

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

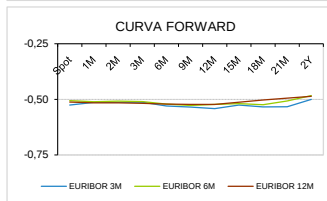
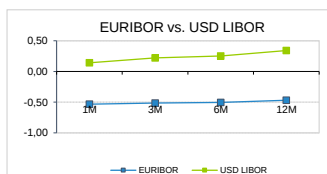
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

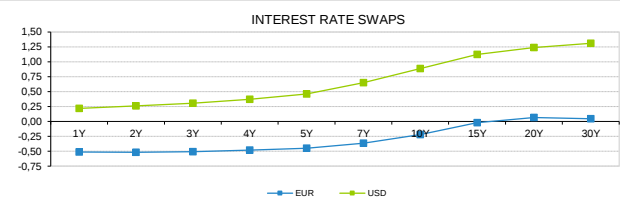
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5330	1	0	1M	0,1409	0	0	0,0420	-0,8062
3M	-0,5140	0	-1	3M	0,2210	0	-1	0,0429	-0,7678
6M	-0,5030	0	-2	6M	0,2514	1	1	0,0678	-0,7258
12M	-0,4690	0	0	12M	0,3405	0	-1	0,1375	-0,6108

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5128	0	-1	-0,5244	-0,4100	-0,2198
2Y	-0,5175	-1	-1	-0,5045	-0,3645	-0,1635
3Y	-0,5066	-1	0	-0,4725	-0,3160	-0,1100
4Y	-0,4819	-1	0	-0,4335	-0,2630	-0,0560
5Y	-0,4486	0	1	-0,3905	-0,2110	0,0027
7Y	-0,3657	-1	2	-0,2935	-0,1030	0,0928
10Y	-0,2220	-1	3	-0,1425	0,0320	0,1890
15Y	-0,0203	-1	4	0,0335	0,1435	0,2337
20Y	0,0656	-1	5	0,0943	0,1544	0,1987
30Y	0,0457	-1	5	0,0547	0,0775	0,0906

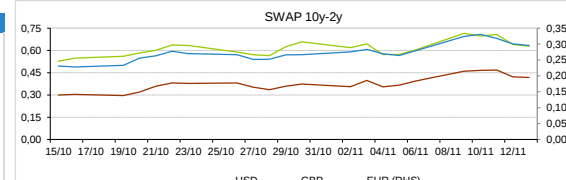
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2185	0	0	0,2928	0,5732	1,0437
2Y	0,2597	0	3	0,3447	0,6928	1,1170
3Y	0,3054	0	4	0,4190	0,8064	1,1955
4Y	0,3724	0	6	0,5159	0,9096	1,2734
5Y	0,4596	0	8	0,6150	0,9910	1,3303
7Y	0,6499	-1	11	0,7935	1,1100	1,3940
10Y	0,8882	-1	12	1,0221	1,2828	1,4580
15Y	1,1243	-2	13	1,2010	1,3916	1,4980
20Y	1,2399	-2	12	1,3016	1,4160	1,4895
30Y	1,3111	-2	12	1,3210	1,4090	1,4520

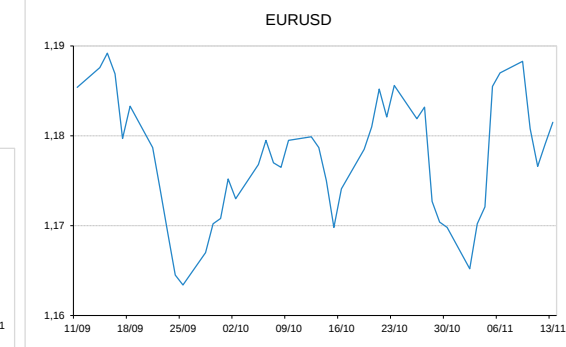
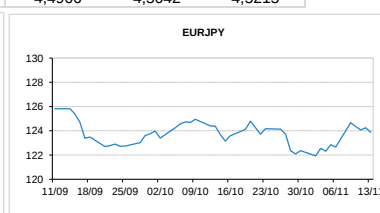


