

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

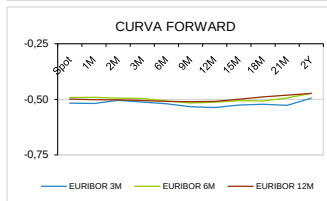
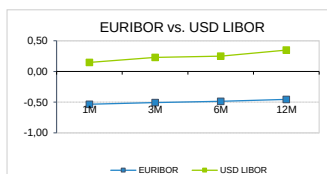
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

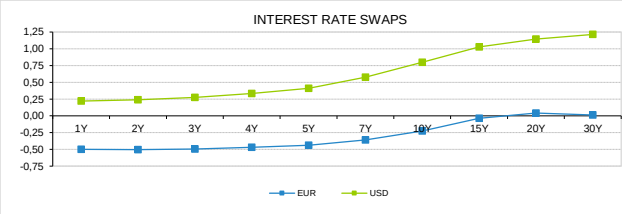
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5340	1	-2	1M	0,1470	1	-1	0,0459	-0,8036
3M	-0,5060	0	-2	3M	0,2295	0	-1	0,0635	-0,7674
6M	-0,4860	0	-3	6M	0,2501	1	-4	0,0750	-0,7220
12M	-0,4550	1	-5	12M	0,3479	0	-7	0,1520	-0,5978

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4990	1	-3	-0,5092	-0,4006	-0,2278
2Y	-0,5040	-1	-3	-0,4912	-0,3544	-0,1717
3Y	-0,4937	-1	-2	-0,4595	-0,3117	-0,1211
4Y	-0,4690	-1	-2	-0,4219	-0,2623	-0,0696
5Y	-0,4375	-1	-1	-0,3834	-0,2141	-0,0155
7Y	-0,3599	-1	-1	-0,2928	-0,1138	0,0688
10Y	-0,2248	-1	0	-0,1502	0,0140	0,1598
15Y	-0,0362	-2	-1	0,0160	0,1182	0,1969
20Y	0,0417	-2	-1	0,0678	0,1215	0,1578
30Y	0,0135	-2	-1	0,0201	0,0396	0,0494

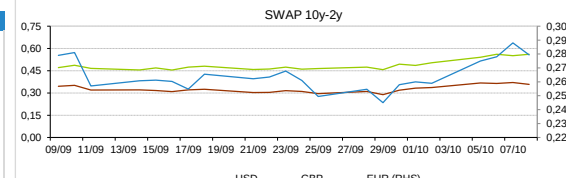
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2205	0	-2	0,2546	0,5103	0,8980
2Y	0,2388	0	1	0,3019	0,6148	0,9996
3Y	0,2748	0	4	0,3709	0,7122	1,0795
4Y	0,3340	0	6	0,4572	0,7895	1,1466
5Y	0,4103	1	8	0,5464	0,8770	1,2048
7Y	0,5757	1	9	0,7130	1,0115	1,2911
10Y	0,7990	1	12	0,9248	1,1490	1,3320
15Y	1,0276	1	14	1,0980	1,2650	1,3880
20Y	1,1438	1	16	1,1885	1,3060	1,3895
30Y	1,2142	1	18	1,2478	1,3124	1,3534

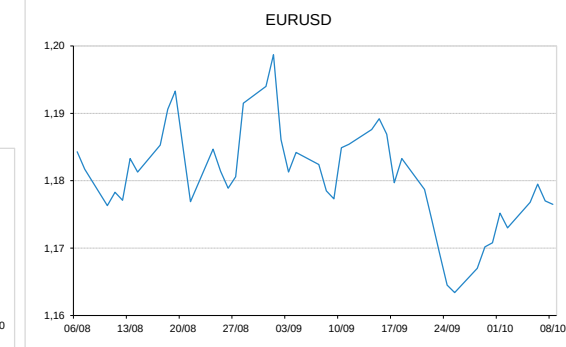
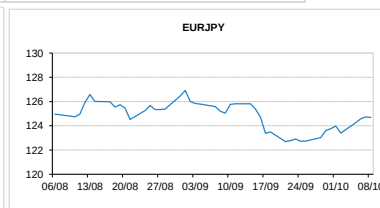
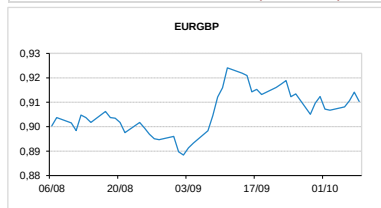


