

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

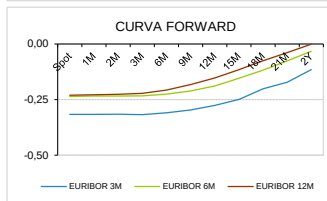
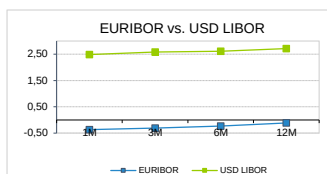
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

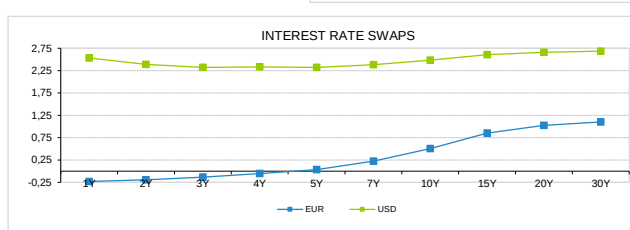
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4859	0	-1	0,7309	-0,7920
3M	-0,3100	0	0	3M	2,5790	0	-2	0,8188	-0,7128
6M	-0,2310	0	0	6M	2,6120	0	-5	0,9394	-0,6466
12M	-0,1140	0	0	12M	2,7130	0	0	1,0910	-0,5122

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2307	0	0	-0,1541	0,1820	0,6050
2Y	-0,1930	0	1	-0,0767	0,2830	0,7110
3Y	-0,1320	1	1	0,0090	0,3910	0,8170
4Y	-0,0540	1	1	0,1030	0,4960	0,9170
5Y	0,0330	1	2	0,2030	0,6020	1,0020
7Y	0,2230	1	3	0,4067	0,7930	1,1460
10Y	0,5060	1	4	0,6820	1,0081	1,2910
15Y	0,8520	1	4	0,9729	1,1982	1,3870
20Y	1,0240	1	5	1,1098	1,2655	1,3840
30Y	1,1020	1	5	1,1526	1,2462	1,3147

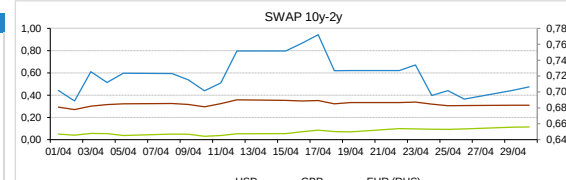
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5310	-2	-1	2,2328	2,2515	2,4900
2Y	2,3870	-3	2	2,1800	2,3195	2,5325
3Y	2,3210	-3	5	2,2100	2,3655	2,5805
4Y	2,3340	-4	4	2,2410	2,4280	2,6255
5Y	2,3210	-3	7	2,2905	2,4680	2,6874
7Y	2,3800	-3	8	2,3870	2,5525	2,7215
10Y	2,4840	-3	8	2,5065	2,6475	2,7750
15Y	2,6060	-3	8	2,6185	2,7185	2,8030
20Y	2,6600	-3	8	2,6710	2,7430	2,8000
30Y	2,6850	-3	8	2,6920	2,7390	2,7710

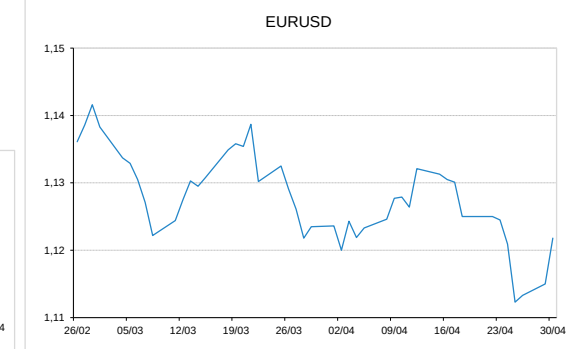
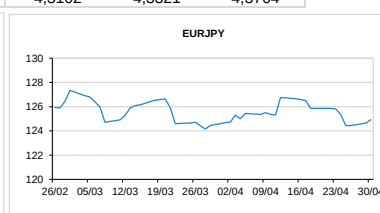


