

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

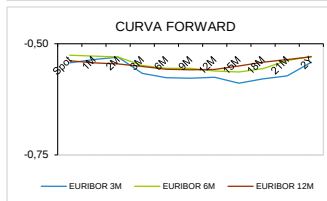
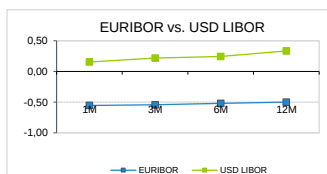
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

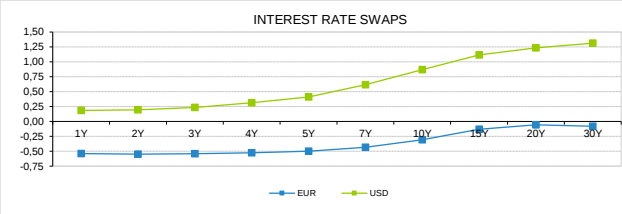
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5540	2	-2	1M	0,1539	1	1	0,0246	-0,8444
3M	-0,5430	0	-3	3M	0,2195	0	1	0,0384	-0,7918
6M	-0,5200	0	-1	6M	0,2448	-1	0	0,0359	-0,7432
12M	-0,4990	1	-3	12M	0,3345	0	0	0,1023	-0,6240

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5386	2	-3	-0,5593	-0,4739	-0,3142
2Y	-0,5487	0	-4	-0,5435	-0,4368	-0,2695
3Y	-0,5423	-1	-5	-0,5202	-0,3958	-0,2210
4Y	-0,5248	-1	-6	-0,4899	-0,3518	-0,1710
5Y	-0,4998	-2	-7	-0,4545	-0,3060	-0,1190
7Y	-0,4330	-2	-9	-0,3735	-0,2092	-0,0380
10Y	-0,3073	-3	-12	-0,2405	-0,0885	0,0480
15Y	-0,1315	-4	-15	-0,0835	0,0114	0,0879
20Y	-0,0567	-5	-16	-0,0309	0,0187	0,0543
30Y	-0,0822	-5	-17	-0,0757	-0,0609	-0,0532

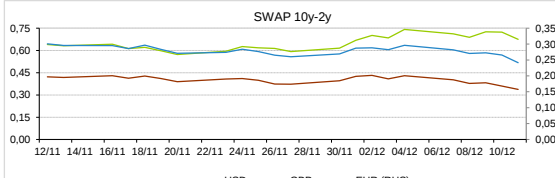
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



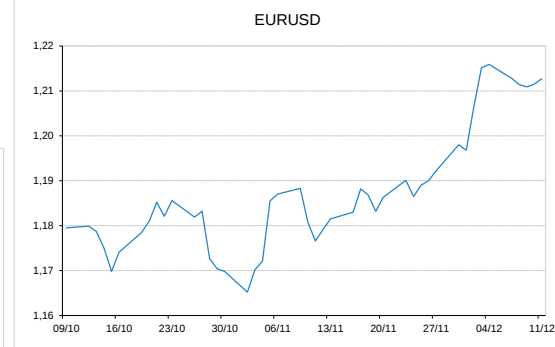
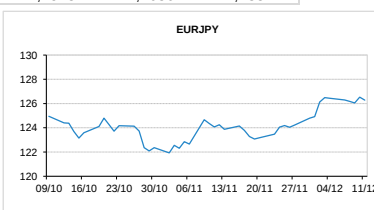
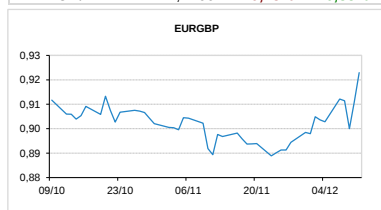
INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1845	-1	-3	0,2060	0,5310	1,0355
2Y	0,1944	-2	-7	0,2540	0,6700	1,1230
3Y	0,2343	-3	-8	0,3585	0,8028	1,2100
4Y	0,3144	-3	-9	0,4683	0,8925	1,2725
5Y	0,4108	-4	-10	0,5750	0,9970	1,3498
7Y	0,6166	-6	-10	0,7820	1,1295	1,4020
10Y	0,8692	-7	-10	0,9990	1,2700	1,4770
15Y	1,1149	-8	-10	1,1960	1,3820	1,5150
20Y	1,2344	-9	-10	1,2929	1,4220	1,5130
30Y	1,3127	-9	-8	1,3528	1,4332	1,4835



COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	49,94	-0,31	5,86	OT 2Y	-0,737	-0,02	-13,70
JETFUEL	429,00	11,45	60,87	OT 5Y	-0,489	-0,02	-11,30
DIESEL	415,75	10,45	58,87	OT 10Y	-0,038	-0,02	-16,40
COBRE	7.873,00	155,00	946,00	BUND 10Y	-1,308	-3,62	-13,80
ZINCO	2.837,75	8,25	202,75	SCHATZ 2Y	-0,197	-1,60	-4,80
OURO	1.842,03	11,26	-20,41	T-NOTE 10Y	1,810	-2,55	-8,90
TRIGO	614,50	18,00	8,50	T-NOTE 2Y	0,715	-2,03	-6,80
LICENÇA C02	30,59	-0,31	4,46	GILT 10Y	0,358	-2,74	-24,10


CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2127	0,10%	3,07%	1,2157	1,2182	1,2233
EUR/GBP	0,92294	-1,29%	-3,64%	0,9243	0,9258	0,9287
EUR/JPY	126,28	0,20%	-1,75%	126,28	126,28	126,28
EUR/CHF	1,0785	-0,21%	0,14%	1,0778	1,0770	1,0757
EUR/BRL	6,1177	-0,37%	3,99%	6,1479	6,1839	6,3022
EUR/PLN	4,4460	-0,45%	0,85%	4,4543	4,4636	4,4837

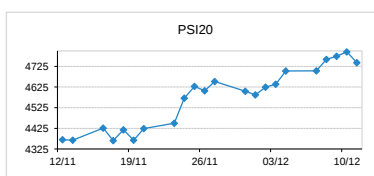

FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2127	0,9229	126,28	1,0785	10,2630	7,4422	1,5469	1,60781	6,1177	10,6876
USD	0,8259	-	0,7565	103,945	0,8908	8,4733	6,1466	1,2776	1,3272	5,0627	8,8192

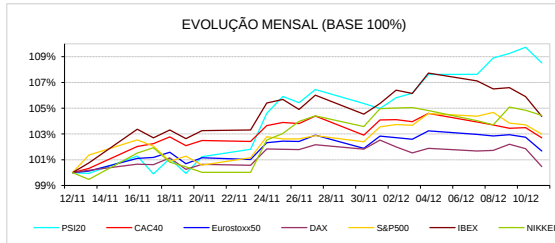
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,205	-0,67	-8,36
BCP	0,123	-2,84	-39,35
CORT. AMORIM	10,440	0,38	-7,61
CTT	2,470	-1,98	-22,57
EDP	4,760	-0,10	26,04
EDP R	18,500	-0,22	76,19
GALP	9,056	-2,73	-39,22
IBERSOL	5,420	1,88	-32,25
J MARTINS	14,645	0,21	-0,14
MOTA ENGIL	1,388	-1,14	-25,78
NAVIGATOR	2,470	-1,20	-24,28
NOS	3,102	-2,94	-35,38
PHAROL	0,151	5,61	51,20
RAMADA	4,620	10,00	-20,89
REN	2,355	0,00	-13,42
SEMAPA	9,520	-2,06	-30,61
SONAE CAP.	#N/A Real	#N/A	2,26
SONAE SGPS	0,687	-2,83	-24,51

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
RAMADA	10,00
PHAROL	5,61
IBERSOL	1,88
CORT. AMORIM	0,38
J MARTINS	0,21
SEMAPA	-2,06
GALP	-2,73
SONAE SGPS	-2,83
BCP	-2,84
NOS	-2,94



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.742,67	-1,10%	-9,04%	5.454,21	3.500,02
CAC40	5.507,55	-0,76%	-7,87%	6.111,41	3.632,06
ESTX 50 PR	3.485,84	-1,04%	-6,92%	3.867,28	2.302,84
XTRA DAX	13.114,30	-1,36%	-1,02%	13.795,24	8.255,65
S&P 500	3.642,72	-0,69%	12,75%	3.712,39	2.191,86
IBEX 35	8.063,10	-1,46%	-15,56%	10.100,20	5.814,50
NIKKEI 225	26.652,52	-0,39%	12,66%	26.894,25	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.