

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

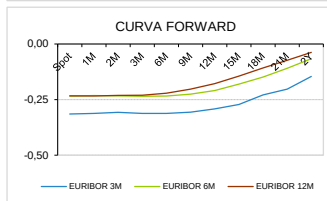
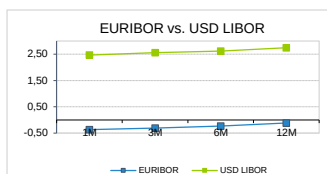
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

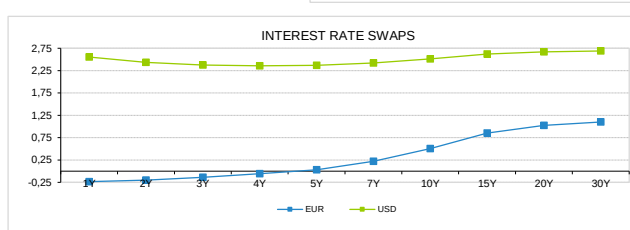
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3670	0	0	1M	2,4666	0	-1	0,7314	-0,7940
3M	-0,3080	0	0	3M	2,5599	-1	-4	0,8124	-0,7178
6M	-0,2290	0	0	6M	2,6174	-2	-4	0,9244	-0,6528
12M	-0,1150	0	0	12M	2,7455	1	0	1,0828	-0,5152

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2337	0	0	-0,1820	0,1412	0,5470
2Y	-0,2000	-1	-1	-0,1110	0,2412	0,6550
3Y	-0,1380	-2	-1	-0,0260	0,3440	0,7590
4Y	-0,0570	-2	-1	0,0660	0,4480	0,8580
5Y	0,0300	-2	-2	0,1620	0,5510	0,9460
7Y	0,2200	-3	-2	0,3620	0,7400	1,1001
10Y	0,5050	-3	-3	0,6350	0,9623	1,2440
15Y	0,8510	-3	-3	0,9332	1,1587	1,3470
20Y	1,0230	-3	-2	1,0741	1,2291	1,3480
30Y	1,1000	-3	-2	1,1192	1,2120	1,2800

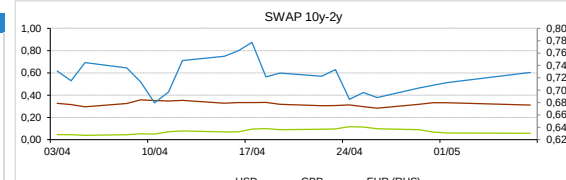
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,5550	-1	-2	2,2569	2,2265	2,4115
2Y	2,4340	-1	-1	2,1810	2,2650	2,4610
3Y	2,3730	-1	0	2,1930	2,3140	2,5040
4Y	2,3570	-2	1	2,2240	2,3620	2,5420
5Y	2,3660	-2	1	2,2600	2,4050	2,6028
7Y	2,4190	-2	1	2,3380	2,4830	2,6602
10Y	2,5110	-2	1	2,4445	2,5910	2,6840
15Y	2,6210	-2	1	2,5708	2,6575	2,7110
20Y	2,6700	-3	1	2,5950	2,6774	2,7060
30Y	2,6890	-3	1	2,6110	2,6500	2,6790

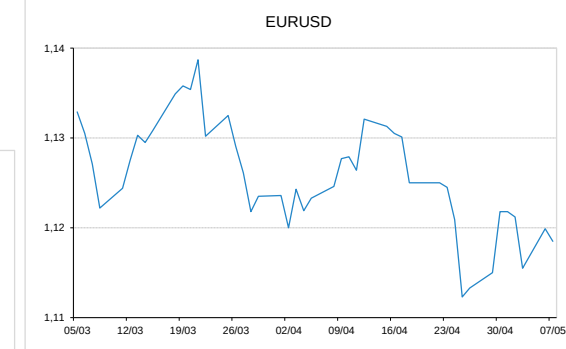
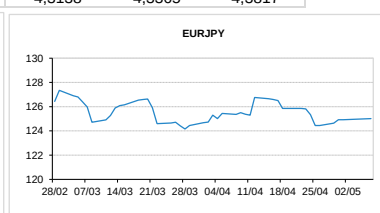
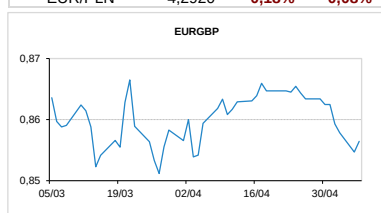


