

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

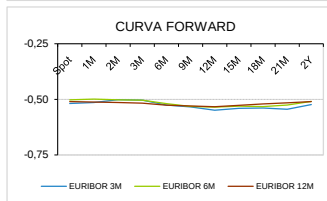
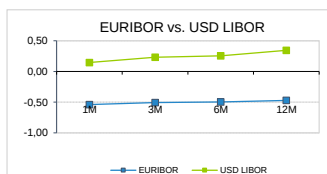
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

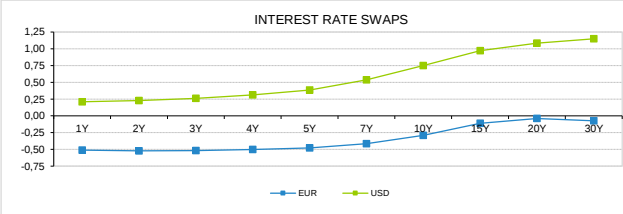
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5390	0	-2	1M	0,1458	0	-1	0,0430	-0,8014
3M	-0,5070	0	-2	3M	0,2301	-1	-1	0,0456	-0,7700
6M	-0,4970	0	-4	6M	0,2533	0	-2	0,0763	-0,7272
12M	-0,4720	0	-6	12M	0,3440	0	-6	0,1289	-0,6040

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5100	0	-4	-0,5350	-0,4585	-0,3018
2Y	-0,5217	0	-5	-0,5221	-0,4250	-0,2570
3Y	-0,5180	-1	-6	-0,5001	-0,3846	-0,2092
4Y	-0,5020	-1	-6	-0,4716	-0,3405	-0,1597
5Y	-0,4793	-1	-7	-0,4375	-0,2949	-0,1080
7Y	-0,4143	-2	-7	-0,3591	-0,1993	-0,0233
10Y	-0,2912	-2	-8	-0,2263	-0,0737	0,0662
15Y	-0,1118	-3	-9	-0,0668	0,0259	0,1003
20Y	-0,0397	-3	-10	-0,0189	0,0273	0,0603
30Y	-0,0727	-4	-10	-0,0695	-0,0560	-0,0483

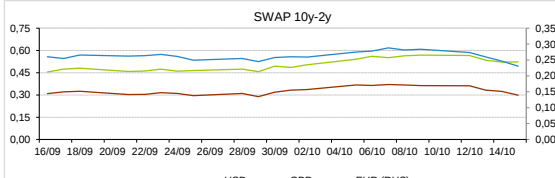
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,25
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2101	0	-3	0,2426	0,4670	0,8300
2Y	0,2280	0	1	0,2810	0,5590	0,9120
3Y	0,2600	0	3	0,3420	0,6470	0,9960
4Y	0,3125	0	4	0,4200	0,7340	1,0755
5Y	0,3837	1	5	0,5000	0,8180	1,1309
7Y	0,5371	0	6	0,6630	0,9285	1,1975
10Y	0,7503	0	6	0,8570	1,0870	1,2660
15Y	0,9706	-1	6	1,0400	1,2010	1,3401
20Y	1,0835	-1	7	1,1190	1,2543	1,3407
30Y	1,1486	-1	7	1,1690	1,2130	1,2505

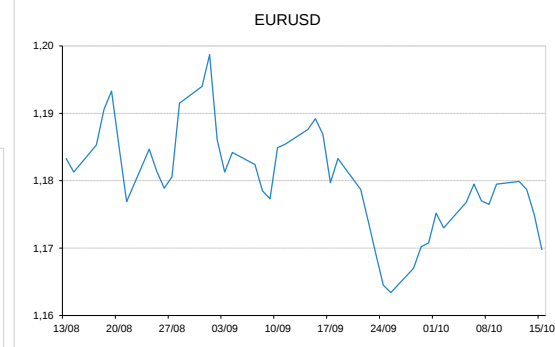
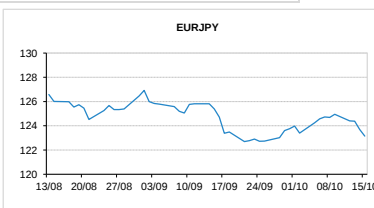
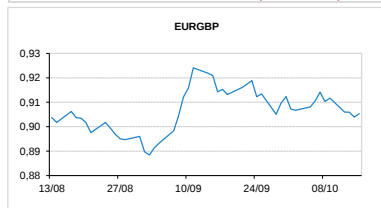


