

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

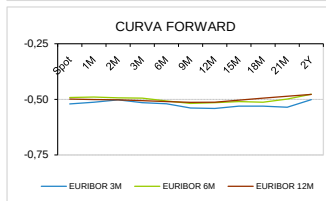
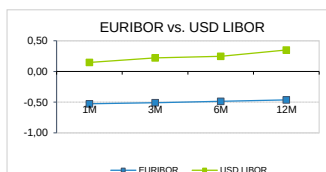
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

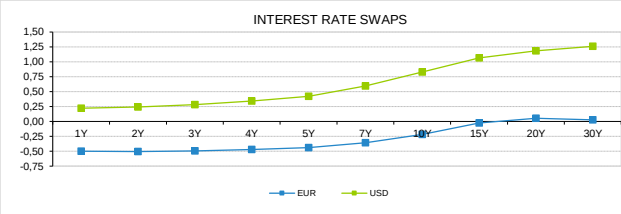
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5260	1	-1	1M	0,1469	0	-1	0,0484	-0,7970
3M	-0,5090	0	-2	3M	0,2205	-1	-3	0,0521	-0,7600
6M	-0,4860	0	-2	6M	0,2464	0	-5	0,0749	-0,7202
12M	-0,4630	-1	-6	12M	0,3495	0	-8	0,1513	-0,5998

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4986	0	-3	-0,5131	-0,3994	-0,2146
2Y	-0,5055	0	-4	-0,4954	-0,3545	-0,1589
3Y	-0,4948	0	-4	-0,4644	-0,3270	-0,1075
4Y	-0,4710	0	-4	-0,4256	-0,2563	-0,0603
5Y	-0,4380	0	-3	-0,3833	-0,2056	-0,0005
7Y	-0,3565	0	-3	-0,2884	-0,1028	0,0827
10Y	-0,2170	1	-3	-0,1429	0,0249	0,1722
15Y	-0,0264	1	-3	0,0226	0,1272	0,2102
20Y	0,0530	1	-3	0,0779	0,1333	0,1720
30Y	0,0275	1	-3	0,0330	0,0544	0,0657

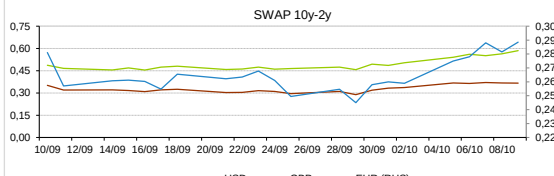
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2218	0	-2	0,2577	0,5165	0,9365
2Y	0,2431	0	1	0,3056	0,6235	1,0290
3Y	0,2813	1	4	0,3662	0,7085	1,0650
4Y	0,3421	1	6	0,4634	0,8225	1,1855
5Y	0,4210	1	8	0,5575	0,9100	1,2463
7Y	0,5958	2	10	0,7130	1,0590	1,3270
10Y	0,8283	3	13	0,9475	1,2020	1,3970
15Y	1,0653	4	16	1,1430	1,2965	1,4030
20Y	1,1855	4	17	1,2390	1,3240	1,4510
30Y	1,2599	5	19	1,2530	1,3575	1,3575

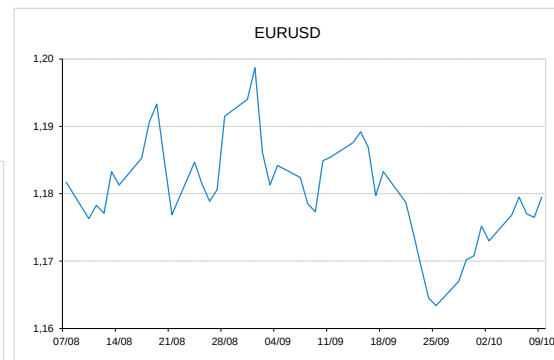
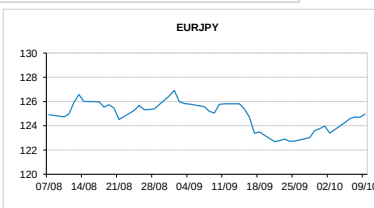
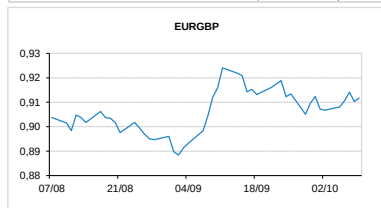


