

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

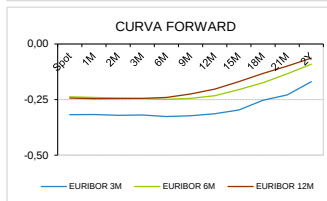
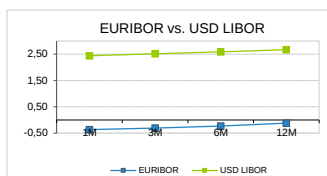
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

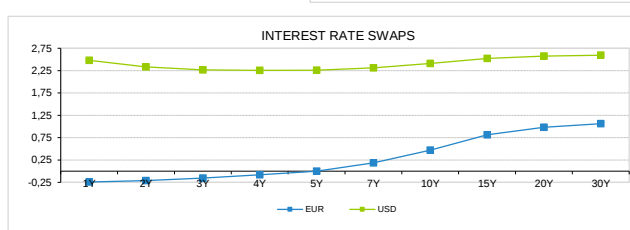
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4396	-1	-4	0,7311	-0,7896
3M	-0,3110	0	0	3M	2,5180	-1	-8	0,8045	-0,7120
6M	-0,2320	0	0	6M	2,5876	0	-5	0,9119	-0,6538
12M	-0,1210	0	-1	12M	2,6723	-2	-8	1,0601	-0,5128

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2426	0	-1	-0,2046	0,1180	0,5282
2Y	-0,2100	0	0	-0,1329	0,2155	0,6287
3Y	-0,1550	-1	-1	-0,0495	0,3190	0,7326
4Y	-0,0820	-1	-2	0,0415	0,4200	0,8309
5Y	0,0010	-1	-3	0,1385	0,5215	0,9110
7Y	0,1870	-1	-3	0,3345	0,7095	1,0589
10Y	0,4680	-2	-4	0,6040	0,9229	1,2043
15Y	0,8120	-2	-5	0,8920	1,1122	1,3030
20Y	0,9830	-2	-5	1,0285	1,1801	1,3024
30Y	1,0620	-2	-5	1,0716	1,1620	1,2336

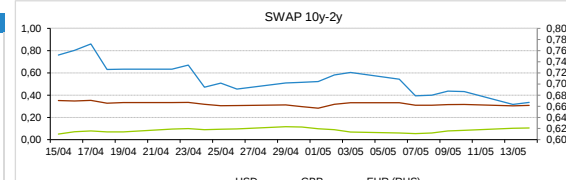
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4790	-1	-9	2,1218	2,1798	2,3790
2Y	2,3320	-1	-9	2,1084	2,2200	2,4486
3Y	2,2660	-1	-7	2,0880	2,2700	2,4730
4Y	2,2550	-3	-9	2,1280	2,3210	2,5130
5Y	2,2590	-1	-6	2,1715	2,3860	2,5738
7Y	2,3130	-1	-5	2,3016	2,4706	2,6020
10Y	2,4100	-1	-5	2,4202	2,5541	2,6721
15Y	2,5220	-1	-5	2,5235	2,5980	2,6750
20Y	2,5730	-1	-6	2,5689	2,6160	2,6915
30Y	2,5940	-1	-6	2,5850	2,6070	2,6370

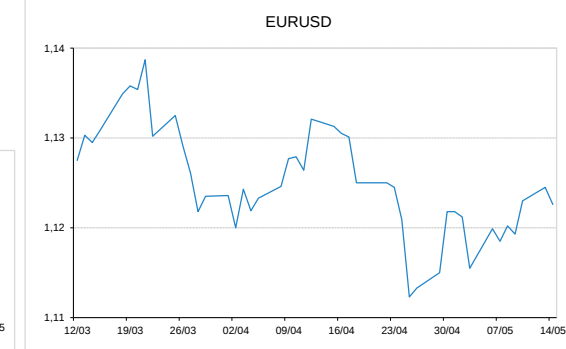
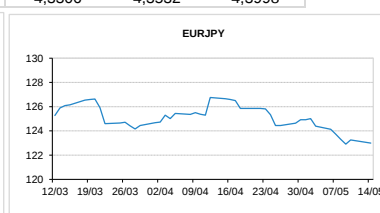