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	70,19	-1,05	0,26	OT 2Y	-0,317	0,02	0,10
JETFUEL	676,53	10,45	27,09	OT 5Y	0,070	-0,02	-10,50
DIESEL	649,53	10,45	33,84	OT 10Y	1,094	-0,03	-16,30
COBRE	6.243,00	69,00	-256,00	BUND 10Y	-0,449	-4,76	7,10
ZINCO	2.853,00	47,00	-109,50	SCHATZ 2Y	0,018	-1,15	3,20
OURO	1.283,90	2,13	-7,81	T-NOTE 10Y	3,189	-2,91	6,10
TRIGO	441,00	3,75	-28,75	T-NOTE 2Y	2,663	-2,52	6,40
LICENÇA C02	26,38	1,05	1,78	GILT 10Y	1,088	-5,45	19,00



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1185	-0,13%	-0,54%	1,1272	1,1360	1,1526
EUR/GBP	0,85645	-0,20%	0,63%	0,8591	0,8620	0,8680
EUR/JPY	123,73	0,32%	1,32%	123,73	123,73	123,73
EUR/CHF	1,1422	-0,26%	-1,47%	1,1411	1,1400	1,1378
EUR/BRL	4,4562	-0,26%	-2,65%	4,5261	4,5977	4,7313
EUR/PLN	4,2920	-0,18%	-0,08%	4,3138	4,3365	4,3817



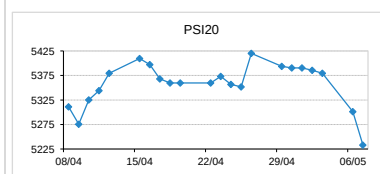
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1185	0,8565	123,73	1,1422	10,7318	7,4660	1,5066	1,5962	4,4562	9,7864
USD	0,8939	-	0,7664	110,405	1,0223	9,5823	6,6736	1,3474	1,4270	3,9892	8,7429

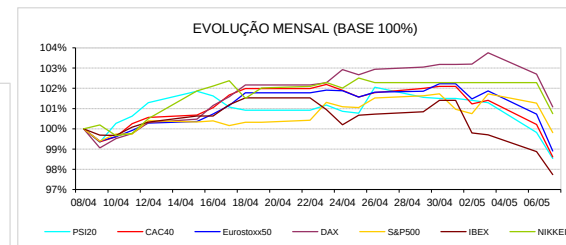
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,645	-3,42	14,57
BCP	0,249	-0,52	8,37
CORT. AMORIM	10,320	-1,71	14,67
CTT	2,476	-1,12	-15,95
EDP	3,300	-0,57	8,23
EDP R	8,600	-0,81	10,61
GALP	14,190	-1,13	2,86
IBERSOL	7,880	1,03	-0,25
J MARTINS	14,010	0,39	35,49
MOTA ENGIL	2,166	-3,82	34,53
NAVIGATOR	3,708	-1,54	3,00
NOS	5,860	-0,26	10,67
NOVABASE	2,530	0,40	25,25
PHAROL	0,159	0,13	-2,45
RAMADA	7,720	0,00	2,93
REN	14,080	-2,09	7,48
SEMAPA	0,890	-0,45	4,83
SONAE CAP.	0,967	-1,12	19,38
SONAE SGPS	7,720	0,00	2,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
IBERSOL	1,03
NOVABASE	0,40
J MARTINS	0,39
PHAROL	0,13
NAVIGATOR	-1,54
CORT. AMORIM	-1,71
REN	-2,09
ALTRI	-3,42
MOTA ENGIL	-3,82



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.233,02	-1,29%	10,60%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.395,75	-1,60%	14,06%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.400,80	-1,81%	13,29%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.092,74	-1,58%	14,53%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.890,34	-1,44%	15,30%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.224,10	-1,15%	8,01%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.923,72	-1,51%	9,54%	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.