4633	7,4419	1,5628	1,64755	6,6000	10,9370
USD	0,8503	-	0,7755	106,025	0,9171	8,8846	6,3276	1,3285	1,4011	5,6198	9,3081

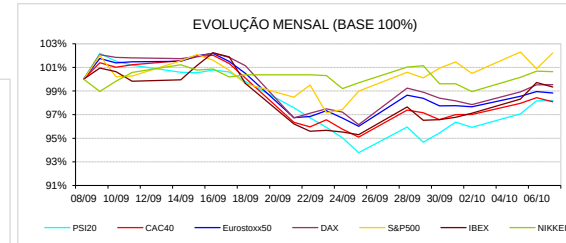
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,896	0,26	-31,41
BCP	0,081	0,25	-60,01
CORT. AMORIM	10,620	-3,98	-6,02
CTT	2,630	2,53	-17,55
EDP	4,342	3,09	14,98
EDP R	15,160	1,61	44,38
GALP	8,276	-1,87	-44,46
IBERSOL	4,400	-3,30	-45,00
J MARTINS	14,235	-1,83	-2,93
MOTA ENGIL	1,208	6,34	-35,40
NAVIGATOR	2,124	0,00	-38,41
NOS	3,104	-0,96	-35,33
PHAROL	0,103	-1,34	3,61
RAMADA	3,030	1,00	-48,12
REN	2,380	-0,42	-12,50
SEMAPA	7,450	-0,67	-45,70
SONAE CAP.	0,702	1,45	-6,77
SONAE SGPS	0,573	-1,21	-37,03

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	6,34
EDP	3,09
CTT	2,53
EDP R	1,61
SONAE CAP.	1,45
PHAROL	-1,34
J MARTINS	-1,83
GALP	-1,87
IBERSOL	-3,30
CORT. AMORIM	-3,98



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.184,25	0,03%	-19,75%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.878,79	-0,34%	-18,39%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.229,32	-0,12%	-13,77%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.908,59	0,02%	-2,57%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.405,77	1,33%	5,41%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.909,40	-0,39%	-27,64%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.422,82	-0,05%	-0,99%	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.