

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

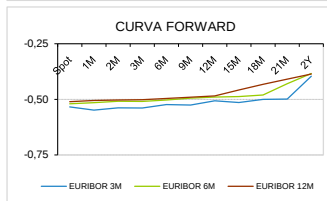
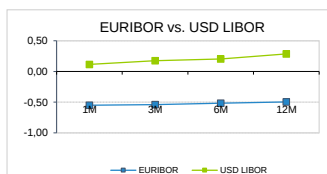
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

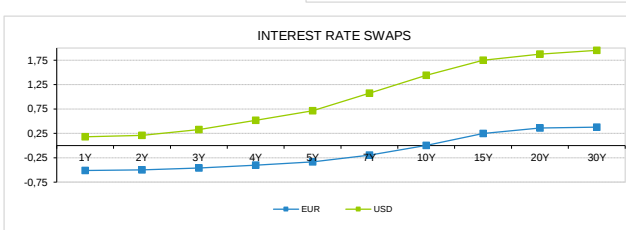
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,5500	0	1	1M	0,1149	0	-1	0,0395	-0,7928
3M	-0,5400	0	0	3M	0,1755	0	-4	0,0601	-0,7538
6M	-0,5170	0	1	6M	0,2040	1	-3	0,0789	-0,7048
12M	-0,4960	0	0	12M	0,2855	0	-3	0,1301	-0,5892

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5109	0	2	-0,4850	-0,2285	0,0690
2Y	-0,4975	0	3	-0,4356	-0,1501	0,1413
3Y	-0,4600	0	5	-0,3667	-0,0791	0,2093
4Y	-0,4015	1	8	-0,2944	-0,0053	0,2748
5Y	-0,3355	1	11	-0,2215	0,0646	0,3400
7Y	-0,1970	1	17	-0,0779	0,1952	0,4356
10Y	0,0020	1	23	0,1140	0,3535	0,5394
15Y	0,2480	1	28	0,3287	0,4829	0,5961
20Y	0,3615	1	30	0,4114	0,5080	0,5710
30Y	0,3775	1	32	0,3990	0,4473	0,4754

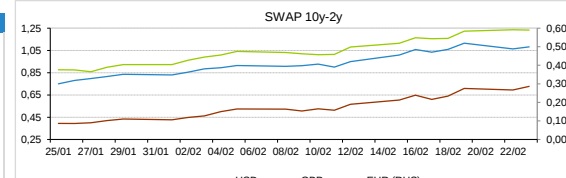
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,00
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,1801	1	-1	0,2369	1,0570	1,8792
2Y	0,2075	0	1	0,3986	1,2910	2,0014
3Y	0,3284	0	7	0,6276	1,4906	2,0954
4Y	0,5173	-1	14	0,8448	1,6472	2,1643
5Y	0,7151	-1	21	1,0415	1,7540	2,2203
7Y	1,0726	-1	30	1,3646	1,9444	2,2480
10Y	1,4399	0	37	1,6490	2,0836	2,3070
15Y	1,7477	1	39	1,8923	2,1755	2,2960
20Y	1,8735	1	39	1,9590	2,1847	2,3075
30Y	1,9529	2	39	1,9885	2,1500	2,2080

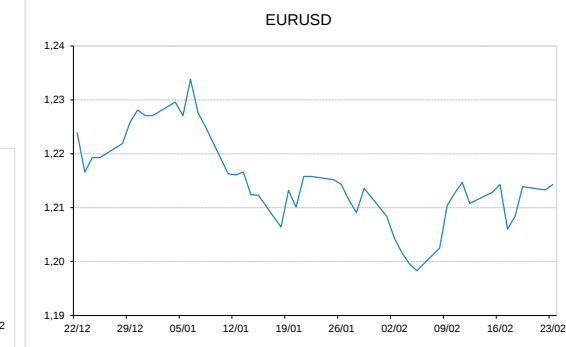
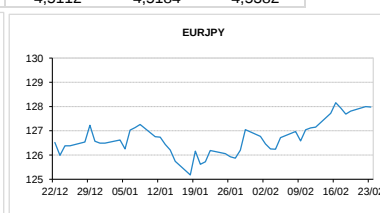