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,26	-0,08	1,92	OT 2Y	-0,596	0,00	-4,20
JETFUEL	346,68	8,28	49,84	OT 5Y	-0,306	-0,01	-13,00
DIESEL	351,43	9,55	28,84	OT 10Y	0,183	-0,02	-17,90
COBRE	6.669,50	4,00	15,00	BUND 10Y	-1,044	-1,22	-6,60
ZINCO	2.346,50	8,75	-55,25	SCHATZ 2Y	-0,144	-1,14	-1,40
OURO	1.922,12	36,74	-26,27	T-NOTE 10Y	1,743	0,14	3,70
TRIGO	600,75	5,50	57,00	T-NOTE 2Y	0,743	0,37	1,20
LICENÇA C02	25,75	-0,59	-1,45	GILT 10Y	0,381	-1,72	3,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1795	0,26%	0,19%	1,1820	1,1843	1,1892
EUR/GBP	0,91167	-0,14%	0,05%	0,9131	0,9145	0,9174
EUR/JPY	124,95	-0,21%	0,08%	124,95	124,95	124,95
EUR/CHF	1,0761	0,25%	0,20%	1,0753	1,0746	1,0733
EUR/BRL	6,5202	0,98%	-3,92%	6,5594	6,5946	6,6979
EUR/PLN	4,4653	0,56%	-0,56%	4,4738	4,4818	4,4993



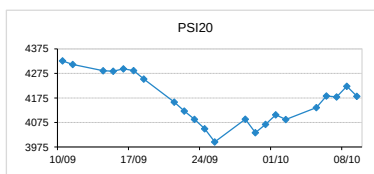
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1795	0,9117	124,95	1,0761	10,3953	7,4424	1,5506	1,6336	6,5202	10,8181
USD	0,8464	-	0,7693	105,655	0,9116	8,7896	6,2990	1,3135	1,3834	5,5266	9,1564

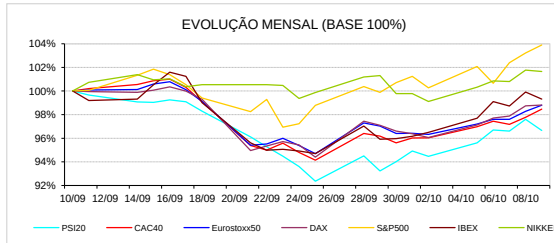
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,850	-0,57	-32,22
BCP	0,082	-1,68	-59,57
CORT. AMORIM	10,400	-0,38	-7,96
CTT	2,565	-1,72	-19,59
EDP	4,372	-0,41	15,77
EDP R	15,140	-2,45	44,19
GALP	8,422	-0,82	-43,48
IBERSOL	4,370	0,00	-45,38
J MARTINS	14,490	2,11	-1,19
MOTA ENGIL	1,156	-8,25	-38,18
NAVIGATOR	2,086	-1,60	-39,51
NOS	3,058	-1,35	-36,29
PHAROL	0,103	-1,15	3,41
RAMADA	3,060	0,99	-47,60
REN	2,390	-0,42	-12,13
SEMAPA	7,300	-2,28	-46,79
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,562	-1,58	-38,24

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
J MARTINS	2,11
RAMADA	0,99
BCP	-1,68
CTT	-1,72
SEMAPA	-2,28
EDP R	-2,45
MOTA ENGIL	-8,25



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.181,73	-0,96%	-19,80%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.946,81	0,71%	-17,25%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.273,12	0,53%	-12,60%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.051,23	0,07%	-1,49%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.469,34	0,65%	7,39%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.950,90	-0,60%	-27,21%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.619,69	-0,12%	-0,16%	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.