

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

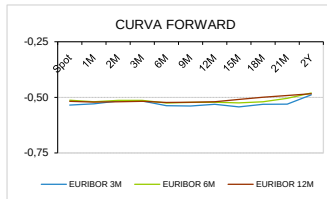
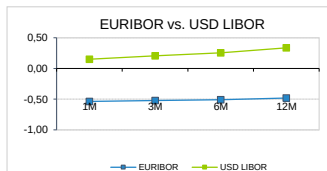
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

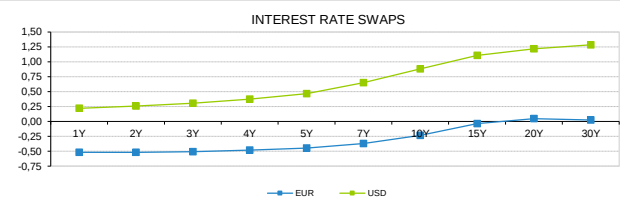
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5370	1	0	1M	0,1501	0	-1	0,0380	-0,8060
3M	-0,5230	0	-1	3M	0,2065	0	-1	0,0459	-0,7722
6M	-0,5100	0	-1	6M	0,2538	1	0	0,0639	-0,7260
12M	-0,4820	0	-2	12M	0,3356	0	0	0,1349	-0,6116

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5179	0	-1	-0,5214	-0,4086	-0,2350
2Y	-0,5189	0	0	-0,5020	-0,3624	-0,1823
3Y	-0,5065	1	0	-0,4706	-0,3190	-0,1295
4Y	-0,4815	1	1	-0,4319	-0,2718	-0,0767
5Y	-0,4482	1	1	-0,3922	-0,2221	-0,0210
7Y	-0,3710	1	1	-0,3016	-0,1189	0,0530
10Y	-0,2328	2	2	-0,1560	0,0140	0,1645
15Y	-0,0369	1	3	0,0153	0,1215	0,2079
20Y	0,0465	1	3	0,0736	0,1306	0,1730
30Y	0,0241	1	4	0,0332	0,0538	0,0644

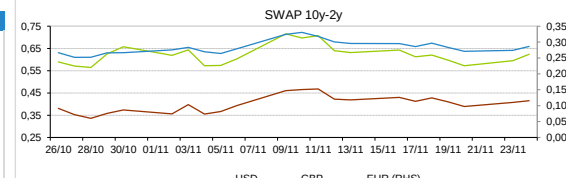
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2200	1	1	0,2908	0,5848	1,0479
2Y	0,2584	1	2	0,3470	0,7078	1,1110
3Y	0,3053	1	4	0,4141	0,8070	1,1520
4Y	0,3750	1	4	0,5259	0,9035	1,2530
5Y	0,4652	1	5	0,6185	0,9910	1,3185
7Y	0,6511	2	6	0,7890	1,1200	1,3490
10Y	0,8815	4	6	1,0160	1,2300	1,3905
15Y	1,1070	4	5	1,1650	1,3220	1,4760
20Y	1,2185	5	4	1,2680	1,3920	1,4760
30Y	1,2853	5	3	1,3222	1,3879	1,4294

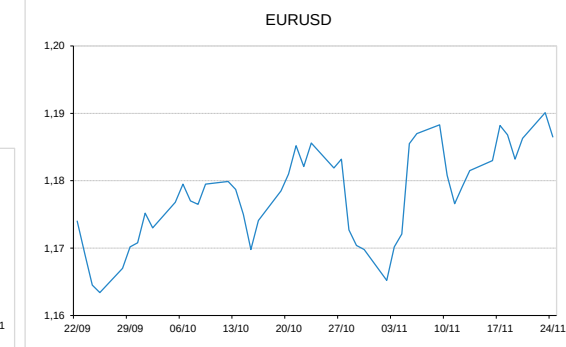
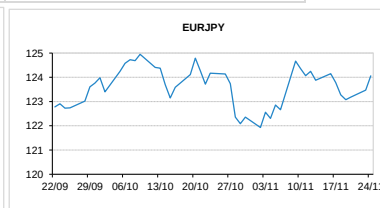
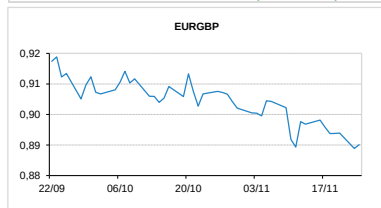


