

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

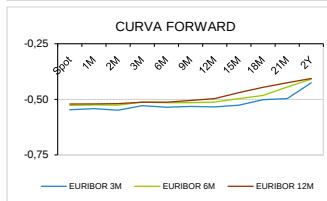
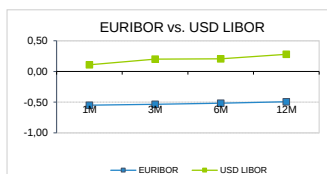
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

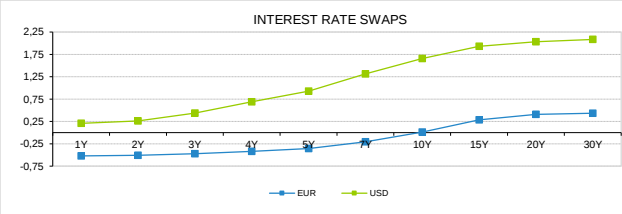
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5490	0	0	1M	0,1086	0	-1	0,0494
3M	-0,5350	0	0	3M	0,2006	1	1	0,0866
6M	-0,5160	0	0	6M	0,2054	0	0	0,1039
12M	-0,4930	0	0	12M	0,2794	0	-1	0,1615
								-0,5958

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5208	0	-1	-0,4974	-0,2650	0,0800
2Y	-0,5077	0	-1	-0,4513	-0,1840	0,1615
3Y	-0,4733	-1	-1	-0,3870	-0,0950	0,2375
4Y	-0,4202	-1	-2	-0,3155	-0,0110	0,3115
5Y	-0,3560	-1	-2	-0,2355	0,0690	0,3780
7Y	-0,2070	-1	-1	-0,0775	0,2180	0,4920
10Y	0,0125	-1	1	0,1370	0,3930	0,6080
15Y	0,2860	-1	3	0,3742	0,5420	0,6700
20Y	0,4095	-2	4	0,4658	0,5718	0,6480
30Y	0,4335	-2	5	0,4611	0,5154	0,5511

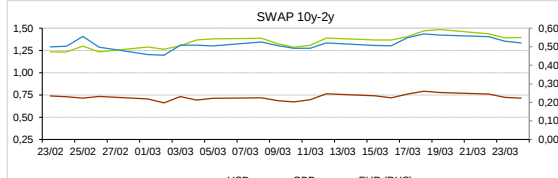
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2072	0	3	0,3210	1,4537	2,2110
2Y	0,2608	0	5	0,5441	1,6835	2,3010
3Y	0,4373	0	10	0,8563	1,8430	2,3666
4Y	0,6873	0	16	1,1173	1,9740	2,4030
5Y	0,9273	0	20	1,3349	2,0710	2,4553
7Y	1,3132	0	23	1,6180	2,1950	2,4660
10Y	1,6559	0	21	1,8770	2,3183	2,4850
15Y	1,9309	0	18	2,0710	2,3500	2,4600
20Y	2,0331	-1	16	2,1320	2,3563	2,4140
30Y	2,0837	-1	13	2,1095	2,2800	2,3255

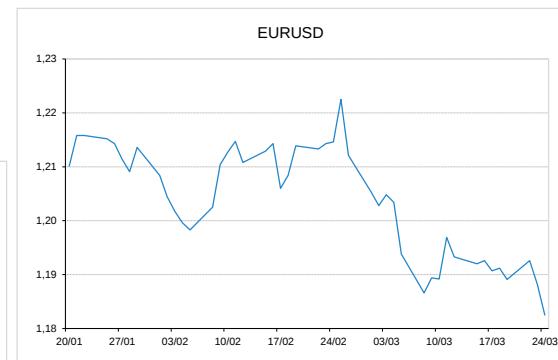
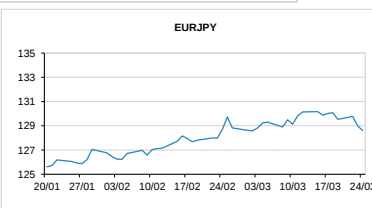
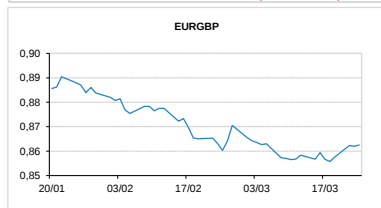


