

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

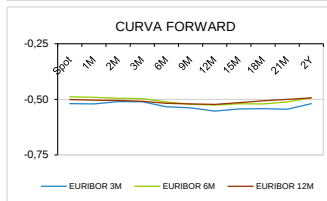
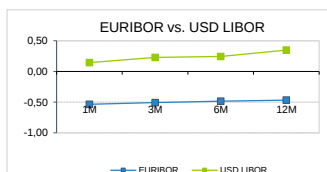
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

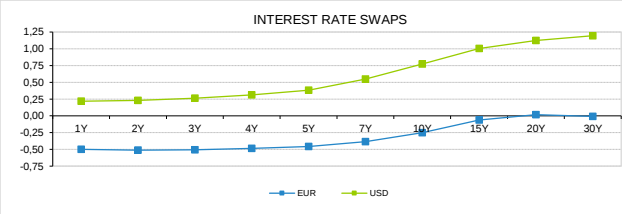
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5350	0	-2	1M	0,1443	0	-1	0,0429	-0,7964
3M	-0,5080	0	-2	3M	0,2289	0	-2	0,0461	-0,7608
6M	-0,4830	0	-3	6M	0,2429	0	-4	0,0715	-0,7220
12M	-0,4670	0	-7	12M	0,3476	0	-7	0,1453	-0,6008

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,4996	0	-3	-0,5229	-0,4269	-0,2539
2Y	-0,5117	0	-4	-0,5082	-0,3863	-0,2024
3Y	-0,5055	-1	-4	-0,4810	-0,3419	-0,1500
4Y	-0,4855	-1	-4	-0,4472	-0,2936	-0,0994
5Y	-0,4577	-1	-4	-0,4083	-0,2442	-0,0474
7Y	-0,3840	-2	-4	-0,3190	-0,1437	0,0418
10Y	-0,2512	-2	-4	-0,1783	-0,0127	0,1337
15Y	-0,0620	-2	-4	-0,0124	0,0895	0,1758
20Y	0,0175	-2	-4	0,0433	0,0965	0,1380
30Y	-0,0075	-2	-3	0,0022	0,0225	0,0348

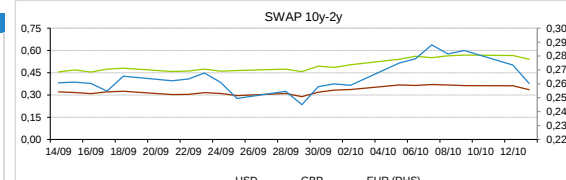
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2181	0	-1	0,2410	0,4520	0,8821
2Y	0,2311	-1	2	0,2829	0,5669	0,9692
3Y	0,2620	-1	4	0,3449	0,6570	1,0470
4Y	0,3131	-2	5	0,4240	0,7560	1,1120
5Y	0,3829	-3	6	0,5148	0,8340	1,1776
7Y	0,5480	-3	8	0,6840	0,9705	1,2310
10Y	0,7722	-3	10	0,8957	1,1135	1,3380
15Y	1,0045	-4	12	1,0660	1,2640	1,3964
20Y	1,1229	-3	14	1,1630	1,2785	1,3780
30Y	1,1948	-3	15	1,2185	1,2870	1,3330

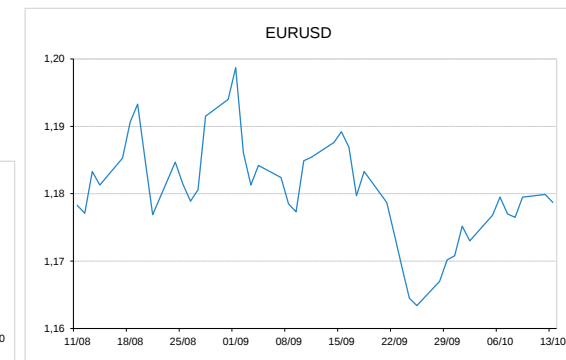
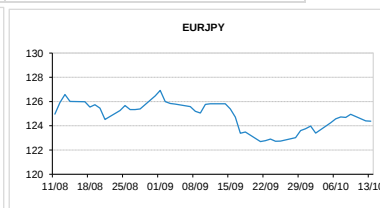
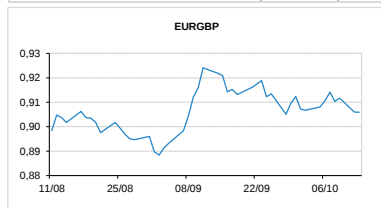


