

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

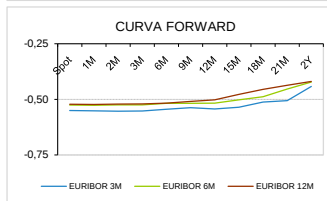
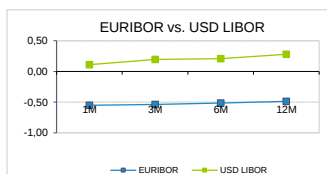
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

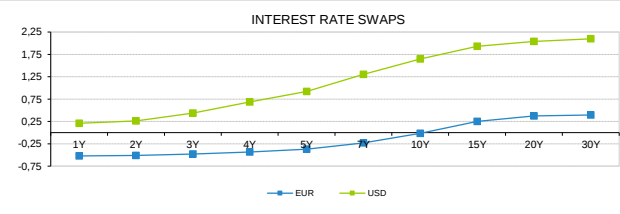
INTERBANK OFFERED RATES								
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR
1M	-0,5510	0	0	1M	0,1103	0	0	0,0498
3M	-0,5380	0	0	3M	0,1951	-1	1	0,0901
6M	-0,5140	0	0	6M	0,2095	0	1	0,1059
12M	-0,4870	1	1	12M	0,2800	0	0	0,1636
								-0,8058
								-0,7572
								-0,7112
								-0,5944

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,5214	0	-2	-0,5021	-0,2891	0,0464
2Y	-0,5115	0	-5	-0,4608	-0,2092	0,1263
3Y	-0,4807	-1	-8	-0,4036	-0,1235	0,2003
4Y	-0,4327	-1	-10	-0,3352	-0,0406	0,2700
5Y	-0,3720	-1	-12	-0,2587	0,0374	0,3375
7Y	-0,2295	-2	-12	-0,1058	0,1820	0,4523
10Y	-0,0170	-3	-11	0,1028	0,3581	0,5650
15Y	0,2520	-3	-8	0,3362	0,4996	0,6260
20Y	0,3730	-3	-6	0,4263	0,5288	0,6030
30Y	0,3940	-4	-5	0,4191	0,4703	0,5043

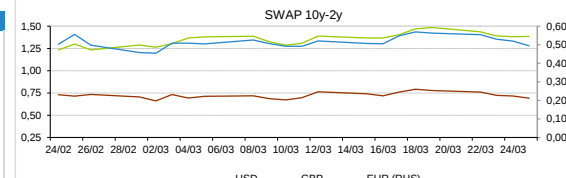
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	0,25
Reino Unido	0,10
Japão	0,10
Canadá	0,25
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	2,75
Austrália	0,10
Índia	3,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2085	0	2	0,3179	1,4391	2,1985
2Y	0,2606	0	1	0,5482	1,6520	2,2575
3Y	0,4348	0	1	0,8290	1,8065	2,3110
4Y	0,6841	0	3	1,0790	1,9440	2,4088
5Y	0,9215	0	6	1,2910	2,0799	2,4422
7Y	1,3038	0	10	1,6000	2,1750	2,4915
10Y	1,6465	0	10	1,8680	2,2970	2,5202
15Y	1,9316	2	9	2,0730	2,3470	2,4981
20Y	2,0396	2	8	2,1390	2,3672	2,4200
30Y	2,0977	3	7	2,1390	2,2920	2,3240

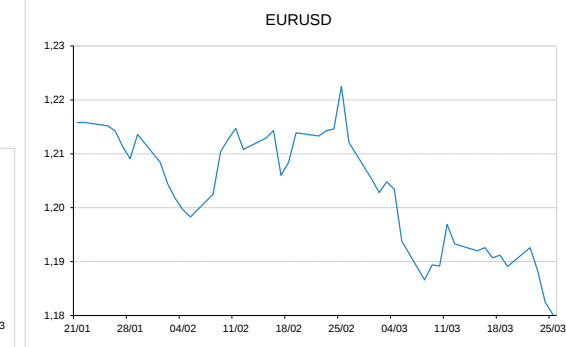
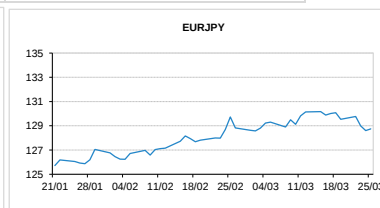
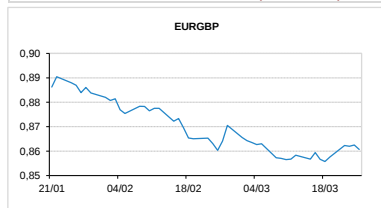