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,83	0,84	2,47	OT 2Y	-0,595	-0,01	-4,40
JETFUEL	338,40	-7,36	26,83	OT 5Y	-0,301	-0,03	-12,20
DIESEL	341,88	-3,87	4,59	OT 10Y	0,199	-0,03	-16,10
COBRE	6.661,50	149,00	-110,00	BUND 10Y	-1,037	-2,91	-2,10
ZINCO	2.337,75	-7,10	-156,25	SCHATZ 2Y	-0,135	-1,37	0,70
OURO	1.889,96	3,37	-49,05	T-NOTE 10Y	1,748	-1,27	4,80
TRIGO	596,50	-11,00	52,25	T-NOTE 2Y	0,743	-0,56	1,50
LICENÇA C02	26,33	-0,57	-0,46	GILT 10Y	0,394	-1,72	11,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1765	-0,04%	-0,17%	1,1790	1,1812	1,1861
EUR/GBP	0,91035	0,42%	-0,64%	0,9118	0,9132	0,9161
EUR/JPY	124,69	0,03%	0,41%	124,69	124,69	124,69
EUR/CHF	1,0787	0,01%	0,21%	1,0780	1,0773	1,0759
EUR/BRL	6,5706	0,46%	-3,90%	6,6045	6,6365	6,7426
EUR/PLN	4,4888	-0,15%	-0,79%	4,4972	4,5052	4,5230



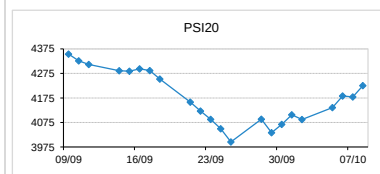
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1765	0,9104	124,69	1,0787	10,4293	7,4424	1,5545	1,64282	6,5706	10,9077
USD	0,8512	-	0,7734	106,015	0,9179	8,8805	6,3348	1,3224	1,3973	5,6110	9,2862

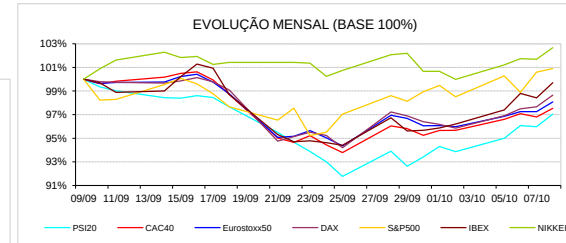
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,878	-0,67	-31,73
BCP	0,083	3,09	-58,93
CORT. AMORIM	10,480	-1,32	-7,26
CTT	2,610	-0,95	-18,18
EDP	4,388	1,57	16,19
EDP R	15,500	2,24	47,62
GALP	8,492	2,68	-43,01
IBERSOL	4,370	-0,68	-45,38
J MARTINS	14,220	-0,04	-3,03
MOTA ENGIL	1,260	4,65	-32,62
NAVIGATOR	2,128	-0,09	-38,29
NOS	3,110	0,32	-35,21
PHAROL	0,104	0,97	4,62
RAMADA	3,030	0,00	-48,12
REN	2,400	0,84	-11,76
SEMAPA	7,500	1,08	-45,34
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,571	-0,17	-37,25

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	4,65
BCP	3,09
GALP	2,68
EDP R	2,24
EDP	1,57
SONAE SGPS	-0,17
ALTRI	-0,67
IBERSOL	-0,68
CTT	-0,95
CORT. AMORIM	-1,32



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.225,01	1,10%	-18,97%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.918,56	0,75%	-17,72%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.260,94	0,85%	-12,93%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.058,93	1,01%	-1,43%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.429,83	0,29%	6,14%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.999,50	1,29%	-26,70%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.647,07	0,96%	-0,04%	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.