

AGRE - ASSESSORIA E GESTÃO DE RISCO A EMPRESAS

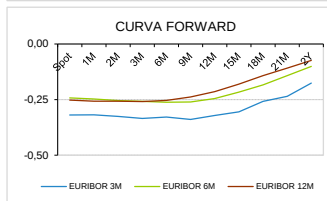
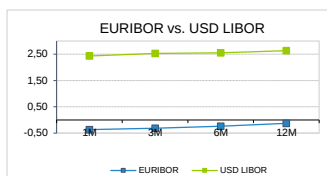
derivados.caixabi@caixabi.pt - 21 313 73 26

RENTA FIXA

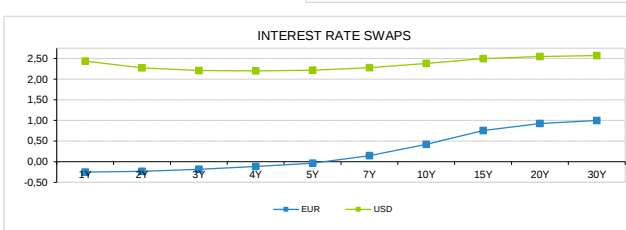
INTERBANK OFFERED RATES									
EURIBOR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	USD LIBOR	LAST PRICE	1D (bps)	1M (bps)	GBP LIBOR	CHF LIBOR
1M	-0,3660	0	0	1M	2,4324	-1	-4	0,7313	-0,7920
3M	-0,3120	0	0	3M	2,5251	0	-6	0,8064	-0,7102
6M	-0,2370	0	-1	6M	2,5509	0	-9	0,9053	-0,6560
12M	-0,1280	0	-2	12M	2,6325	-1	-12	1,0449	-0,5192

INTEREST RATE SWAPS						
EUR	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	-0,2520	0	-2	-0,2160	0,1148	0,5150
2Y	-0,2320	-1	-4	-0,1441	0,2166	0,6160
3Y	-0,1850	-2	-6	-0,0576	0,3170	0,7200
4Y	-0,1140	-3	-8	0,0360	0,4166	0,8150
5Y	-0,0350	-3	-10	0,1321	0,5177	0,8957
7Y	0,1450	-4	-12	0,3279	0,7030	1,0410
10Y	0,4210	-4	-14	0,5950	0,9149	1,1880
15Y	0,7560	-4	-15	0,8831	1,1040	1,2870
20Y	0,9240	-4	-16	1,0201	1,1726	1,2880
30Y	0,9990	-4	-16	1,0650	1,1558	1,2206

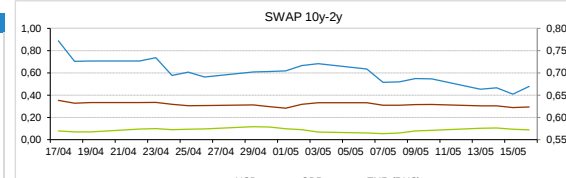
TAXA DE REFERÊNCIA	
BANCO CENTRAL	
Zona Euro	0,00
EUA	2,50
Reino Unido	0,75
Japão	0,10
Canadá	1,75
Suíça	-0,75
China	5,75
Brasil	6,50
Austrália	1,50
Índia	4,00



INTEREST RATE SWAPS				FORWARDS		
USD	FIXING	1D (bps)	1M (bps)	1Y	3Y	5Y
1Y	2,4380	0	-17	2,1033	2,1230	2,3425
2Y	2,2740	1	-21	2,0835	2,1845	2,3690
3Y	2,2120	1	-20	2,0850	2,2070	2,4385
4Y	2,2010	1	-19	2,1230	2,2615	2,4810
5Y	2,2180	1	-18	2,1650	2,3330	2,5401
7Y	2,2780	1	-16	2,2520	2,4055	2,5760
10Y	2,3810	1	-15	2,3881	2,5080	2,6230
15Y	2,4990	1	-15	2,4680	2,5660	2,6560
20Y	2,5500	1	-14	2,5165	2,5840	2,6390
30Y	2,5730	1	-14	2,5460	2,5880	2,6065

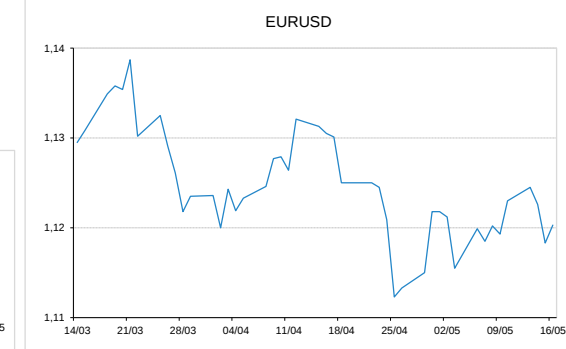
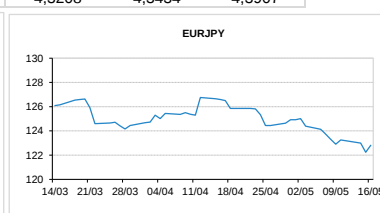


