

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

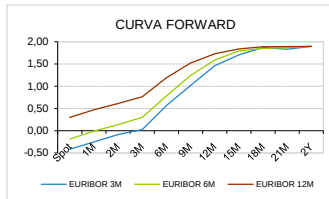
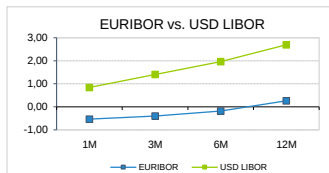
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

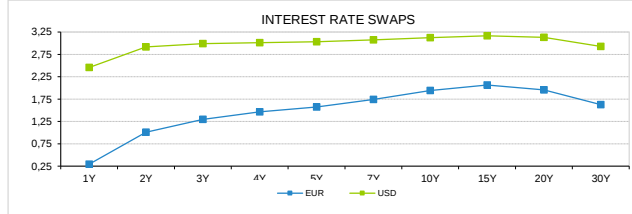
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP	CHF
1M	-0,5330	2	1	1M	0,8421	0	39	0,9406	-0,6250
3M	-0,4020	2	5	3M	1,4019	3	42	1,1155	-0,5225
6M	-0,1830	2	17	6M	1,9646	-1	46	1,3943	-0,4100
12M	0,2630	2	31	12M	2,6947	2	45	1,8190	-0,7000

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	0,2934	-2	27	1,7247	1,9790	2,1310
2Y	1,0082	-7	23	1,8090	2,0070	2,1795
3Y	1,2977	-7	22	1,8650	2,0540	2,2335
4Y	1,4634	-5	26	1,9060	2,0922	2,2895
5Y	1,5744	-5	30	1,9490	2,1405	2,3437
7Y	1,7410	-1	38	2,0420	2,2430	2,3818
10Y	1,9430	1	45	2,1754	2,3015	2,3475
15Y	2,0650	1	48	2,1925	2,1875	2,1071
20Y	1,9555	1	44	2,0200	1,9572	1,8501
30Y	1,6255	1	34	1,6560	1,5840	1,4910

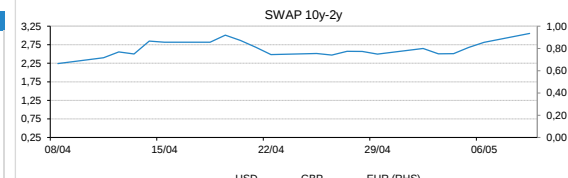
TAXA DE REFERÊNCIA BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	1,00
Reino Unido	1,00
Japão	0,10
Canadá	1,00
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	12,75
Austrália	0,35
Índia	4,50



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	LAST	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4566	-9	34	3,3261	3,0769	3,1799
2Y	2,9166	-14	16	3,2378	3,0875	3,1860
3Y	2,9920	-15	12	3,1846	3,1148	3,2023
4Y	3,0127	-14	14	3,1650	3,1355	3,1980
5Y	3,0310	-13	17	3,1647	3,1546	3,2304
7Y	3,0761	-10	22	3,1790	3,1848	3,2255
10Y	3,1239	-7	28	3,2101	3,2088	3,2195
15Y	3,1658	-5	32	3,2010	3,1710	3,1425
20Y	3,1311	-4	32	3,1300	3,0911	3,0030
30Y	2,9288	-4	28	2,9167	2,8434	2,7747

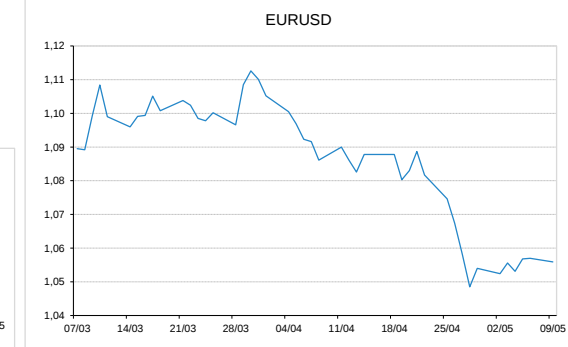
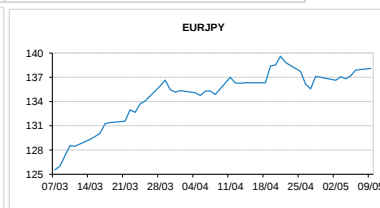
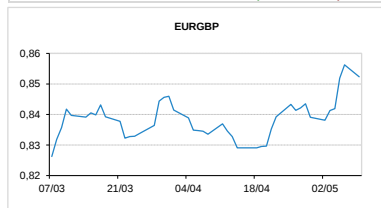


