

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

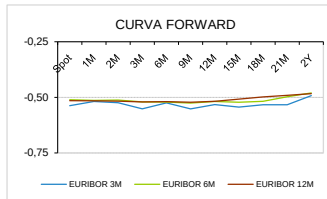
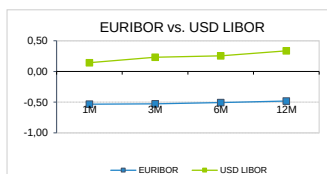
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

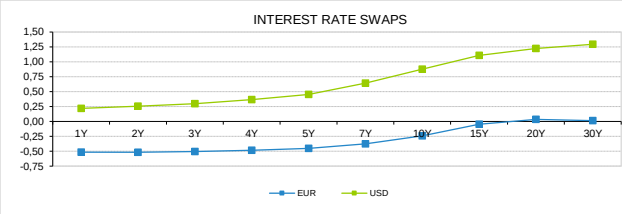
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5330	0	1	1M	0,1430	-1	-1	0,0391	-0,8040
3M	-0,5260	0	-1	3M	0,2323	3	2	0,0440	-0,7804
6M	-0,5080	0	-1	6M	0,2545	0	1	0,0628	-0,7306
12M	-0,4820	0	-2	12M	0,3356	0	0	0,1300	-0,6124

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5152	0	-1	-0,5196	-0,4161	-0,2414
2Y	-0,5170	0	0	-0,5007	-0,3739	-0,1909
3Y	-0,5055	0	0	-0,4720	-0,3296	-0,1388
4Y	-0,4830	0	0	-0,4367	-0,2820	-0,0880
5Y	-0,4525	-1	1	-0,3970	-0,2325	-0,0324
7Y	-0,3768	-1	1	-0,3080	-0,1296	0,0587
10Y	-0,2413	-1	1	-0,1640	0,0040	0,1536
15Y	-0,0473	-1	2	0,0052	0,1089	0,1967
20Y	0,0344	-1	2	0,0627	0,1182	0,1619
30Y	0,0122	-1	3	0,0225	0,0413	0,0540

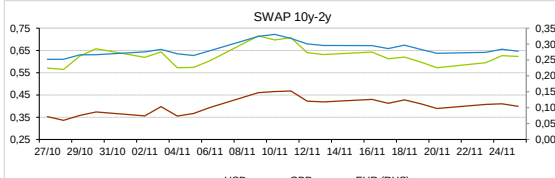
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2192	0	1	0,2817	0,5540	1,0135
2Y	0,2545	0	2	0,3343	0,6872	1,0935
3Y	0,2977	-1	3	0,4102	0,8023	1,1950
4Y	0,3649	-1	3	0,5096	0,8820	1,2654
5Y	0,4528	-1	4	0,5980	0,9914	1,3199
7Y	0,6416	-1	5	0,8012	1,1160	1,3600
10Y	0,8763	-1	5	0,9995	1,2355	1,4225
15Y	1,1087	0	5	1,1710	1,3660	1,4705
20Y	1,2240	0	5	1,2590	1,3825	1,4700
30Y	1,2944	0	4	1,3318	1,3940	1,4432

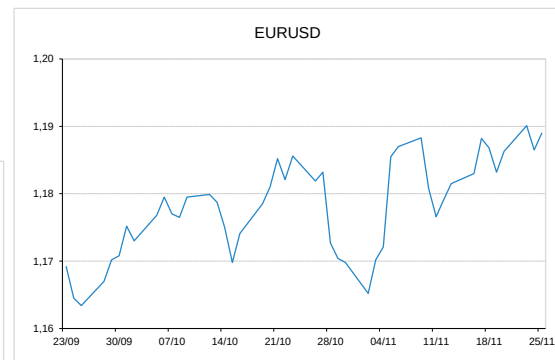
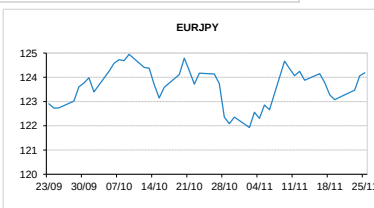
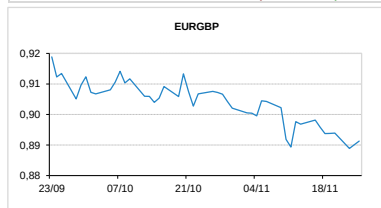