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,86	0,82	5,28	OT 2Y	-0,347	-0,01	-3,80
JETFUEL	670,25	6,75	28,85	OT 5Y	0,081	-0,01	-8,60
DIESEL	643,00	8,25	33,00	OT 10Y	1,115	-0,01	-13,60
COBRE	6 415,00	-4,00	-86,50	BUND 10Y	-0,395	1,45	7,10
ZINCO	2 870,50	31,00	83,25	SCHATZ 2Y	0,037	0,23	2,60
OURO	1 284,39	4,54	-7,91	T-NOTE 10Y	3,215	-2,27	5,80
TRIGO	426,50	-8,75	-37,00	T-NOTE 2Y	2,642	-2,33	2,30
LICENÇA C02	26,22	-0,16	4,68	GILT 10Y	1,110	3,59	19,10



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1218	0,61%	-0,16%	1,1308	1,1392	1,1559
EUR/GBP	0,86248	0,11%	-0,68%	0,8653	0,8681	0,8744
EUR/JPY	124,93	-0,23%	-0,20%	124,93	124,93	124,93
EUR/CHF	1,1424	-0,15%	-1,97%	1,1412	1,1401	1,1379
EUR/BRL	4,4138	-0,07%	-2,17%	4,4827	4,5529	4,6848
EUR/PLN	4,2882	0,08%	0,14%	4,3102	4,3321	4,3764



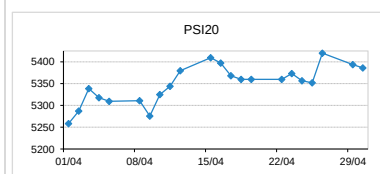
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1218	0,8625	124,93	1,1424	10,6460	7,4655	1,5039	1,59061	4,4138	9,6783
USD	0,8922	-	0,7669	111,375	1,0190	9,5020	6,6612	1,3451	1,4208	3,9510	8,6440

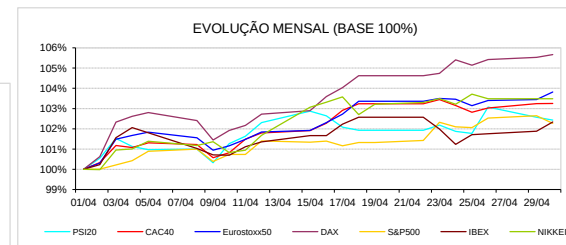
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,985	-1,20	20,43
BCP	0,250	0,20	8,98
CORT. AMORIM	10,740	0,94	19,33
CTT	2,526	-5,89	-14,26
EDP	3,379	0,54	10,82
EDP R	8,850	-0,23	13,83
GALP	14,970	-0,13	8,52
IBERSOL	7,940	-0,50	0,51
J MARTINS	14,520	0,14	40,43
MOTA ENGIL	2,374	-0,08	47,45
NAVIGATOR	3,940	-0,71	9,44
NOS	5,985	0,17	13,03
NOVABASE	2,500	-0,79	23,76
PHAROL	0,157	-1,51	-4,04
RAMADA	7,680	0,00	2,40
REN	14,620	-0,14	11,60
SEMAPA	0,913	-0,11	7,54
SONAE CAP.	0,994	0,15	22,72
SONAE SGPS	7,680	0,00	2,40

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	0,94
EDP	0,54
BCP	0,20
NOS	0,17
SONAE CAP.	0,15
NAVIGATOR	-0,71
NOVABASE	-0,79
ALTRI	-1,20
PHAROL	-1,51
CTT	-5,89



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5 386,21	-0,14%	13,84%	5 801,45	4 551,84
CAC40	5 581,27	0,01%	17,98%	5 657,44	4 555,99
ESTX 50 PR	3 514,62	0,36%	17,10%	3 596,20	2 908,70
XTRA DAX	12 344,08	0,13%	16,91%	13 204,31	10 279,20
S&P 500	2 932,17	-0,36%	16,97%	2 949,52	2 346,58
IBEX 35	9 560,20	0,45%	11,95%	10 291,40	8 286,20
NIKKEI 225	22 258,73	-0,22%	11,21%	24 448,07	18 948,58



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.