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,50	0,78	2,07	OT 2Y	-0,585	0,00	-2,00
JETFUEL	333,75	-9,47	28,75	OT 5Y	-0,326	-0,01	-12,50
DIESEL	340,25	-9,39	15,25	OT 10Y	0,146	-0,01	-18,40
COBRE	6.738,00	-25,50	-1,50	BUND 10Y	-1,068	-1,42	-7,10
ZINCO	2.423,50	5,50	-34,00	SCHATZ 2Y	-0,156	-0,68	-2,60
OURO	1.892,05	-32,89	-48,50	T-NOTE 10Y	1,722	-2,11	4,00
TRIGO	595,00	0,75	53,00	T-NOTE 2Y	0,735	-1,11	2,20
LICENÇA C02	25,40	-0,47	-2,86	GILT 10Y	0,348	-3,26	6,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1787	-0,10%	-0,75%	1,1813	1,1836	1,1884
EUR/GBP	0,90591	0,01%	1,77%	0,9073	0,9087	0,9116
EUR/JPY	124,38	0,02%	1,16%	124,38	124,38	124,38
EUR/CHF	1,0739	0,01%	0,29%	1,0732	1,0725	1,0712
EUR/BRL	6,5685	-0,34%	-4,76%	6,6003	6,6332	6,7367
EUR/PLN	4,4949	-0,58%	-1,09%	4,5033	4,5113	4,5283



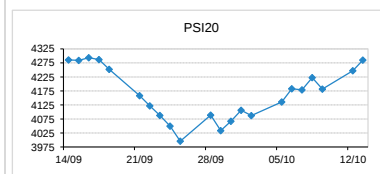
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1787	0,9059	124,38	1,0739	10,3511	7,4429	1,5423	1,63845	6,5685	10,8192
USD	0,8516	-	0,7702	105,535	0,9139	8,8055	6,3390	1,3140	1,3955	5,5875	9,2142

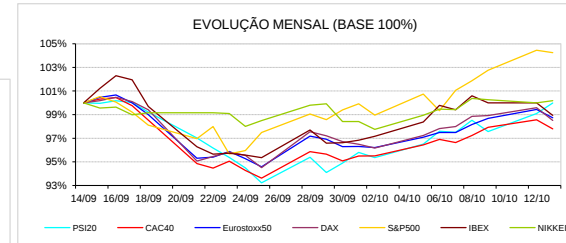
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,772	-0,58	-33,59
BCP	0,080	-1,12	-60,80
CORT. AMORIM	10,660	-0,37	-5,66
CTT	2,495	-1,96	-21,79
EDP	4,646	3,20	23,03
EDP R	16,800	3,19	60,00
GALP	8,236	-0,51	-44,72
IBERSOL	4,460	1,13	-44,25
J MARTINS	14,980	1,42	2,15
MOTA ENGIL	1,148	-2,38	-38,61
NAVIGATOR	2,070	-1,33	-39,97
NOS	3,074	0,39	-35,96
PHAROL	0,102	0,20	2,61
RAMADA	2,970	-0,34	-49,14
REN	2,445	0,62	-10,11
SEMAPA	7,170	-0,83	-47,74
SONAE CAP.	0,700	0,00	-7,04
SONAE SGPS	0,552	0,00	-39,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
EDP	3,20
EDP R	3,19
J MARTINS	1,42
IBERSOL	1,13
REN	0,62
SEMAPA	-0,83
BCP	-1,12
NAVIGATOR	-1,33
CTT	-1,96
MOTA ENGIL	-2,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.285,33	0,90%	-17,81%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.940,64	-0,78%	-17,35%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.274,63	-0,71%	-12,56%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.996,88	-1,08%	-1,90%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.526,77	-0,20%	9,17%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.876,80	-1,07%	-27,99%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.601,78	0,18%	-0,23%	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.