

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

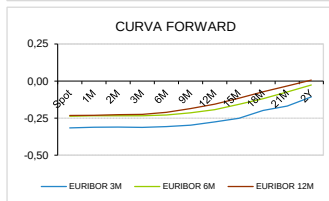
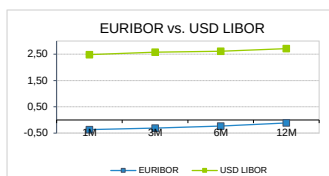
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

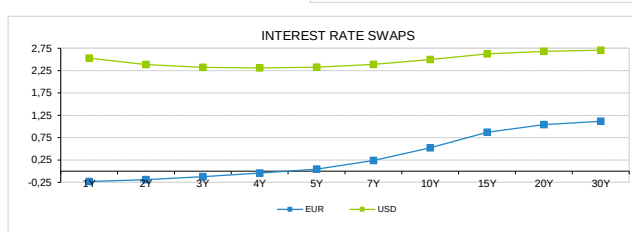
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4833	0	-1	0,7329	-0,7962
3M	-0,3090	0	0	3M	2,5755	0	-2	0,8193	-0,7198
6M	-0,2320	0	0	6M	2,6115	-1	-6	0,9394	-0,6544
12M	-0,1140	0	0	12M	2,7104	-1	-2	1,0985	-0,5134

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2321	0	0	-0,1569	0,1699	0,6185
2Y	-0,1890	0	2	-0,0747	0,2830	0,7250
3Y	-0,1220	1	2	0,0136	0,4070	0,8295
4Y	-0,0420	1	3	0,1101	0,5091	0,9274
5Y	0,0460	1	3	0,2116	0,6149	1,0160
7Y	0,2380	2	4	0,4167	0,8069	1,1590
10Y	0,5240	2	5	0,6921	1,0242	1,3060
15Y	0,8690	2	6	0,9896	1,2206	1,4045
20Y	1,0400	2	7	1,1256	1,2845	1,4025
30Y	1,1160	1	6	1,1693	1,2650	1,3325

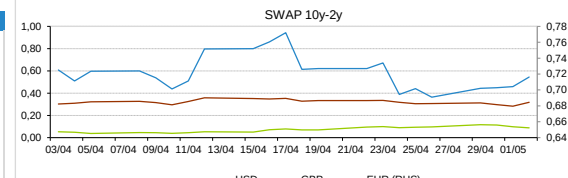
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5290	-1	-2	2,3328	2,3365	2,5250
2Y	2,3850	-2	0	2,3065	2,3750	2,5730
3Y	2,3210	-2	1	2,3010	2,4250	2,6160
4Y	2,3100	-2	8	2,3495	2,4740	2,6550
5Y	2,3270	-1	4	2,3863	2,5170	2,7098
7Y	2,3900	-1	6	2,4075	2,5930	2,7420
10Y	2,4960	-1	8	2,5530	2,6430	2,7870
15Y	2,6220	-1	10	2,6220	2,7400	2,8110
20Y	2,6790	-1	10	2,6960	2,7255	2,7770
30Y	2,7060	-1	11	2,7080	2,7190	2,7760

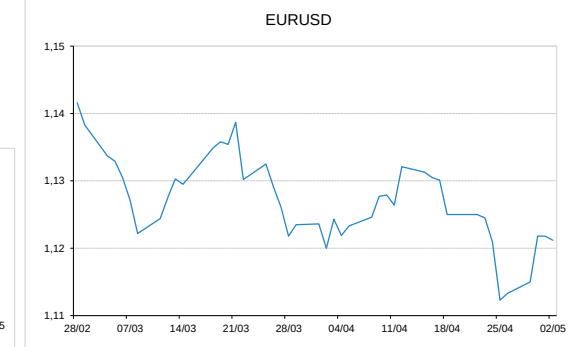
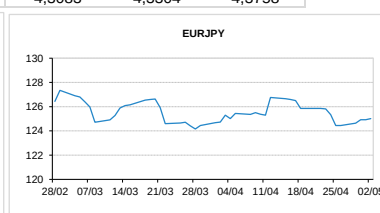