COMMODITIES	LAST	Var. 1D	Var. 1M	BONDS	YIELD	1D (bps)	1M (bps)
BRENT	72,99	1,22	1,78	OT 2Y	-0,349	-0,01	-0,20
JETFUEL	695,25	19,00	29,75	OT 5Y	0,066	-0,03	-8,40
DIESEL	663,50	19,00	28,00	OT 10Y	1,079	-0,05	-12,00
COBRE	6.077,50	58,00	-395,00	BUND 10Y	-0,507	0,14	-16,70
ZINCO	2.683,50	39,25	-232,50	SCHATZ 2Y	-0,023	0,46	-7,30
OURO	1.285,03	-12,95	10,98	T-NOTE 10Y	3,138	2,73	-16,50
TRIGO	462,75	14,00	14,25	T-NOTE 2Y	2,597	3,68	-17,90
LICENÇA C02	25,53	-0,44	-1,47	GILT 10Y	0,992	0,18	-15,50



CAMBIAL

CAMBIAL	FIXING	Var. 1D	Var. 1M	FW 3M	FW 6M	FW 12M
EUR/USD	1,1203	0,18%	-0,90%	1,1289	1,1372	1,1536
EUR/GBP	0,87463	-0,74%	-1,23%	0,8773	0,8802	0,8864
EUR/JPY	122,81	-0,46%	3,08%	122,81	122,81	122,81
EUR/CHF	1,1292	0,16%	0,72%	1,1281	1,1270	1,1250
EUR/BRL	4,4801	0,05%	-1,73%	4,5525	4,6209	4,7512
EUR/PLN	4,2987	0,05%	-0,59%	4,3208	4,3434	4,3907



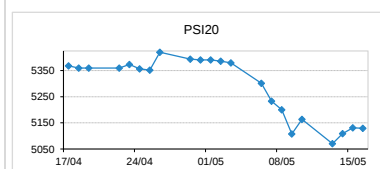
FIXINGS CONTRA USD e EUR

	EUR	USD	GBP	JPY	CHF	SEK	DKK	CAD	AUD	BRL	NOK
EUR	-	1,1203	0,8746	122,81	1,1292	10,7561	7,4678	1,5016	1,6188	4,4801	9,7602
USD	0,8946	-	0,7817	109,935	1,0098	9,6164	6,6802	1,3427	1,4481	4,0171	8,7269

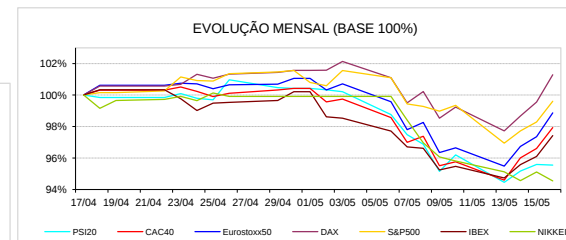
ACCIONISTA

TÍTULO	COTACÃO	1D %	YTD %
ALTRI	6,315	0,56	8,88
BCP	0,255	0,87	10,94
CORT. AMORIM	10,380	1,57	15,33
CTT	2,210	0,27	-24,98
EDP	3,190	1,05	4,62
EDP R	8,610	-1,26	10,74
GALP	14,130	0,93	2,43
IBERSOL	8,040	-0,25	1,77
J MARTINS	13,370	-2,19	29,30
MOTA ENGIL	2,136	0,09	32,67
NAVIGATOR	3,508	1,50	-2,56
NOS	5,760	-0,35	8,78
NOVABASE	2,470	-1,59	22,28
PHAROL	0,155	-1,78	-5,15
RAMADA	7,720	1,31	2,93
REN	13,180	1,07	0,61
SEMAPA	0,861	0,00	1,41
SONAE CAP.	0,931	-3,07	14,88
SONAE SGPS	7,720	1,31	2,93

MAIORES GANHOS/PERDAS	
Título	Variação %
CORT. AMORIM	1,57
NAVIGATOR	1,50
RAMADA	1,31
RAMADA	1,31
REN	1,07
EDP R	-1,26
NOVABASE	-1,59
PHAROL	-1,78
J MARTINS	-2,19
SONAE CAP.	-3,07



ÍNDICE	LAST	Var. 1D	YTD%	MAX Anual	MIN Anual
PSI 20	5.129,04	-0,05%	8,40%	5.801,45	4.551,84
CAC40	5.448,11	1,37%	15,17%	5.657,44	4.555,99
ESTX 50 PR	3.438,56	1,56%	14,56%	3.596,20	2.908,70
XTRA DAX	12.310,37	1,74%	16,59%	13.204,31	10.279,20
S&P 500	2.889,71	1,34%	15,25%	2.954,13	2.346,58
IBEX 35	9.304,30	1,39%	8,95%	10.221,00	8.286,20
NIKKEI 225	21.062,98	-0,59%	5,24%	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.