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	42,85	-0,68	-0,05	OT 2Y	-0,607	-0,01	-1,60
JETFUEL	362,00	-4,69	28,25	OT 5Y	-0,384	0,00	-4,20
DIESEL	351,75	-4,69	11,50	OT 10Y	0,088	-0,02	-4,30
COBRE	6.916,00	49,00	196,50	BUND 10Y	-1,063	-1,35	2,70
ZINCO	2.610,25	2,50	180,75	SCHATZ 2Y	-0,146	-0,69	2,10
OURO	1.892,25	14,75	0,84	T-NOTE 10Y	1,815	0,42	10,00
TRIGO	599,25	2,00	2,00	T-NOTE 2Y	0,770	0,19	3,70
LICENÇA C02	26,27	0,35	1,05	GILT 10Y	0,443	-1,82	11,30



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1815	0,20%	0,24%	1,1842	1,1866	1,1916
EUR/GBP	0,89683	0,09%	1,01%	0,8982	0,8996	0,9025
EUR/JPY	123,88	0,30%	0,40%	123,88	123,88	123,88
EUR/CHF	1,0798	0,02%	-0,50%	1,0791	1,0784	1,0770
EUR/BRL	6,5226	-0,99%	0,51%	6,5542	6,5912	6,7184
EUR/PLN	4,4881	0,09%	0,16%	4,4966	4,5042	4,5215



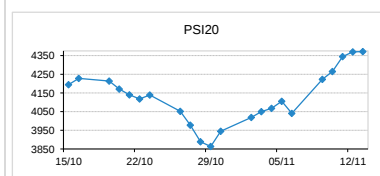
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1815	0,8968	123,88	1,0798	10,2818	7,4468	1,5566	1,63037	6,5226	10,8479
USD	0,8461	-	0,7601	104,635	0,9136	8,7043	6,2997	1,3164	1,3801	5,5188	9,1640

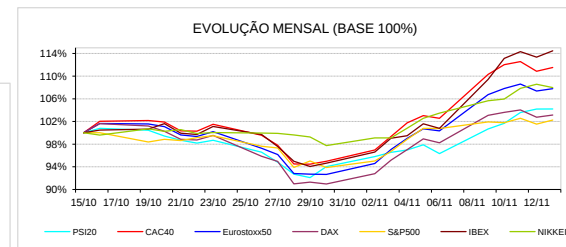
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	3,914	1,51	-31,34
BCP	0,100	5,61	-50,79
CORT. AMORIM	10,260	-0,97	-9,38
CTT	2,190	-0,23	-31,35
EDP	4,541	0,00	20,46
EDP R	17,400	-2,36	65,71
GALP	8,676	0,35	-41,81
IBERSOL	4,320	-0,23	-46,00
J MARTINS	14,160	-0,11	-3,14
MOTA ENGIL	1,242	0,65	-33,58
NAVIGATOR	2,210	1,94	-35,86
NOS	2,924	-0,48	-39,25
PHAROL	0,101	0,00	1,41
RAMADA	3,230	0,62	-44,69
REN	2,340	0,00	-13,97
SEMAPA	7,700	1,19	-44,31
SONAE CAP.	0,770	0,00	2,26
SONAE SGPS	0,620	-2,52	-32,03

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	5,61
NAVIGATOR	1,94
ALTRI	1,51
SEMAPA	1,19
MOTA ENGIL	0,65
IBERSOL	-0,23
NOS	-0,48
CORT. AMORIM	-0,97
EDP R	-2,36
SONAE SGPS	-2,52



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.372,74	0,03%	-16,16%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.391,34	0,59%	-9,76%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.432,07	0,39%	-8,11%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.099,57	0,38%	-1,11%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.560,20	0,69%	10,23%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	7.800,10	0,99%	-18,29%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	25.385,87	-0,53%	7,31%	25.587,96	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.