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	61,90	-2,51	-4,21	OT 2Y	-0,637	0,00	-6,30
JETFUEL	524,88	24,38	-34,36	OT 5Y	-0,338	-0,01	-12,80
DIESEL	510,75	23,00	-36,26	OT 10Y	0,148	-0,01	-10,60
COBRE	8.889,00	-2,50	-331,00	BUND 10Y	-0,906	-3,16	-8,00
ZINCO	2.789,05	-38,20	-52,20	SCHATZ 2Y	-0,071	0,00	-2,70
OURO	1.728,55	-6,61	-44,81	T-NOTE 10Y	2,365	-1,05	20,10
TRIGO	614,00	-10,75	-61,75	T-NOTE 2Y	0,743	-0,74	2,60
LICENÇA C02	40,12	-1,48	1,86	GILT 10Y	0,977	-2,55	1,20



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1802	-0,19%	-3,46%	1,1825	1,1848	1,1902
EUR/GBP	0,86068	0,21%	0,40%	0,8621	0,8636	0,8668
EUR/JPY	128,75	-0,12%	0,76%	128,75	128,75	128,75
EUR/CHF	1,1057	0,03%	-0,07%	1,1051	1,1044	1,1032
EUR/BRL	6,6313	0,15%	1,26%	6,6832	6,7614	6,9601
EUR/PLN	4,6369	-0,29%	-2,56%	4,6431	4,6504	4,6692



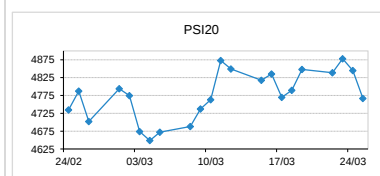
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1802	0,8607	128,75	1,1057	10,1985	7,4360	1,4843	1,55186	6,6313	10,1741
USD	0,8476	-	0,7289	109,095	0,9374	8,6448	6,3024	1,2622	1,3188	5,6442	8,6455

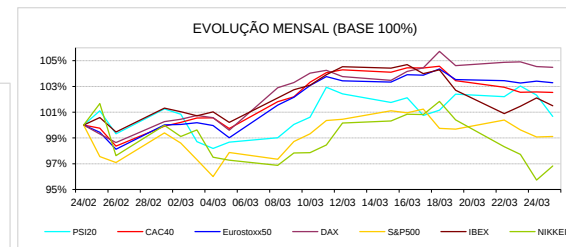
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	5,840	-0,43	13,18
BCP	0,115	-2,46	-6,66
CORT. AMORIM	10,200	1,19	-12,07
CTT	3,210	-0,31	36,60
EDP	4,853	-1,00	-5,88
EDP R	16,580	-4,49	-27,28
GALP	9,740	-3,23	11,26
IBERSOL	5,260	0,38	-2,59
J MARTINS	13,275	-0,90	-3,94
MOTA ENGIL	1,382	-2,68	1,32
NAVIGATOR	2,684	-0,89	7,45
NOVABASE	3,660	1,39	14,02
NOS	3,050	-1,49	6,72
PHAROL	0,114	-2,06	-8,65
REN	2,360	0,00	-0,21
SEMAPA	11,800	0,34	31,11
SONAE SGPS	0,786	-1,63	18,82

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
NOVABASE	1,39
CORT. AMORIM	1,19
IBERSOL	0,38
SEMAPA	0,34
PHAROL	-2,06
BCP	-2,46
MOTA ENGIL	-2,68
GALP	-3,23
EDP R	-4,49



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	4.766,54	-1,62%	-2,69%	5.317,89	3.820,68
CAC40	5.945,01	-0,04%	7,09%	6.089,20	4.142,28
ESTX 50 PR	3.827,83	-0,12%	7,75%	3.874,91	2.626,10
XTRA DAX	14.602,16	-0,06%	6,44%	14.804,01	9.337,02
S&P 500	3.890,72	0,04%	3,58%	3.983,87	2.407,53
IBEX 35	8.394,00	-0,59%	3,97%	8.740,10	6.329,50
NIKKEI 225	28.729,88	1,14%	4,68%	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.