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	47,78	1,72	5,71	OT 2Y	-0,668	0,00	-11,80
JETFUEL	377,50	6,75	40,00	OT 5Y	-0,434	0,00	-12,00
DIESEL	371,50	7,25	37,75	OT 10Y	0,033	0,01	-14,10
COBRE	7.209,00	-100,00	310,00	BUND 10Y	-1,083	1,14	0,10
ZINCO	2.717,50	-68,25	163,50	SCHATZ 2Y	-0,153	0,46	2,10
OURO	1.803,20	-36,62	-98,85	T-NOTE 10Y	1,808	1,13	1,50
TRIGO	612,50	8,00	-20,00	T-NOTE 2Y	0,756	-0,19	0,80
LICENÇA C02	27,58	0,33	2,09	GILT 10Y	0,428	0,17	3,80



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1865	-0,30%	0,39%	1,1892	1,1916	1,1966
EUR/GBP	0,89012	-0,14%	1,96%	0,8915	0,8929	0,8959
EUR/JPY	124,06	-0,48%	0,06%	124,06	124,06	124,06
EUR/CHF	1,0831	-0,24%	-1,03%	1,0824	1,0817	1,0803
EUR/BRL	6,4031	0,48%	3,73%	6,4331	6,4718	6,6084
EUR/PLN	4,4614	0,22%	2,62%	4,4694	4,4767	4,4952



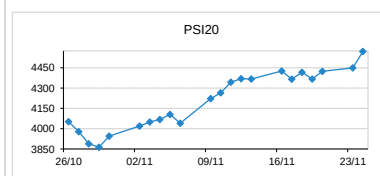
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1865	0,8901	124,06	1,0831	10,1766	7,4420	1,5471	1,6155	6,4031	10,5942
USD	0,8422	-	0,7488	104,665	0,9120	8,5721	6,2686	1,3038	1,3621	5,3852	8,9414

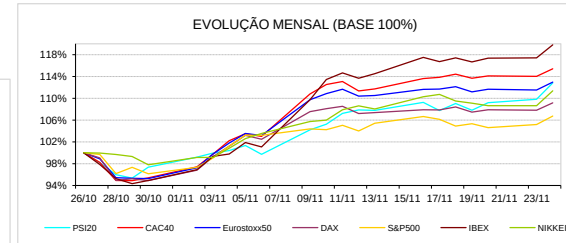
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,470	8,13	-21,30
BCP	0,120	6,03	-41,07
CORT. AMORIM	10,240	1,39	-9,38
CTT	2,410	0,63	-24,45
EDP	4,433	-1,09	17,39
EDP R	17,080	-2,84	62,67
GALP	9,816	6,74	-34,12
IBERSOL	4,450	3,73	-44,38
J MARTINS	13,945	-0,53	-4,91
MOTA ENGIL	1,444	2,85	-22,78
NAVIGATOR	2,406	4,25	-30,23
NOS	3,200	13,48	-33,33
PHAROL	0,112	2,39	12,05
RAMADA	3,560	2,59	-39,04
REN	2,265	1,80	-16,73
SEMAPA	8,780	5,53	-36,01
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,652	4,32	-28,41

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOS	13,48
ALTRI	8,13
GALP	6,74
BCP	6,03
SEMAPA	5,53
J MARTINS	-0,53
EDP	-1,09
EDP R	-2,84



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.571,02	2,73%	-12,33%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.558,42	1,21%	-7,02%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.507,98	1,30%	-6,33%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.292,44	1,26%	0,33%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.630,08	1,47%	12,36%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	8.143,20	2,03%	-14,72%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.165,59	2,50%	10,61%	26.261,78	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.