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,57	-0,75	1,42	OT 2Y	-0,589	0,00	-2,90
JETFUEL	346,59	7,84	43,34	OT 5Y	-0,330	0,01	-10,50
DIESEL	348,75	7,25	26,00	OT 10Y	0,145	0,01	-15,30
COBRE	6.714,50	24,00	-80,00	BUND 10Y	-1,126	-3,55	-12,70
ZINCO	2.401,25	1,25	-64,00	SCHATZ 2Y	-0,190	-2,28	-6,20
OURO	1.905,14	3,80	-52,96	T-NOTE 10Y	1,711	-0,42	2,10
TRIGO	611,00	14,25	72,75	T-NOTE 2Y	0,730	-0,37	0,40
LICENÇA C02	25,07	-0,68	-4,72	GILT 10Y	0,281	-4,94	-4,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1698	-0,44%	-1,63%	1,1723	1,1746	1,1795
EUR/GBP	0,90535	-0,15%	1,72%	0,9068	0,9082	0,9111
EUR/JPY	123,15	0,45%	1,82%	123,15	123,15	123,15
EUR/CHF	1,0697	0,29%	0,63%	1,0690	1,0684	1,0670
EUR/BRL	6,5692	-0,01%	-4,86%	6,5996	6,6341	6,7444
EUR/PLN	4,5513	-0,73%	-2,11%	4,5602	4,5683	4,5854



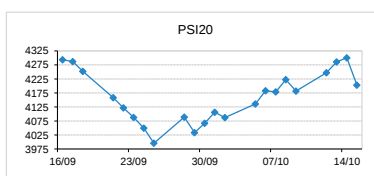
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1698	0,9054	123,15	1,0697	10,3808	7,4432	1,5501	1,65285	6,5692	10,9668
USD	0,8548	-	0,7751	105,285	0,9139	8,8770	6,3621	1,3247	1,4133	5,6130	9,3938

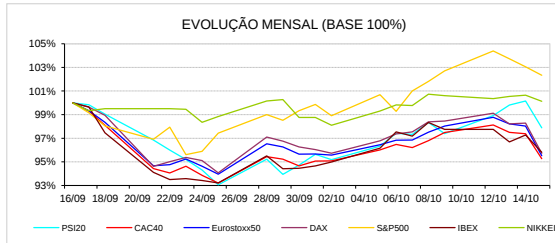
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,680	-2,28	-35,21
BCP	0,077	-2,79	-62,23
CORT. AMORIM	10,480	-1,87	-7,26
CTT	2,475	-1,00	-22,41
EDP	4,521	-3,97	19,72
EDP R	16,860	-2,54	60,57
GALP	8,052	-3,20	-45,96
IBERSOL	4,510	-0,66	-43,63
J MARTINS	14,435	-2,07	-1,57
MOTA ENGIL	1,092	-3,53	-41,60
NAVIGATOR	2,056	-0,10	-40,38
NOS	3,046	-0,20	-36,54
PHAROL	0,100	-2,91	0,60
RAMADA	3,040	0,66	-47,95
REN	2,405	-1,64	-11,58
SEMAPA	7,110	-0,56	-48,18
SONAE CAP.	0,700	-0,28	-7,04
SONAE SGPS	0,527	-2,22	-41,98

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	0,66
BCP	-2,79
PHAROL	-2,91
GALP	-3,20
MOTA ENGIL	-3,53
EDP	-3,97



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.202,72	-2,27%	-19,40%	5.454,21	3.500,02
CAC40	4.834,10	-2,18%	-19,14%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.189,47	-2,56%	-14,84%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	12.690,88	-2,61%	-4,24%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.465,08	-0,70%	7,23%	3.588,11	2.191,86
IBEX 35	6.813,20	-1,49%	-28,65%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	23.507,23	-0,51%	-0,63%	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.