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	70,22	-1,96	1,29	OT 2Y	-0,337	0,01	-2,20
JETFUEL	666,08	-4,80	13,03	OT 5Y	0,079	0,00	-8,40
DIESEL	639,08	-2,80	19,78	OT 10Y	1,113	0,00	-14,20
COBRE	6.234,50	-180,00	-236,00	BUND 10Y	-0,379	1,30	7,10
ZINCO	2.847,00	-68,00	-114,50	SCHATZ 2Y	0,034	-0,23	3,20
OURO	1.271,21	-5,56	-21,26	T-NOTE 10Y	3,265	4,22	6,10
TRIGO	443,50	7,50	-25,00	T-NOTE 2Y	2,718	3,88	6,40
LICENÇA C02	24,70	-1,08	2,69	GILT 10Y	1,113	3,32	19,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1212	-0,05%	0,11%	1,1300	1,1386	1,1556
EUR/GBP	0,8593	0,37%	0,08%	0,8620	0,8648	0,8709
EUR/JPY	125,01	-0,06%	-0,22%	125,01	125,01	125,01
EUR/CHF	1,1391	0,07%	-1,83%	1,1380	1,1369	1,1348
EUR/BRL	4,4233	-0,64%	-2,31%	4,4925	4,5628	4,6974
EUR/PLN	4,2864	-0,06%	0,25%	4,3083	4,3304	4,3758



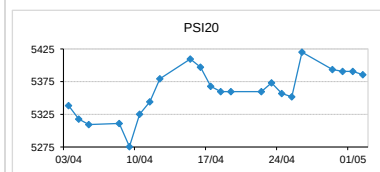
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1212	0,8593	125,01	1,1391	10,6972	7,4661	1,5058	1,59614	4,4233	9,7922
USD	0,8942	-	0,7671	111,535	1,0192	9,5569	6,6761	1,3454	1,4283	3,9648	8,7527

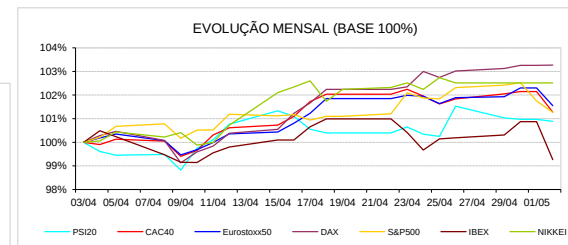
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,950	-0,50	19,83
BCP	0,255	1,76	10,89
CORT. AMORIM	10,640	-0,93	18,22
CTT	2,514	-0,48	-14,66
EDP	3,349	-0,89	9,84
EDP R	8,780	-0,79	12,93
GALP	14,935	-0,23	8,26
IBERSOL	7,960	0,25	0,76
J MARTINS	14,540	0,14	40,62
MOTA ENGIL	2,344	-1,26	45,59
NAVIGATOR	3,912	-0,71	8,67
NOS	5,955	-0,50	12,46
NOVABASE	2,480	-0,80	22,77
PHAROL	0,162	3,58	-0,61
RAMADA	7,700	0,26	2,67
REN	14,560	-0,41	11,15
SEMAPA	0,908	-0,55	6,95
SONAE CAP.	1,000	0,55	23,40
SONAE SGPS	7,700	0,26	2,67

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
PHAROL	3,58
BCP	1,76
SONAE CAP.	0,55
RAMADA	0,26
RAMADA	0,26
EDP R	-0,79
NOVABASE	-0,80
EDP	-0,89
CORT. AMORIM	-0,93
MOTA ENGIL	-1,26



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.385,71	-0,09%	13,83%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.538,86	-0,85%	17,08%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.488,93	-0,73%	16,24%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.345,42	0,01%	16,92%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.910,24	-0,47%	16,08%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.418,20	-1,59%	10,28%	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.