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	63,99	3,20	-2,19	OT 2Y	-0,635	0,00	-6,60
JETFUEL	500,50	-27,50	-48,00	OT 5Y	-0,330	-0,02	-10,20
DIESEL	487,75	-26,75	-49,50	OT 10Y	0,159	-0,01	-6,10
COBRE	8.871,00	-128,50	-226,50	BUND 10Y	-0,873	-1,58	-2,20
ZINCO	2.827,25	-29,25	-21,25	SCHATZ 2Y	-0,071	-0,69	-2,10
OURO	1.736,64	8,68	-61,79	T-NOTE 10Y	2,393	0,15	22,00
TRIGO	626,50	-8,25	-59,00	T-NOTE 2Y	0,750	-0,93	3,00
LICENÇA C02	41,21	-0,22	2,06	GILT 10Y	1,009	-0,82	7,70



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1825	-0,49%	-2,64%	1,1849	1,1872	1,1926
EUR/GBP	0,8625	-0,06%	-0,26%	0,8640	0,8655	0,8687
EUR/JPY	128,6	0,30%	0,07%	128,60	128,60	128,60
EUR/CHF	1,1065	0,07%	-0,40%	1,1058	1,1052	1,1040
EUR/BRL	6,5786	-0,57%	0,13%	6,6296	6,7079	6,9130
EUR/PLN	4,6235	-0,16%	-2,51%	4,6299	4,6368	4,6555



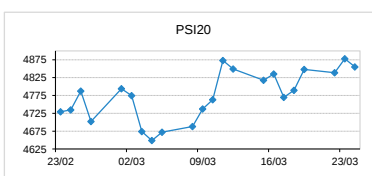
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1825	0,8625	128,60	1,1065	10,1683	7,4358	1,4848	1,55208	6,5786	10,1294
USD	0,8453	-	0,7288	108,905	0,9360	8,5942	6,2859	1,2551	1,3121	5,5292	8,5757

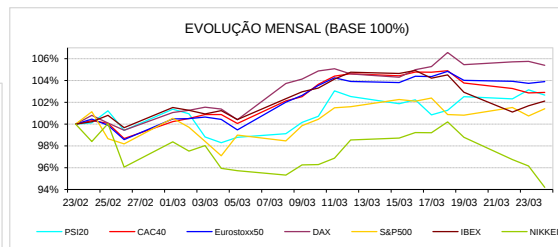
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,850	-0,09	13,37
BCP	0,118	1,55	-4,30
CORT. AMORIM	10,140	-1,93	-12,59
CTT	3,230	1,57	37,45
EDP	4,908	-2,31	-4,81
EDP R	17,440	-1,69	-23,42
GALP	10,065	1,83	15,09
IBERSOL	5,240	-1,87	-2,96
J MARTINS	13,465	-0,33	-2,57
MOTA ENGIL	1,416	1,00	3,81
NAVIGATOR	2,714	-0,59	8,65
NOVABASE	3,680	0,00	14,64
NOS	3,102	-0,77	8,54
PHAROL	0,117	1,92	-6,25
REN	2,360	-2,88	-0,21
SEMAPA	11,800	0,34	31,11
SONAE SGPS	0,798	1,01	20,63

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	1,92
GALP	1,83
CTT	1,57
BCP	1,55
SONAE SGPS	1,01
EDP R	-1,69
IBERSOL	-1,87
CORT. AMORIM	-1,93
EDP	-2,31
REN	-2,88



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.855,24	-0,47%	-0,88%	5.317,89	3.694,85
CAC40	5.947,15	0,04%	7,14%	6.089,20	4.038,06
ESTX 50 PR	3.832,39	0,15%	7,88%	3.874,91	2.507,61
XTRA DAX	14.611,85	-0,34%	6,51%	14.804,01	9.102,17
S&P 500	3.935,90	0,66%	4,80%	3.983,87	2.344,44
IBEX 35	8.426,40	0,43%	4,37%	8.740,10	6.329,50
NIKKEI 225	28.405,52	-2,04%	3,50%	30.714,52	17.646,50



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.