

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

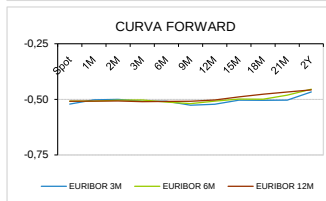
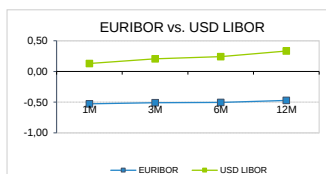
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

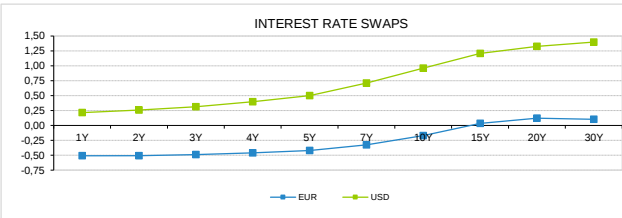
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5270	1	0	1M	0,1299	0	-2	0,0426	-0,8074
3M	-0,5100	1	0	3M	0,2050	0	-2	0,0429	-0,7760
6M	-0,5050	1	-2	6M	0,2418	0	0	0,0643	-0,7336
12M	-0,4720	1	-1	12M	0,3325	0	-2	0,1221	-0,6212

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5088	1	-1	-0,5030	-0,3672	-0,1537
2Y	-0,5063	1	0	-0,4804	-0,3154	-0,0948
3Y	-0,4901	1	1	-0,4424	-0,2631	-0,0381
4Y	-0,4590	1	2	-0,3978	-0,2038	0,0182
5Y	-0,4200	1	3	-0,3496	-0,1497	0,0700
7Y	-0,3257	2	4	-0,2432	-0,0381	0,1647
10Y	-0,1710	2	6	-0,0854	0,0998	0,2580
15Y	0,0345	2	8	0,0941	0,2099	0,2998
20Y	0,1215	2	9	0,1541	0,2194	0,2627
30Y	0,1030	2	9	0,1151	0,1411	0,1562

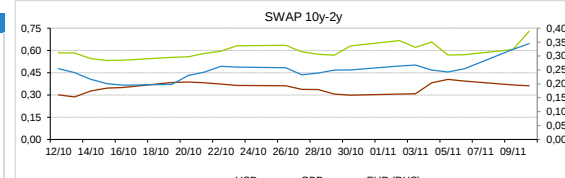
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2149	0	-1	0,2935	0,6557	1,1330
2Y	0,2586	0	2	0,3573	0,7770	1,2055
3Y	0,3137	0	4	0,4334	0,8915	1,2960
4Y	0,3981	0	6	0,5670	1,0010	1,3909
5Y	0,5013	-1	9	0,6590	1,0980	1,4485
7Y	0,7095	-1	13	0,8585	1,1960	1,4970
10Y	0,9613	-1	16	1,0970	1,3715	1,5635
15Y	1,2071	-2	17	1,2970	1,4770	1,6090
20Y	1,3257	-2	18	1,3405	1,5015	1,6050
30Y	1,3986	-2	17	1,4050	1,5150	1,5590

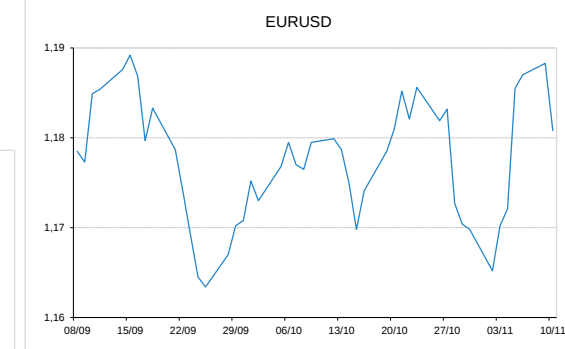
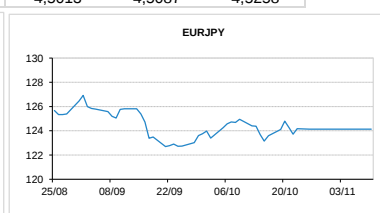