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	106,39	-6,00	4,22	OT 2Y	0,481	-0,05	39,90
JETFUEL	1.247,19	-13,50	162,37	OT 5Y	1,517	-0,04	71,80
DIESEL	1.138,19	-14,30	122,88	OT 10Y	2,242	-0,03	64,90
COBRE	9.388,00	-75,00	-890,50	BUND 10Y	0,637	-6,93	39,60
ZINCO	3.786,25	-136,25	-502,75	SCHATZ 2Y	0,808	-11,29	17,50
OURO	1.862,18	-21,64	-85,36	T-NOTE 10Y	3,792	-4,80	25,20
TRIGO	1.103,75	-4,75	45,50	T-NOTE 2Y	3,098	-6,87	2,70
LICENÇA C02	87,12	-4,42	7,03	GILT 10Y	1,994	-5,35	20,60



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,0559	-0,10%	-3,13%	1,0610	1,0677	1,0819
EUR/GBP	0,85235	0,46%	-1,81%	0,8560	0,8602	0,8680
EUR/JPY	138,1	-0,14%	-0,79%	138,10	138,10	138,10
EUR/CHF	1,0477	-0,49%	-3,29%	1,0472	1,0461	1,0443
EUR/BRL	5,4028	-0,84%	-5,46%	5,5799	5,7580	6,0912
EUR/PLN	4,6917	0,45%	-0,64%	4,7737	4,8706	5,0412



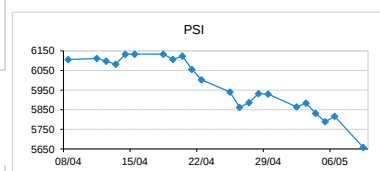
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,0559	0,8524	138,10	1,0477	10,6588	7,4388	1,3691	1,50896	5,4028	10,2049
USD	0,9498	-	0,8126	130,525	0,9964	10,1016	7,0654	1,2973	1,4324	5,1369	9,6653

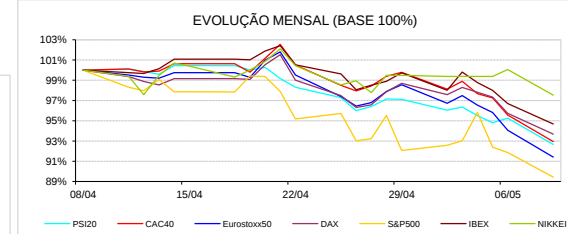
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,730	-1,03	19,96
BCP	0,141	-3,90	-0,28
CORT. AMORIM	10,220	-0,78	-9,40
CTT	3,835	-5,31	-15,81
EDP	4,342	-2,71	-10,14
EDP R	20,070	-5,02	-8,36
GALP	10,250	-5,27	20,31
J MARTINS	19,200	-2,39	-4,48
MOTA ENGIL	1,262	-2,62	-1,10
NAVIGATOR	3,936	-1,16	17,49
NOS	3,778	-0,58	10,79
REN	2,850	-0,70	11,98
SEMAPA	13,100	-0,15	11,97
SONAE SGPS	1,034	-0,48	3,09
GREENVOLT	6,430	-4,60	1,26

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
BCP	-3,90
GREENVOLT	-4,60
EDP R	-5,02
GALP	-5,27
CTT	-5,31



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI	5.657,92	-2,72%	1,59%	6.153,32	4.859,53
CAC40	6.086,02	-2,75%	-14,92%	7.384,86	5.756,38
ESTX 50 PR	3.526,86	-2,82%	-17,95%	4.415,23	3.387,00
XTRA DAX	13.380,67	-2,15%	-15,76%	16.290,19	12.438,85
S&P 500	4.013,15	-2,65%	-15,78%	4.818,62	4.003,17
IBEX 35	8.148,70	-2,08%	-6,49%	9.310,80	7.287,70
NIKKEI 225	26.319,34	-2,53%	-8,59%	30.795,78	24.681,74



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.