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	71,36	1,13	0,30	OT 2Y	-0,328	0,00	1,90
JETFUEL	674,50	2,50	7,56	OT 5Y	0,105	-0,01	-2,00
DIESEL	643,75	2,75	6,00	OT 10Y	1,139	-0,02	-3,30
COBRE	6.021,50	-115,00	-473,00	BUND 10Y	-0,477	0,14	-13,60
ZINCO	2.617,00	-52,50	-329,00	SCHATZ 2Y	-0,009	-0,23	-6,60
OURO	1.294,62	-5,28	4,27	T-NOTE 10Y	3,152	1,61	-12,10
TRIGO	446,75	9,75	-21,75	T-NOTE 2Y	2,595	1,94	-15,80
LICENÇA C02	25,86	0,83	-0,72	GILT 10Y	1,027	0,64	-11,90



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1226	-0,17%	-0,77%	1,1312	1,1398	1,1562
EUR/GBP	0,86723	-0,43%	-0,48%	0,8699	0,8728	0,8790
EUR/JPY	123	0,05%	2,98%	123,00	123,00	123,00
EUR/CHF	1,1306	-0,11%	0,38%	1,1295	1,1284	1,1263
EUR/BRL	4,4554	0,58%	-1,78%	4,5262	4,5954	4,7254
EUR/PLN	4,3082	-0,08%	-0,78%	4,3306	4,3532	4,3998



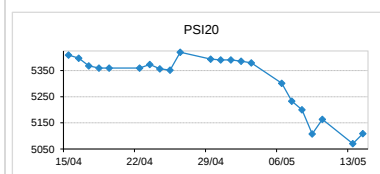
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1226	0,8672	123,00	1,1306	10,7602	7,4687	1,5093	1,6136	4,4554	9,7901
USD	0,8919	-	0,7741	109,575	1,0086	9,6037	6,6618	1,3466	1,4400	3,9775	8,7430

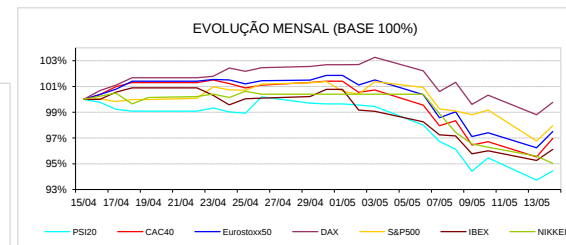
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,285	0,48	8,36
BCP	0,252	2,32	9,59
CORT. AMORIM	10,180	0,59	13,11
CTT	2,248	-1,23	-23,69
EDP	3,154	-0,10	3,44
EDP R	8,640	0,00	11,13
GALP	13,930	1,60	0,98
IBERSOL	8,140	0,74	3,04
J MARTINS	13,580	0,37	31,33
MOTA ENGIL	2,110	3,23	31,06
NAVIGATOR	3,458	0,29	-3,94
NOS	5,735	0,26	8,31
NOVABASE	2,500	-0,40	23,76
PHAROL	0,157	0,77	-3,68
RAMADA	7,640	-1,29	1,87
REN	13,100	0,00	0,00
SEMAPA	0,864	-0,69	1,77
SONAE CAP.	0,942	1,84	16,23
SONAE SGPS	7,640	-1,29	1,87

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
MOTA ENGIL	3,23
BCP	2,32
SONAE CAP.	1,84
GALP	1,60
PHAROL	0,77
NOVABASE	-0,40
SEMAPA	-0,69
CTT	-1,23
RAMADA	-1,29
RAMADA	-1,29



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.109,10	0,76%	7,98%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.341,35	1,50%	12,91%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.364,38	1,31%	12,09%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	11.991,62	0,97%	13,57%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.846,14	1,21%	13,53%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.127,60	0,89%	6,88%	10.291,40	8.286,20
NIKKEI 225	21.067,23	-0,59%	5,26%	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.