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	43,18	0,78	-0,14	OT 2Y	-0,598	0,00	-0,60
JETFUEL	354,08	23,87	10,86	OT 5Y	-0,367	0,00	-6,70
DIESEL	344,58	20,37	-5,06	OT 10Y	0,149	0,00	-3,30
COBRE	6.938,00	-30,50	153,00	BUND 10Y	-1,001	2,30	-5,20
ZINCO	2.626,50	4,60	202,00	SCHATZ 2Y	-0,130	1,37	-3,80
OURO	1.882,02	19,72	-48,38	T-NOTE 10Y	1,862	-0,14	9,10
TRIGO	605,00	7,50	11,25	T-NOTE 2Y	0,770	-0,19	2,70
LICENÇA C02	26,24	-0,31	0,53	GILT 10Y	0,505	2,00	9,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1808	-0,63%	0,08%	1,1834	1,1858	1,1907
EUR/GBP	0,89183	1,17%	1,59%	0,8932	0,8946	0,8975
EUR/JPY	124,36	0,25%	0,04%	124,36	124,36	124,36
EUR/CHF	1,0790	0,05%	-0,43%	1,0783	1,0776	1,0763
EUR/BRL	6,337	0,51%	3,50%	6,3683	6,4019	6,5169
EUR/PLN	4,4930	-0,36%	-0,72%	4,5013	4,5087	4,5258



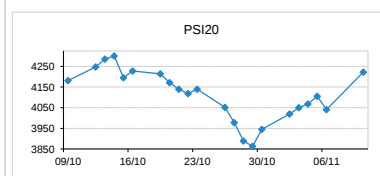
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1808	0,8918	124,36	1,0790	10,1764	7,4453	1,5354	1,62399	6,3370	10,6683
USD	0,8462	-	0,7547	105,22	0,9135	8,6147	6,3004	1,3020	1,3756	5,3552	9,0309

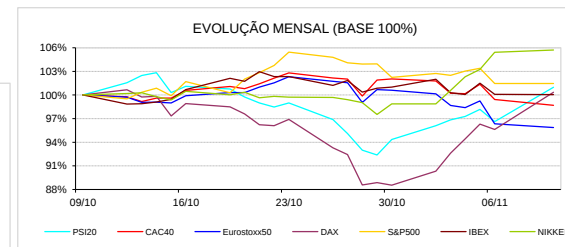
ACCIONISTA

TÍTULO	COTAÇÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,760	2,01	-33,80
BCP	0,094	4,31	-53,45
CORT. AMORIM	10,460	-2,06	-7,43
CTT	2,150	-1,38	-32,60
EDP	4,357	-1,47	15,37
EDP R	16,340	-1,57	55,62
GALP	8,874	7,43	-40,44
IBERSOL	4,350	4,07	-45,63
J MARTINS	13,990	-1,76	-4,60
MOTA ENGIL	1,184	-0,50	-36,68
NAVIGATOR	2,144	1,32	-37,83
NOS	3,060	3,24	-36,25
PHAROL	0,102	-0,59	2,21
RAMADA	3,270	0,31	-44,01
REN	2,275	-0,22	-16,36
SEMAPA	7,400	3,50	-46,06
SONAE CAP.	0,770	-0,26	2,26
SONAE SGPS	0,584	4,57	-35,82

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
GALP	7,43
SONAE SGPS	4,57
BCP	4,31
IBERSOL	4,07
SEMAPA	3,50
CTT	-1,38
EDP	-1,47
EDP R	-1,57
J MARTINS	-1,76
CORT. AMORIM	-2,06



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.264,82	1,00%	-18,21%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.418,97	1,55%	-9,35%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.442,62	1,02%	-8,08%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.163,11	0,51%	-0,65%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.545,64	-0,43%	9,42%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	7.711,40	3,38%	-19,25%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	24.905,59	0,26%	5,28%	25.279,94	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.