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	65,33	0,09	10,08	OT 2Y	-0,574	-0,01	6,70
JETFUEL	544,50	14,00	82,50	OT 5Y	-0,208	0,02	19,70
DIESEL	534,00	14,00	84,25	OT 10Y	0,256	0,04	18,50
COBRE	9.113,50	187,50	1.099,50	BUND 10Y	-1,020	2,84	19,10
ZINCO	2.888,25	18,50	178,75	SCHATZ 2Y	-0,098	0,46	2,60
OURO	1.806,74	-2,52	-48,87	T-NOTE 10Y	2,059	-1,16	14,50
TRIGO	664,75	-5,00	28,75	T-NOTE 2Y	0,704	-0,18	-0,90
LICENÇA C02	38,57	0,61	4,33	GILT 10Y	0,879	3,60	38,40



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,2143	0,08%	-0,07%	1,2166	1,2189	1,2241
EUR/GBP	0,86308	0,26%	2,89%	0,8644	0,8659	0,8688
EUR/JPY	127,98	0,02%	-1,50%	127,98	127,98	127,98
EUR/CHF	1,0961	-0,63%	-1,61%	1,0955	1,0948	1,0936
EUR/BRL	6,5955	0,60%	0,62%	6,6291	6,6802	6,8326
EUR/PLN	4,5062	-0,23%	0,79%	4,5112	4,5184	4,5382



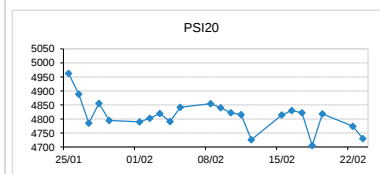
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,2143	0,8631	127,98	1,0961	10,0792	7,4365	1,5315	1,53704	6,5955	10,3179
USD	0,8226	-	0,709	105,115	0,9005	8,2913	6,1175	1,2600	1,2648	5,4230	8,4840

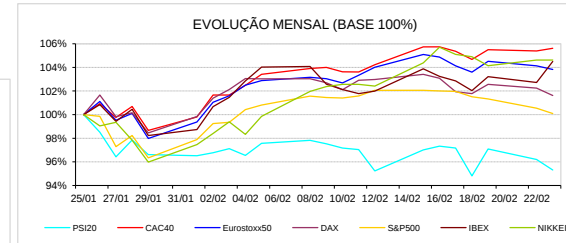
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,025	-1,63	16,76
BCP	0,119	-2,93	-3,33
CORT. AMORIM	11,240	2,55	-3,10
CTT	2,465	-1,00	4,89
EDP	4,713	0,40	-8,59
EDP R	18,800	-2,19	-17,54
GALP	9,208	-1,92	5,19
IBERSOL	5,260	0,00	-2,59
J MARTINS	12,995	0,78	-5,97
MOTA ENGIL	1,434	-0,42	5,13
NAVIGATOR	2,764	-1,50	10,65
NOVABASE	3,860	-1,78	20,25
NOS	2,754	-0,36	-3,64
PHAROL	0,125	0,32	-0,16
REN	2,275	-0,66	-3,81
SEMAPA	12,120	1,00	34,67
SONAE SGPS	0,677	-1,67	2,34

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	2,55
SEMAPA	1,00
J MARTINS	0,78
EDP	0,40
PHAROL	0,32
SONAE SGPS	-1,67
NOVABASE	-1,78
GALP	-1,92
EDP R	-2,19
BCP	-2,93



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.729,51	-0,94%	-3,45%	5.424,71	3.500,02
CAC40	5.779,84	0,22%	4,11%	6.067,29	3.632,06
ESTX 50 PR	3.689,10	-0,29%	3,84%	3.827,36	2.302,84
XTRA DAX	13.864,81	-0,61%	1,06%	14.169,49	8.255,65
S&P 500	3.858,95	-0,46%	2,74%	3.950,43	2.191,86
IBEX 35	8.252,90	1,73%	2,22%	9.946,40	5.814,50
NIKKEI 225	30.156,03	0,46%	9,88%	30.714,52	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.