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	48,34	0,48	6,27	OT 2Y	-0,682	-0,01	-12,30
JETFUEL	396,00	18,50	58,50	OT 5Y	-0,449	-0,02	-11,20
DIESEL	388,75	17,25	55,00	OT 10Y	0,017	-0,02	-14,20
COBRE	7.309,00	115,50	425,50	BUND 10Y	-1,086	-0,20	-0,10
ZINCO	2.744,25	26,75	190,25	SCHATZ 2Y	-0,158	-0,23	1,40
OURO	1.811,25	6,21	-90,80	T-NOTE 10Y	1,793	-0,99	2,40
TRIGO	601,25	-16,25	-31,25	T-NOTE 2Y	0,748	-0,56	0,50
LICENÇA C02	27,77	0,14	2,28	GILT 10Y	0,418	-1,03	3,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,189	0,21%	0,60%	1,1918	1,1942	1,1992
EUR/GBP	0,89129	-0,13%	1,82%	0,8927	0,8941	0,8970
EUR/JPY	124,19	-0,10%	-0,04%	124,19	124,19	124,19
EUR/CHF	1,0825	0,08%	-0,96%	1,0818	1,0811	1,0797
EUR/BRL	6,3378	0,88%	4,79%	6,3675	6,4056	6,5387
EUR/PLN	4,4632	-0,05%	2,58%	4,4712	4,4786	4,4970



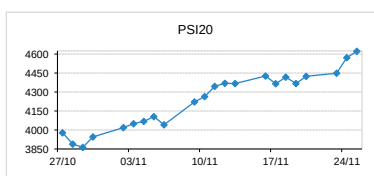
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1890	0,8913	124,19	1,0825	10,1473	7,4421	1,5483	1,61864	6,3378	10,5300
USD	0,8402	-	0,7474	104,395	0,9097	8,5322	6,2530	1,3010	1,3605	5,3390	8,8578

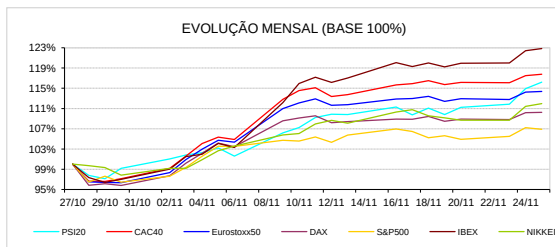
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	4,410	-1,34	-22,36
BCP	0,122	2,43	-39,64
CORT. AMORIM	10,380	1,37	-8,14
CTT	2,510	4,15	-21,32
EDP	4,506	1,65	19,32
EDP R	17,500	2,46	66,67
GALP	9,718	-1,00	-34,78
IBERSOL	4,650	4,49	-41,88
J MARTINS	14,170	1,61	-3,38
MOTA ENGIL	1,462	1,25	-21,82
NAVIGATOR	2,438	1,33	-29,30
NOS	3,124	-2,38	-34,92
PHAROL	0,111	-0,54	11,45
RAMADA	3,660	2,81	-37,33
REN	2,305	1,77	-15,26
SEMAPA	8,880	1,14	-35,28
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,674	3,45	-25,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	4,49
CTT	4,15
SONAE SGPS	3,45
RAMADA	2,81
EDP R	2,46
PHAROL	-0,54
GALP	-1,00
ALTRI	-1,34
NOS	-2,38



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.628,63	1,26%	-11,23%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.571,29	0,23%	-6,80%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.511,90	0,11%	-6,23%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.289,80	-0,02%	0,31%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.625,65	-0,27%	12,23%	3.645,99	2.191,86
IBEX 35	8.169,80	0,33%	-14,45%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.296,86	0,50%	11,16%	26.706,42	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.